

ANEXO E

Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

ADMINISTRADORES DE CARTEIRAS DE VALORES MOBILIÁRIOS
1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário
Guilherme Figueiredo - Diretor Responsável pela Administração de Carteira de Valores Mobiliários / Edson Maioli - Diretor Financeiro e de Compliance responsável pelo cumprimento de regras, políticas procedimentos e controles internos e Diretor de Prevenção aos Crimes de Lavagem de Dinheiro e de Financiamento do Terrorismo – PLDFT.
1.1. Declarações dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e da Resolução CVM 21, atestando que:
a. Reviram o formulário de referência
b. O conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa
Vide declaração no Anexo 1. Informamos que a referida declaração foi firmada pelo diretores acima identificados e encontra-se disponível na sede da Empresa.
2. Histórico da empresa
2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa
A AMS Capital Ltda., inscrita no CNPJ sob o nº 02.835.612/0001-20 (“ <u>AMS Capital</u> ” ou “ <u>Empresa</u> ”), é uma sociedade limitada constituída no Brasil em 5/11/1998 que tem como objetivo social principal a atuação como gestora de fundos de investimento e administradora de carteira de valores mobiliários. A AMS Capital atua em diversos segmentos do mercado financeiro e de capitais, incluindo, mas não se limitando a, renda fixa e variável, moedas, crédito, produtos estruturados e mercadorias (<i>commodities</i>).
2.2. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo:

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

a. os principais eventos societários, tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário.
Sem mudanças relevantes nos últimos 5 (cinco) anos.
b. escopo das atividades
Sem alterações relevantes no escopo das atividades nos últimos 5 (cinco) anos.
c. recursos humanos e computacionais
Sem alterações relevantes em recursos humanos e computacionais nos últimos 5 (cinco) anos.
d. regras, políticas, procedimentos e controles internos
As políticas da AMS Capital, bem como procedimentos e regras contidos em tais políticas e controles internos relacionados a tais políticas são ajustados anualmente e sempre que necessário em atendimento a novas regras publicadas pela CVM e pela ANBIMA. Ao longo de 2021, foi criada uma Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Cadastro. Mais recentemente, houve a revisão das políticas da AMS Capital para adequações decorrentes de atualização regulatória. Na data de atualização do presente Formulário de Referência, a AMS Capital se encontra em fase de revisão de suas políticas e manuais internos, a fim de refletir eventuais adequações decorrentes da Resolução CVM nº 175, de 23 de dezembro de 2022, conforme alterada. As políticas atualizadas foram enviadas à ANBIMA e estão disponíveis no <i>website</i> da AMS Capital: http://www.msafra.com.br/quem-somos/compliance
3. Recursos humanos
3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:
a. número de sócios
13 (treze)

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

b. número de empregados
16 (dezesesseis)
c. número de terceirizados
0 (zero) terceirizados
d. indicar o setor de atuação dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e os respectivos exames de certificação realizados para fins do art. 3º, III, c/c art. 4º, III, da Resolução CVM 21
Guilherme Figueiredo (CPF 013.124.188-50), Diretor Responsável pela Administração de Carteiras, responsável pela gestão dos fundos de investimentos geridos pela AMS Capital, e dispensado da Certificação de Gestores ANBIMA para Fundos Estruturados – CGE, Certificação de Gestores ANBIMA – CGA e Certificação ANBIMA de Fundamentos em Gestão – CFG; e
Ezra Moise Safra (CPF 091.351.188-90), Diretor Presidente, responsável pela gestão da Empresa, e dispensado da Certificação de Gestores ANBIMA para Fundos Estruturados – CGE, Certificação de Gestores ANBIMA – CGA e Certificação ANBIMA de Fundamentos em Gestão – CFG
e. lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e que atuem exclusivamente como prepostos, empregados ou sócios da empresa, bem como seus respectivos setores de atuação
Guilherme Figueiredo (CPF 013.124.188-50), Diretor Responsável pela Administração de Carteiras; e
Ezra Moise Safra (CPF 091.351.188-90), Diretor Presidente.
4. Auditores
4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:
a. nome empresarial
b. data de contratação dos serviços
c. descrição dos serviços contratados

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

N/A - A AMS Capital Ltda. não possui auditoria externa.
5. Resiliência financeira
5.1. Com base nas demonstrações financeiras, ateste:
<p>a. se a receita em decorrência de taxas com bases fixas a que se refere o item 9.2.a é suficiente para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários</p>
As receitas da AMS Capital, em decorrência de taxas com base fixas, são suficientes para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários.
<p>b. se o patrimônio líquido da empresa representa mais do que 0,02% dos recursos financeiros sob administração de que trata o item 6.3.c e mais do que R\$ 300.000,00 (trezentos mil reais)</p>
O Patrimônio da AMS Capital é superior a R\$ 300.000,00 (trezentos mil reais), e maior que 0,02% dos recursos financeiros sob sua administração.
5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º da Resolução CVM 21
N/A – Item facultativo para gestores de recursos.
6. Escopo das atividades
6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo:
<p>a. tipos e características dos serviços prestados (gestão discricionária, planejamento patrimonial, controladoria, tesouraria, etc.)</p>
A AMS Capital é uma gestora de recursos, devidamente credenciada perante a CVM exclusivamente como administradora de carteira de valores mobiliários, na categoria “gestora de recursos”.
<p>b. tipos e características dos produtos administrados ou geridos (fundos de investimento, fundos de investimento em participação, fundos de investimento imobiliário, fundos de investimento em direitos creditórios, fundos de índice, clubes de investimento, carteiras administradas, etc.)</p>

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

Gestão de fundos de investimento, notadamente, fundos de investimentos constituídos no âmbito da Instrução CVM N° 555, de 17 de dezembro de 2014.
c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão
Os ativos que podem fazer parte do portfólio dos fundos geridos pela AMS Capital são: títulos de renda fixa de emissão de instituição financeira, debêntures, títulos públicos federais, ações emitidas por companhias abertas e negociadas em bolsa, cotas de fundos de investimentos regulados pela CVM nº 555/14, operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais, operações de derivativos e outros valores mobiliários permitidos pela legislação e regulamento dos fundos de investimentos.
d. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor
A AMS Capital não atua como distribuidora de cotas de fundos de investimento, atuando a Empresa única e exclusivamente com gestão de recursos de terceiros.
6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários, destacando:
a. os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades; e
N/A - A AMS Capital não exerce nenhuma outra atividade, a não ser gestão de fundos de investimento.
b. informações sobre as atividades exercidas por sociedades controladoras, controladas, coligadas e sob controle comum ao administrador e os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades.
Não aplicável, tendo em vista que todos os sócios da AMS Capital são pessoas naturais que não possuem participação societária em nenhuma outra companhia que exerça atividades no mercado financeiro e de capitais que possa ver a causar conflitos de interesse para com as atividades exercidas pela AMS Capital.
Não há empresas controladas ou coligadas pela AMS Capital.

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos e carteiras administradas geridos pela empresa, fornecendo as seguintes informações:
a. número de investidores (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)
Total de 4 (quatro) investidores, todos pessoas naturais, cujos investimentos estão alocados em fundos destinados a investidores qualificados.
b. número de investidores, dividido por:
i. pessoas naturais
4 (quatro)
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)
-
iii. instituições financeiras
-
iv. entidades abertas de previdência complementar
-
v. entidades fechadas de previdência complementar
-
vi. regimes próprios de previdência social
-
vii. seguradoras
-

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil
-
ix. clubes de investimento
-
x. fundos de investimento
-
xi. investidores não residentes
-
xii. outros (especificar)
-
c. recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados)
Total de R\$ 819,9 milhões sob gestão alocados em fundos destinados a investidores qualificados.
d. recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior
Os fundos geridos no país não possuem aplicação em ativos financeiros no exterior na data base de elaboração deste Formulário de Referência. A AMS Capital faz a gestão de fundos no exterior que não estão contemplados no item 6 deste Formulário de Referência.
e. recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)
1º R\$ 722,5 milhões / 2º R\$ 88,9 milhões / 3º R\$ 6,9 milhões / 4º 1,6 milhões.
f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:
i. pessoas naturais

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

R\$ 819,9 milhões
ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)
-
iii. instituições financeiras
-
iv. entidades abertas de previdência complementar
-
v. entidades fechadas de previdência complementar
-
vi. regimes próprios de previdência social
-
vii. seguradoras
-
viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil
-
ix. clubes de investimento
-
x. fundos de investimento
-
xi. investidores não residentes

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

-
xii. outros (especificar)
-
6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:
a. ações
R\$ 16 milhões
b. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras
-
c. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras
-
d. cotas de fundos de investimento em ações
-
e. cotas de fundos de investimento em participações
-
f. cotas de fundos de investimento imobiliário
-
g. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios
-
h. cotas de fundos de investimento em renda fixa
-

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

i. cotas de outros fundos de investimento
-
j. derivativos (valor de mercado)
R\$ 3 milhões
k. outros valores mobiliários
-
l. títulos públicos
R\$ 801 milhões
m. outros ativos
-
6.5. Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária
N/A – A AMS Capital apenas realiza a gestão de recursos de terceiros
6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
A AMS Capital faz gestão de fundos de investimento fora do país. Os valores sob gestão nestes fundos não estão contemplados no item 6 deste formulário.
7. Grupo econômico
7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:
a. controladores diretos e indiretos
Ezra Moise Safra, acima qualificado
b. controladas e coligadas

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

N/A
c. participações da empresa em sociedades do grupo
N/A
d. participações de sociedades do grupo na empresa
N/A
e. sociedades sob controle comum
N/A
7.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma do grupo econômico em que se insere a empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 7.1.
A AMS Capital entende não ser necessário, tendo em vista não existir complexidade em sua estrutura societária.
8. Estrutura operacional e administrativa
8.1. Descrever a estrutura administrativa da empresa, conforme estabelecido no seu contrato ou estatuto social e regimento interno, identificando:
a. atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico
A estrutura operacional e administrativa da Empresa é composta por: (i) Diretor Presidente; (ii) Diretor Responsável pela Administração de Carteiras; (iii) Diretor Financeiro e de <i>Compliance</i> (que também é <i>Data Privacy Officer</i> – DPO e Diretor de PLDFT); (iv) Diretor da Área Econômica; (v) Diretor Contábil; (vi) Diretor Estratégico de Portfolio e Risco; (vii) Diretora Jurídica; (viii) Diretor de Renda Variável de Mercados Emergentes; (ix) Diretor de Crédito; (x) Diretor de Mercados Emergentes; (xi) Diretor de Análise de Tecnologia; (xii) Diretor de Estratégia de Mercados; e (xiii) Diretor de Renda Variável;
Além disso, a AMS Capital conta com os seguintes comitês, de forma a permitir o melhor controle e análise de decisões a serem tomadas, bem como de eventuais situações que se demonstrem:

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

Comitê de Compliance: é o órgão consultivo cuja finalidade é a implementação e o monitoramento do cumprimento do Manual de *Compliance*, do Código de Ética e das demais Políticas da Empresa.

Comitê de Crédito: é o órgão consultivo cuja finalidade é a análise e aprovação de operações de crédito realizadas pelos fundos sob gestão da Empresa.

Comitê de Risco: é o órgão consultivo cuja finalidade é supervisionar e controlar o risco das carteiras sob gestão, bem como as demais atividades e obrigações regulatórias da área.

Comitê de Tecnologia da Informação e Segurança Cibernética: é o órgão consultivo cuja finalidade é estabelecer as regras referentes à proteção de dados, ao uso da tecnologia da informação e à segurança cibernética e supervisionar seu cumprimento.

Os departamentos da AMS Capital contam com a seguinte composição:

áreas administrativas: contas a pagar/receber recursos humanos, contabilidade e controladoria, risco, jurídico, *compliance* e tecnologia; e

área de gestão de recursos de terceiros: economistas, analistas, *traders* e *portfolio managers*.

- b. em relação aos comitês, sua composição, frequência com que são realizadas suas reuniões e a forma como são registradas suas decisões

Comitê de Compliance: É composto pelo Diretor Presidente, Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários, Diretor Financeiro e de *Compliance* e a Diretora Jurídica. As reuniões acontecem no mínimo anualmente, bem como sempre que necessário, e não há registro em ata das discussões e decisões tomadas. Quando necessária, a formalização ocorre por *e-mail*.

Comitê de Crédito: É composto pelo Diretor Presidente, pelo Diretor Responsável pela Administração de Carteiras e pelo Diretor de Crédito. As reuniões acontecem sempre que necessário e há registro em atas enviadas por *e-mail* das discussões e decisões tomadas.

Comitê de Risco: É composto pelo Analista de risco de mercado, o Diretor Estratégico de Portfolio e Risco, o Diretor Financeiro e de *Compliance*, a Diretora Jurídica e o Diretor Contábil. As reuniões acontecem sempre que necessário e não há registro em ata das discussões e decisões tomadas. Quando necessária, a formalização ocorre por *e-mail* enviado aos integrantes do Comitê de Risco. O comitê recebe e analisa diariamente relatórios de risco de mercado.

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

<p><u>Comitê de Tecnologia da Informação e Segurança Cibernética:</u> É composto pelo Diretor Financeiro, de <i>Compliance</i> e DPO, o Coordenador de TI e a Diretora Jurídica. As reuniões acontecem sempre que necessário e não há registro em ata das discussões e decisões tomadas. Quando necessária, a formalização ocorre por <i>e-mail</i>.</p>
<p>c. em relação aos membros da diretoria, suas atribuições e poderes individuais</p>
<p>(i) Diretor Presidente, com função de supervisão geral;</p> <p>(ii) Diretor de Administração de Carteiras, com função de administração de carteira de valores mobiliários;</p> <p>(iii) Diretor Financeiro e de <i>Compliance</i>, com função de supervisão das áreas de Controladoria, Administrativa e RH, Tecnologia e <i>Compliance</i>, que também é Diretor de PLDFT e <i>Data Privacy Officer</i>;</p> <p>(iv) Diretor Estratégico de Portfolio e Risco é responsável pela supervisão e pelo controle do risco das carteiras sob gestão.</p>
<p>8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 8.1.</p>
<p>N/A – A AMS Capital entende não ser necessário</p>
<p>8.3. Em relação a cada um dos diretores de que tratam os itens 8.4, 8.5, 8.6 e 8.7 e dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar, em forma de tabela:</p>
<p>a. nome</p>
<p>b. idade</p>
<p>c. profissão</p>
<p>d. CPF ou número do passaporte</p>
<p>e. cargo ocupado</p>

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

f.	data da posse					
g.	prazo do mandato					
h.	outros cargos ou funções exercidas na empresa					
Os mandatos de todos os diretores têm prazo indeterminado e nenhum deles possui outro cargo, nem exerce outra função distinta daquela descrita no item 8.1.						
Nome	Idade	Profissão	CPF	Cargo	Posse	Comitê
Ezra Moise Safra	52	administrador de empresas	091.351.188-90	Diretor Presidente	6/11/2003	- <i>Compliance</i> - Crédito
Guilherme Figueiredo	55	administrador de empresas	013.124.188-50	Diretor Resp. pela Adm. de Carteiras	6/11/2003	- <i>Compliance</i> - Crédito
Edson Maioli	59	contabilista	055.655.518-03	Diretor Financeiro e de <i>Compliance</i>	29/3/2006	- <i>Compliance</i> - Risco - TI e Seg. Cibernética
José Pedro de Barros Pradez	42	engenheiro	089.417.767-24	Diretor Estratégico de Portfólio e Risco	30/09/2021	- Risco
8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer:						
Guilherme Figueiredo (26/Fev/1969)						
a. currículo, contendo as seguintes informações:						
i. cursos concluídos;						
Administração de Empresas (FAAP) / MBA em Finanças (William E. Simon Graduate School of Business Administration).						
ii. aprovação em exame de certificação profissional						
CFG, CGA e CGE em 08 de outubro de 2010.						
iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:						
<ul style="list-style-type: none"> • nome da empresa 						
<ul style="list-style-type: none"> • cargo e funções inerentes ao cargo 						

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

<ul style="list-style-type: none"> • atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
<ul style="list-style-type: none"> • datas de entrada e saída do cargo
<p>AMS Capital Ltda. - Diretor Responsável pela Administração de Carteiras responsável pelo <i>front-office</i> desde 06/2000.</p>
<p>8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e da Resolução CVM 21, fornecer:</p>
<p>Edson Maioli (15/Out/1965)</p>
<p>a. currículo, contendo as seguintes informações:</p>
<p>i. cursos concluídos;</p>
<p>Ciências Contábeis (UNICID-SP) / MBA em Controladoria (FGV)</p>
<p>ii. aprovação em exame de certificação profissional (opcional)</p>
<p>iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:</p>
<ul style="list-style-type: none"> • nome da empresa
<ul style="list-style-type: none"> • cargo e funções inerentes ao cargo
<ul style="list-style-type: none"> • atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
<ul style="list-style-type: none"> • datas de entrada e saída do cargo
<p>AMS Capital Ltda. - Diretor responsável pelo <i>back-office</i> e com função de supervisão das áreas de controladoria, administrativa e RH, tecnologia e <i>compliance</i> desde 08/2004.</p>
<p>8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:</p>
<p>José Pedro de Barros Pradez (13/Mai/1982)</p>
<p>a. currículo, contendo as seguintes informações:</p>

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

i.	cursos concluídos;
Engenharia Civil e Engenharia de Produção Civil (PUC-Rio), Pós-graduação em Gerenciamento de Projetos (PUC-Rio), Mestrado em Gestão Internacional (Grenoble Alps University, França), MBA em Finanças (Northwestern University, Kellogg School of Management, EUA)	
ii.	aprovação em exame de certificação profissional
CFA (<i>Chartered Financial Analyst</i>), CGA (Certificado de Gestores Anbima)	
iii.	principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
	<ul style="list-style-type: none"> • nome da empresa
	<ul style="list-style-type: none"> • cargo e funções inerentes ao cargo
	<ul style="list-style-type: none"> • atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
	<ul style="list-style-type: none"> • datas de entrada e saída do cargo
<p>AMS Capital Ltda. – Diretor de Estratégia de Portfólio e de Risco, responsável pela estratégia de alocação de ativos do portfólio e gestão de risco de mercado, de 09/2021 até o presente.</p> <p>AMS Capital Ltda. – Diretor de Câmbio, responsável pelo portfólio de investimentos quantitativos em moedas, de 11/2017 a 09/2021.</p>	
8.7. Em relação ao diretor responsável pela atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento, caso não seja a mesma pessoa indicada no item 8.4, fornecer:	
a.	currículo, contendo as seguintes informações:
i.	cursos concluídos;
ii.	aprovação em exame de certificação profissional
iii.	principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
	<ul style="list-style-type: none"> • nome da empresa

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

<ul style="list-style-type: none"> • cargo e funções inerentes ao cargo
<ul style="list-style-type: none"> • atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
<ul style="list-style-type: none"> • datas de entrada e saída do cargo
N/A - A AMS Capital não realiza distribuição de cotas de fundos de investimento.
8.8. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:
a. quantidade de profissionais
13 (treze)
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
A área de gestão de Fundos de Investimento da AMS Capital conta com 13 (treze) profissionais, entre eles, 1 (um) Diretor Responsável pela Administração de Carteiras, 1 (um) Diretor Presidente, 1 (um) Diretor responsável pela área econômica, 1 (um) Diretor de Estratégia, 1 (um) <i>Trader</i> , 3 (três) <i>Diretores-Portfolio Managers</i> , 2 (dois) <i>Diretores de Análise</i> e 3 (três) secretárias.
c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
Sistemas/Recursos utilizados na área de gestão de recursos: Bloomberg, Broadcast (AE), Valor Econômico, além de consultorias externas especializadas.
8.9. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:
a. quantidade de profissionais
14 (catorze)
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
A área administrativa conta com 3 (três) <i>Diretores</i> , 1 (um) gerente, 1 (um) coordenador, 8 (oito) analistas e 1 (uma) recepcionista.

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

<p>c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>
<p>Sistemas/Recursos utilizados na área de verificação e controle de normas legais e regulamentares: Compliasset.</p> <p>Sistema de Risco: PORT; Sistema de Contabilidade e Controladoria: AIM, Britech,</p> <p>Sistema Administrativo: StarSoft, CVM, Bacen e Anbima.</p>
<p>d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor</p>
<p>Por meio de: segregação das atividades, segregação física da área de gestão, políticas internas, código de ética, controle de acesso aos equipamentos e dados e acompanhamento/monitoramento das atividades pelo Comitê de Compliance.</p>
<p>8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de riscos, incluindo:</p>
<p>a. quantidade de profissionais</p>
<p>1 (um) Diretor Estratégico de Portfólio e Risco e 1 (um) Analista de Risco</p>
<p>b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes</p>
<p>Gerenciamento do risco de mercado, liquidez e exposição da carteira dos fundos de investimento.</p>
<p>c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos</p>
<p>São utilizados dois sistemas para controle de risco: PORT e um sistema desenvolvido internamente. Estes sistemas foram escolhidos por serem compatíveis com a natureza e a complexidade dos produtos, serviços, atividades, processos e sistemas da instituição, e estão capacitados a auxiliar na identificação, avaliação, monitoramento, controle e a mitigar os riscos associados às atividades da instituição.</p> <p>Os critérios utilizados na gestão de risco de liquidez são aqueles definidos estabelecidos nas regras emitidas pela ANBIMA. Tais critérios incluem (i) volume para aferição de liquidez dos ativos componentes da carteira dos fundos, (ii) o tratamento dos ativos utilizados como margem e garantias, (iii) controle de liquidez mínima da carteira, (iv) a periodicidade de monitoramento e (v) as métricas de gerenciamento da liquidez das carteiras, considerando a adequação à cotização e o perfil do</p>

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

passivo dos fundos.
São gerados os seguintes relatórios de risco de mercado diários que contém as seguintes informações: (1) Exposição: apresenta os limites adotados vs. a posição no final de cada dia. (2) Risco: apresenta o VaR consolidado; PV Volatilidade, VaR e VaR marginal.
d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor
O setor se reporta ao Comitê de Risco, órgão independente da gestão dos recursos.
8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas, incluindo:
a. quantidade de profissionais
N/A - A Gestora não exerce atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas.
b. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
N/A - A Gestora não exerce atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas.
c. a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade
N/A - A AMS Capital não exerce atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas.
8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:
a. quantidade de profissionais
b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes
c. programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas
d. infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

e. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos
A Empresa não realiza distribuição de cotas. A Distribuição dos fundos geridos pela AMS Capital é realizada pela Intrag DTVM Ltda.
8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
N/A - Não há outras informações relevantes no entendimento da AMS Capital.
9. Remuneração da empresa
-
9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 6.1, indicar as principais formas de remuneração que pratica
As principais formas de remuneração da AMS Capital são as taxas de administração e performance dos fundos de investimentos geridos e receita financeira do caixa da companhia.
9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total auferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente, durante o mesmo período, dos clientes em decorrência de:
-
a. taxas com bases fixas
98%
b. taxas de performance
2%
c. taxas de ingresso
-
d. taxas de saída

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

-
e. outras taxas
-
9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes
N/A – Não há outras informações relevantes no entendimento da AMS Capital.
10. Regras, procedimentos e controles internos
10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços
<p>A seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços para a AMS Capital Ltda. segue o estabelecido na Política de Contratação de Terceiros enviada à ANBIMA.</p> <p>A Política de Contratação de Terceiros da AMS Capital tem como objetivo definir o processo adotado pela AMS Capital para a supervisão e contratação de terceiros em nome dos fundos de investimento sob sua gestão.</p> <p>No âmbito da sua atividade de gestão de recursos e em nome das carteiras de valores mobiliários sob sua gestão, a AMS Capital identificou que os únicos prestadores de serviços objeto de tal Política seriam as corretoras de títulos e valores mobiliários, razão pela qual considera-se, para fins desta Política, como “Terceiro” tais prestadores de serviços.</p> <p>O processo de contratação e supervisão do Terceiro será efetuado visando o melhor interesse dos Fundos de Investimento, em especial nos casos em que haja ligação direta ou indireta entre o contratado e demais prestadores de serviços, ou investidores, na hipótese de potenciais conflitos de interesse.</p> <p>A seleção e contratação de Terceiros é um processo conduzido de forma conjunta pelo Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários, responsável pela seleção e indicação dos potenciais contratados, e do Diretor Financeiro e de Compliance, a cargo da condução do processo de <i>due diligence</i> prévio à contratação.</p> <p>Referido processo de <i>due diligence</i> visa obter informações qualitativas sobre o Terceiro que tenha interesse em iniciar vínculo jurídico com a AMS Capital e com os Fundos de Investimento, de modo a permitir um melhor julgamento durante a pré-seleção. A avaliação de tais informações é feita mediante a apresentação do questionário Anbima de <i>due diligence</i>, na forma e conteúdo aprovados pelo autorregulador.</p> <p>Em todos os casos, o Diretor Financeiro e de Compliance exige, no que couber, a documentação</p>

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

comprobatória das informações prestadas. Caso não seja possível aferir a veracidade da informação por meio de documentos comprobatórios, o Diretor Financeiro e de Compliance envidará melhores esforços para conferir tais informações.

O início das atividades do Terceiro deve ser vinculado à formalização da contratação, e nenhum tipo de operação ou pagamento poderá ser efetuado antes da celebração do contrato. As tratativas acerca do vínculo contratual são conduzidas pelo departamento jurídico interno da AMS Capital, em conjunto com o time de *back-office*.

O contrato escrito a ser celebrado com o Terceiro deverá prever, no mínimo, cláusulas que tratam:

- (i) das obrigações e deveres das partes envolvidas;
- (ii) da descrição das atividades que serão contratadas e exercidas por cada uma das partes;
- (iii) da obrigação de cumprir suas atividades em conformidade com as disposições previstas na regulamentação e autorregulação aplicáveis à atividade; e
- (iv) que os Terceiros contratados devem, no limite de suas atividades, deixar à disposição do contratante todos os documentos e informações exigidos pela regulação em vigor que sejam necessários para a elaboração de documentos e informes periódicos obrigatórios, salvo aqueles considerados confidenciais, nos termos da regulação em vigor.

Quando o contratado tiver acesso a informações sigilosas dos clientes e da AMS Capital, deverá ser assinado um contrato com cláusula de confidencialidade que estabeleça multa em caso de quebra de sigilo ou termo de confidencialidade (conforme documento arquivado na sede da AMS Capital), devendo o Terceiro responsabilizar-se por seu(s) funcionário(s) que tiver(em) acesso a informações confidenciais.

Na seleção dos Terceiros com as quais se relaciona, a AMS Capital busca cultivar transparência e franqueza em relação a potenciais conflitos de interesse, práticas de remuneração, benefícios indiretos, e outros fatores que possam interferir na escolha do prestador de serviço. Por essa razão, adota uma política de *best execution*, buscando os melhores interesses de seus clientes.

Após a contratação do Terceiro, a AMS Capital realiza o monitoramento contínuo das atividades exercidas pelos Terceiros contratados, até o término do prazo da contratação. O monitoramento é de responsabilidade do Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários, que conta com o auxílio do Diretor Financeiro e de Compliance e sua equipe.

A análise, para fins de monitoramento, deverá considerar o objeto contratado *vis a vis* a entrega realizada, com ênfase nas eventuais disparidades, na tempestividade, qualidade e quantidade esperadas. Ainda, o monitoramento deve ser capaz de identificar preventivamente atividades que possam resultar em riscos para a AMS Capital.

Tendo em vista a estrutura da AMS Capital, o processo para monitoramento contínuo do Terceiro contratado deve ser conciso e objetivo. Em linhas gerais, o Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários, contando, quando necessário, com o auxílio do Diretor Financeiro e de Compliance e de sua equipe, avalia o desempenho do Terceiro, a relação custo-

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

benefício e o grau de segurança empregado nas suas tarefas. Sem prejuízo, em casos específicos, adota controles mais rigorosos, conforme tratado na supervisão baseada em risco para Terceiros contratados.

A partir dos elementos supracitados, o Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários comunicará os *traders* caso decida descontinuar o serviço prestado por determinado Terceiro em decorrência do resultado insatisfatório de sua avaliação de desempenho.

10.2. Descrever como os custos de transação com valores mobiliários são monitorados e minimizados

O gestor possui sistema próprio para calcular e validar os custos incorridos nas transações realizadas. Para minimizar custos, o processo de seleção de corretoras prioriza além do custo, a idoneidade e as que tem qualidade na execução e liquidação operacional. O acompanhamento destas corretoras é feito através de *rankings* baseados nos critérios acima descritos, e as com melhor desempenho tem os negócios incrementados.

10.3. Descrever as regras para o tratamento de **soft dollar**, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens etc.

A Empresa tem por política transferir aos fundos geridos qualquer benefício ou vantagem que possa alcançar em decorrência de sua condição de gestora, salvo se for de outra maneira expressamente determinado pelo regulamento do fundo em questão. As operações de *soft dollar* somente ocorrerão se aprovadas pelo Comitê de *Compliance* e se em benefício dos fundos sob gestão, sendo que não haverá favorecimento da parte que oferecer esse tipo de serviço.

É vedado aos Colaboradores receber diretamente presentes de prestadores de serviços ou quaisquer terceiros que sejam oferecidos em decorrência das atividades da Empresa. No caso de recebimento de presentes, estes deverão ser entregues à diretoria que o sorteará entre todos os Colaboradores e diretores da Empresa.

Da mesma maneira, cursos viagens e afins somente poderão ser aceitos se aprovados pelo Comitê de *Compliance* e se a viagem for no interesse exclusivo da Empresa para melhor capacitação de seus profissionais.

10.4. Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados

A AMS Capital possui um plano de contingência e continuidade do negócio (“Plano de Contingência”) que permite que não haja interrupção das atividades, protegendo os processos críticos

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

contra efeitos de falhas ou desastres significativos, e assegurando sua retomada em tempo hábil, se for o caso. O Plano de Contingência é revisado e testado anualmente e está devidamente documentado. Além disso, a empresa possui uma rotina de *backup* e retenção das informações, armazenadas em serviços de *cloud* Microsoft Azure e/ou fitas magnéticas, da seguinte forma: (i) dois *backups* todos os dias úteis durante os últimos 30 dias (13h30 e 23h), (ii) último dia útil de cada mês, gerando um *backup* mensal, retido por 12 meses, e (iii) último dia útil de cada ano, gerando um *backup* anual, retido por 10 anos. A empresa utiliza os recursos de *cloud computing* Microsoft Azure e Microsoft 365 como sua principal infraestrutura de tecnologia. O ambiente hospedado na infraestrutura Microsoft garante a disponibilidade e acessos aos servidores de *e-mails*, arquivos e bancos de dados, independentemente da localização física de seus usuários ou do funcionamento das instalações próprias da empresa. Todos os acessos são realizados através da utilização de VPN, com obrigatoriedade do uso de complexidade de senhas e autenticação de dois fatores.

Durante o ano de 2023, os colaboradores exerceram suas funções de forma híbrida (presencial e remota) e todos os acessos aos sistemas e recursos de tecnologia foram considerados satisfatórios para todas as atividades desenvolvidas.

10.5. Descrever as políticas, práticas e controles internos para a gestão do risco de liquidez das carteiras de valores mobiliários

A AMS Capital faz um controle rígido para gestão do risco de liquidez, o qual está refletido na Política de Gestão de Risco, cópia da qual está arquivada na ANBIMA e disponível no *website* www.msafra.com.br.

10.6. Descrever as políticas, as práticas e os controles internos para o cumprimento das normas específicas de que trata o inciso I do art. 33, caso decida atuar na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor

A Empresa não realiza distribuição de cotas. A Distribuição dos fundos geridos pela AMS Capital é realizada pela INTRAG DTVM Ltda.

10.7. Endereço da página do administrador na rede mundial de computadores na qual podem ser encontrados os documentos exigidos pelo art. 16 da Resolução CVM 21

www.msafra.com.br

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

11. Contingências
11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, que sejam relevantes para os negócios da empresa, indicando:
Não há qualquer processo judicial, administrativo ou arbitral do qual a empresa seja parte, relevante aos negócios da empresa.
a. principais fatos
Não há.
b. valores, bens ou direitos envolvidos
Não há.
11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem sua reputação profissional, indicando:
Não há.
a. principais fatos
Não há.
b. valores, bens ou direitos envolvidos
Não há.
11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores
Não há.
11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que a empresa

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

tenha figurado no polo passivo, indicando:
Procedimento administrativo referente a um auto de infração da Receita Federal representando, em 2020, aproximadamente, 0,35% do faturamento anual da empresa, totalmente extinto em 2021 através do pagamento dos tributos envolvidos.
a. principais fatos
Em 2.Out.2008, um auto de infração foi lançado pela Receita Federal, o qual permaneceu em discussão em âmbito administrativo até 2021.
b. valores, bens ou direitos envolvidos
O valor do auto era de R\$ 583.933,55.
11.5. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo e tenha afetado seus negócios ou sua reputação profissional, indicando:
Não há.
a. principais fatos
Não há.
b. valores, bens ou direitos envolvidos
Não há.
12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, informando sobre:
a. acusações decorrentes de processos administrativos, bem como punições sofridas, nos últimos 5 (cinco) anos, em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, Banco Central do Brasil, Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC, incluindo que não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

b.	condenações por crime falimentar, prevaricação, suborno, concussão, peculato, “lavagem” de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores, contra a economia popular, a ordem econômica, as relações de consumo, a fé pública ou a propriedade pública, o sistema financeiro nacional, ou a pena criminal que vede, ainda que temporariamente, o acesso a cargos públicos, por decisão transitada em julgado, ressalvada a hipótese de reabilitação
c.	impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa
d.	inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito
e.	inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado
f.	títulos contra si levados a protesto
Não há. Vide declaração no Anexo 2. Informamos que a referida declaração foi firmada pelo diretores acima identificados e encontra-se disponível na sede da Empresa.	

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

ANEXO 1

DECLARAÇÃO

Os signatários abaixo, na qualidade, respectivamente, de diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários e de diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos e da Resolução CVM nº 21, de 25 de fevereiro de 2021 (“Resolução CVM nº 21”) da **AMS CAPITAL LTDA.**, declaram, para os devidos fins, que:

- (i) reviram o Formulário de Referência ao qual esta Declaração é anexa; e
- (ii) o conjunto de informações contido no referido Formulário de Referência é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela **AMS CAPITAL LTDA.**

Atenciosamente,

São Paulo, 15 de março de 2024.

GUILHERME FIGUEIREDO

Diretor responsável pela administração de
carteiras de valores mobiliários

EDSON MAIOLI

Diretor responsável pela implementação e
cumprimento de regras, procedimentos e
controles internos e da Resolução CVM nº 21

ANEXO E

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2023)

ANEXO 2

O signatário abaixo, na qualidade de diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários da **AMS CAPITAL LTDA.**, declara, para os devidos fins:

- (i) que não sofreu acusações decorrentes de processos administrativos, bem como não foi punido, nos últimos 5 (cinco) anos, em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, Banco Central do Brasil, Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC, bem como que não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos;
- (ii) que não foi condenado por crime falimentar, prevaricação, suborno, concussão, peculato, “lavagem” de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores, contra a economia popular, a ordem econômica, as relações de consumo, a fé pública ou a propriedade pública, o sistema financeiro nacional, ou a pena criminal que vede, ainda que temporariamente, o acesso a cargos públicos, por decisão transitada em julgado, ressalvada a hipótese de reabilitação;
- (iii) que não está impedido de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa;
- (iv) que não está incluído no cadastro de serviços de proteção ao crédito;
- (v) que não está incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado; e
- (vi) que não tem contra si títulos levados a protesto.

Atenciosamente,

São Paulo, 15 de março de 2024.

GUILHERME FIGUEIREDO

Diretor responsável pela administração
de carteiras de valores mobiliários