Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

Em atendimento à Instrução CVM Nº 558 de 26 de março de 2015.

(Informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2020)

Razão Social: **The Fortune 1 Investimentos e Gestão de Recursos**

CNPJ: 11.275.045/0001-95

Site: www.thefortune1.com

ADMINISTRADORES DE CARTEIRAS DE VALORES MOBILIÁRIOS

1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do Formulário

Nome: Sergio Paulino Ferreira

Cargo: Diretor e Gestor de carteiras

E-mail: sergiopaulino@thefortune1.com

Telefone: (11) 2391-9561

Responsável: Pela administração independente de carteiras de valores mobiliários dos fundos geridos pela Gestora

Nome: Anderson Pereira Feitosa

Cargo: Diretor de Risco e Compliance

E-mail: anderson@thefortune1.com

Telefone: (11) 2391-9561

Responsável pela gestão de risco e pelo cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos de que trata esta instrução.

2. Histórico da empresa:

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa.

A The Fortune 1 Investimentos e Gestão de Recursos (“TF1 investimentos”) é uma gestora de recursos independente, com sede em São Paulo-SP, devidamente credenciada pela CVM e aderente ao código de ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para Administração de Recursos de Terceiros.

Fundada em 2009, com o nome de QUEST INVESTIMENTOS ALTERNATIVOS e depois ÍCONE INVESTIMENTOS e ULTRA INVESTIMENTOS , a THE FORTUNE 1 INVESTIMENTOS E GESTÃO DE RECURSOS, inscrita no CNPJ Nº 11.275.045/0001-95, está autorizada desde 2010 a prestar serviços de Administrador de Carteira de Valores Mobiliários através do Ato Declaratório nº 10.934 da CVM, publicado no Diário Oficial da União – DOU, em 15 de março de 2010.

A TF1 Investimentos tem como objetivo gerar rentabilidade nos mercados em que atua, com foco estratégico em fundos multimercados e fundos estruturados, utilizando a experiência profissional de seus sócios e colaboradores.

A TF1 Investimentos preza pela governança e transparência, sempre adotando as melhores práticas no mercado. Com o objetivo de refletir a realidade atual do mercado.

2.2. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos:

a. os principais eventos societários, tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário

12ª I - Alteração do Contrato Social: em 10 de abril de 2015 O endereço da sede para Rua Bandeira Paulista, nº 530, 3º andar conjuntos 31 e 32, Itaim Bibi, São Paulo-SP CEP 04532-001.

II – 1 O sócio Roberto Luiz Tiezzi Gomez, acima qualificado, detentor de 1 (uma) quota, no valor nominal de R$ 1,00 (um real), totalmente integralizada, neste ato, retira-se da sociedade, cedendo e transferindo, a título não-onerosa, a totalidade da quota de sua titularidade, com tudo o que ela representa, livre e desembaraçada de qualquer ônus para o sócio ora admitido Gianluca Montebro Moraes, brasileiro, casado, administrador de empresas, portador da cédula de identidade RG 28.278.221-7 SSP/SP, inscrito no CPF/MF sob nº 273.996.818-30, residente domiciliado na rua Marcelino Champagnat, Nº 18, apto31, Jd. da Gloria, São Paulo-SP, CEP:04114-000.

2 – A sócia TF1 Holding S.A, acima qualificada, detentora de 179.996 (cento e setenta e nove mil, novecentos e noventa e seis) quotas sociais, no valor nominal de R$ 1,00 (um real) cada uma, totalmente integralizada, neste ato, cede e transfere a título não-oneroso 2 (duas) quotas sociais de sua titularidade, com tudo o que ela representa, livre e desembaraçada de qualquer ônus, gravame, dívida ou encargo, para os sócios ora admitidos:

(a) Vinicius Mendes Bailão Marujo, brasileiro, nascido em São Paulo-SP em 30/12/1989, solteiro, estudante, portador da cédula de identidade RG 37.231.993-2 SSP/SP, inscrito no CPF/MF sob nº383.748.768-75 residente e domiciliado na rua Bartolomeu Feio Nº 86, apto 101- B Brooklin, São Paulo-SP CEP 04580-000, 1(uma) quota social, no valor nominal de R$ 1,00 (um real) cada uma, totalmente integralizada.

(b) José Tadeu Silva Zacharias, brasileiro, nascido em Coqueiral-MG em 21/03/1994, solteiro, estudante, portador da cédula de identidade RG 34.654.104-9 SSP/SP, inscrito no CPF/MF sob nº343.488.448-36, residente e domiciliado na rua Comandante Ismael Guilherme nº 832, Jardim Lusitânia, São Paulo-SP, CEP: 04031-120, 1(uma) quota social, no valor nominal de RS 1,00 (um real) cada uma, totalmente integralizada.

3 – Os sócios remanescentes concordam com a presente cessão não-onerosa, renunciando ao seu direito de preferência sobre a quota ora cedida, declarando-se ciente de todos os seus termos.

13º alteração retirada e admissão de novo sócio em 13 de outubro de 2015.

O sócio Vinicius Mendes Bailão Marujo, acima qualificado, detentor de 1 (uma) quota no valor nominal de R$ 1,00 (um real), totalmente integralizada, neste ato retira-se da sociedade, cedendo e transferindo, a título não-oneroso, a totalidade da quota de sua titularidade, com tudo o que representa, livre e desembaraçada de qualquer ônus para o sócio Guilherme Martins do Eirado, Brasileiro, casado, profissional autônomo, portador da cédula de identidade RG 12.616.541-5 SSP/SP, inscrito no CPF/MF sob nº 128.181.598-57, residente e domiciliado nesta capital do estado de São Paulo, Rua José Maria Lisboa, 1.035 apto 22, Jardim Paulista, CEP: 01423-001. Os sócios remanescentes concordam com a presente cessão não-onerosa, renunciando ao seu direito de preferência sobre a quota ora cedida declarando-se ciente de todos os seus ternos.

14º alteração retirada de novo sócio redistribuição de quotas, e alteração de denominação social em 20 de junho de 2019. Alteração no quadro societário da empresa e distribuição de quotas, o quadro societário da empresa se compõe pelos sócios. Roberto Galinari Junior que passa a ter participação de 99,99% sob o capital da empresa José Anis de Souza Ribeiro que passa a ter participação de 0.06% sob o capital da empresa Jonatan Paolo Galoni que passa a ter participação de 0.06% sob o capital da empresa, Alteração na denominação empresarial a empresa altera sua denominação para ULTRA INVESTIMENTOS LTDA.

15º alteração contratual, mudança de endereço e nomeação de diretor de risco e Compliance em 09 de setembro de 2019.O Sr. Jose Anis de Souza Ribeiro é nomeado a diretor de Compliance e risco. O endereço da empresa é alterado para Rua Joaquim Floriano 413 13° andar conj. 132 Itaim Bibi São Paulo-SP CEP:045.34-011.

16° Alteração Quadro societário, redistribuição de quotas, alteração de endereço, nomeação de novos diretores em 13 de fevereiro de 2020.Retira-se da sociedade os Sócios Roberto Galinari Junior, José Anis de Souza Ribeiro, Jonatan Paolo Galoni .Admissão de Bruno Morales das Neves Sócio Diretor que passa a ter 90% sob o capital social da empresa. Sergio Paulino Ferreira Sócio e Diretor de Gestão de carteiras CGA passa a ter 10% sob o capital social da empresa. Patrícia Pereira Mendes Nomeada Diretora de Compliance e Risco Alteração de Endereço, o novo endereço passa a ser : Rua Apeninos 429 sala 615, Aclimação São Paulo-SP CEP:01533-000

17° Alteração Quadro societário, redistribuição de quotas, nomeação de novo diretor em 03 setembro de 2020.

Alteração do quadro Societário, Retira-se da sociedade o Sócio Bruno Morales das neves, que neste ato cede e transfere 90% do capital social para Sergio Paulino Ferreira que possuía 10% do capital da empresa, passa a ser possuidor de 100% das cotas que compõem o capital da empresa.

18° Alteração de endereço, alteração de nome e nomeação de novos diretores em 08 de dezembro de 2020. A empresa passa a ser chamada The Fortune 1 Investimentos e Gestão de Recursos Ltda. Endereço passa a ser Alameda Rio Negro, 1.030 – Cj 1502 – Alphaville-Barueri/SP CEP 06454-000. Nomeados: Patricia Lie Uehara como administradora e Anderson Feitosa Pereira como administrador e Diretor de Risco e Compliance.

b. escopo das atividades

A empresa executa atividades ligadas a gestão de recursos de terceiros.

c. recursos humanos e computacionais

Todos os diretores exercem posições estratégicas dentro do organograma da TF1 Investimentos. Tivemos uma completa alteração no quadro de colaboradores composto por:

1 -Diretor de Gestão de Carteira

1 - Diretora administrativa/Financeira

1 - Diretor de Risco e Compliance

1 - Analista de Compliance

1 – Analista de Risco

1 - Estrategista

1 - Gestor Sênior

1 - Analista de Investimentos

1 - Financial Advisory - Especialista Sênior em Private Equity

1 – Gerente de BackOffice

1 – Analista de BackOffice

As Áreas de TI e Jurídica são terceirizadas

Todo recurso tecnológico da TF1 Investimentos foi reformulado e adaptado em dezembro de 2020 para atender à demanda dos recursos sob gestão apontado em nosso Plano de Negócios.

d. Regras, Políticas, procedimentos e Controles Internos

Elaboração e atualização para fins de adaptação à Instrução CVM 558, dos seguintes documentos:

- Política de Gestão de Riscos;
- Política de Gerenciamento de Riscos de Liquidez;
- Política de Ética e Compliance;
- Procedimentos e Controles Internos;
- Política de Lavagem de Dinheiro;
- Plano de Continuidade de Negócios;
- Política de Investimentos Pessoais;
- Política Interna para Seleção e Contratação dos Prestadores de Serviços

3. Recursos humanos.

3.1. Descrever os recursos humanos da empresa fornecendo as seguintes informações:

a. número de sócios: 1(Um).

b. número de colaboradores: 10(Dez).

c. número de terceirizados: 2(Dois) Contabilidade= Excellence contabilidade e TI = G mais P digital.

d. lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e atuam exclusivamente como prepostos ou empregados da empresa:

O responsável pela gestão independente dos fundos geridos pela TF1 Investimentos Ltda:

Sergio Paulino Ferreira, brasileiro, economista, portador do RG nº 12.62.55-49 SSP/SP e CPF nº 049.147.198-00, residente e domiciliado em São Paulo/SP, autorizado pela CVM ao exercício de tal atividade, nos termos do Ato Declaratório CVM nº 11.620 de 31/03/2011.

4. Auditores

4.1 Em relação aos auditores independentes indicar, se houver:

a. Não há. Os fundos geridos pela TF1 Investimentos são auditados por empresas selecionadas e contratadas pelos Administradores.

b. data de contratação dos serviços: Não aplicável

c. descrição dos serviços contratados: Não aplicável

5. Resiliência financeira

5.1 Com base nas demonstrações financeiras, ateste

a. 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: Não

b. 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)? Sim

5.2 Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução

Não se aplica.

6. Escopo das atividades

6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo:

a. tipos e características dos serviços prestados (gestão discricionária, planejamento patrimonial, controladoria, tesouraria, etc.);

Os serviços prestados são exclusivamente de atividades relacionadas à gestão de fundos de investimento.

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.);

Com base em 31/12/2020, a TF1 Investimentos NÃO POSSUI fundos ou recursos sob gestão. Em seus Plano de Negócios está previsto a gestão de Fundos de Investimentos multimercados e Fundos estruturados.

c. se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor.

A TF1 Investimentos não atua na distribuição de cotas.

6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários:

a. os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades;

A TF1 Investimentos atua somente em atividades relacionadas a Gestão de Fundos

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.

A TF1 é uma empresa limitada unipessoal independente e não participa de grupos econômicos ou sociedades coligadas, controladoras ou controladas.

6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos e carteiras administrados 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);

Com base em 31/12/2020, a TF1 Investimentos NÃO POSSUIA recursos sob gestão.

b. número de cotistas, dividido por:

i. Pessoas naturais: Zero

ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais): Zero

iii. Instituições Financeiras: Zero

iv. Entidades abertas de previdência complementar: Zero

v. Entidades fechadas de previdência social: Zero

vi. Regimes próprios de previdência social: Zero

vii. Seguradoras: Zero

viii. Sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil: Zero

ix. Clubes de investimento: Zero

x. Fundos de investimento: Zero

xi. Investidores não residentes: Zero

xii. Outros (especificar): Zero

c. recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados);

Total Investidores Qualificados – com base em 31/12/2020: Zero

Total Investidores Não Qualificados – com base em 31/12/2020: Zero

Total Investidores Profissionais – com base em 31/12/2020: Zero

d. Recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior: Não há

e. Recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes:

Não há Recursos sob gestão com base em 31/12/2020.

f. Recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

i. Pessoas naturais: Zero

ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais): Zero

iii. Instituições Financeiras: Zero

iv. Entidades abertas de previdência complementar: Zero

v. Entidades fechadas de previdência social: Zero

vi. Regimes próprios de previdência social: Zero

vii. Seguradoras: Zero

viii. Sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil: Zero

ix. Clubes de investimento: Zero

x. Fundos de investimento: Zero

xi. Investidores não residentes: Zero

xii. Outros (especificar): Zero

6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:

a. Ações: Zero

b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras: Zero

c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras: Zero

d. Cotas de fundos de investimento em ações: Zero

e. Cotas de fundos de investimento em participações: Zero Cotas de fundos de investimento imobiliário: Zero

f. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios: Zero

g. Cotas de fundos de investimento em renda fixa: Zero

h. Cotas de outros fundos de investimento: Zero

i. Derivativos (valor de mercado): Zero

j. Outros valores mobiliários: Zero

k. Títulos Públicos: Zero

l. Outros ativos: Zero

6.5. Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária:

A gestora não exerce atividades de administração fiduciária, apenas de gestão de recursos.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes: Não há

7. Grupo econômico

7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa:

a. controladores diretos e indiretos:

Controle societário é exercido unicamente por Sergio Paulino Ferreira Sócio Diretor de Gestão CPF:049.147.198-00

b. Controladas e coligadas: Não há

c. Participações da empresa em sociedades do grupo: Não há

d. Participações de sociedades do grupo na empresa: Não Há

e. Sociedades sob controle comum: Não há

7.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma do grupo econômico em que se insere, desde que compatível com as informações apresentadas no item 7.1. : Não Há

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:

COMITÊ EXECUTIVO - O Comitê Executivo é responsável pela avaliação e definição dos objetivos e assuntos estratégicos da instituição, definição das estruturas e custos operacionais, análise de risco e aderência aos modelos utilizados pelas áreas, indicação de atuação a ser seguida no segmento do mercado em que atua, bem como assegurar o cumprimento das políticas e regras a serem seguidas pelas áreas de Gestão de Risco e Compliance.

COMITÊ DE RISCO e COMPLIANCE - Atua independente da área de Gestão, sendo subordinado diretamente ao Comitê Executivo e responsável pela gestão do risco dos fundos geridos pela TF1 Investimentos. Dentre suas atribuições, cabe destacar:

- Estabelecer nível aceitável de tolerância aos distintos tipos de risco;
- Estruturar o processo de gerenciamento de risco, de acordo com as políticas internas e normas dos órgãos reguladores, disponibilizando metodologias, modelos e ferramentas que proporcionem a identificação, avaliação, monitoramento, controle e mitigação dos riscos;
- Garantir o cumprimento das exigências dos órgãos reguladores e observação por todos os colaboradores envolvidos;
- Avaliar, monitorar, documentar e informar o Comitê Executivo sobre a exposição aos riscos de crédito, liquidez e operacional por meio do conhecimento dos riscos a que estão passíveis nas operações realizadas pela TF1 Investimentos;
- Divulgar as informações sobre o risco de crédito aos órgãos Reguladores e Supervisores, quando requerido, e ao Comitê de Gestão;
- Revisar, com periodicidade anual, a Política de Investimento e Metodologia de Gestão de Riscos;
- Realizar reuniões extraordinárias para a análise de posições e situações em que os limites pré-estabelecidos sejam atingidos.
- Monitorar o cumprimento do Manual de Compliance, das regras, políticas e procedimentos de controles internos;

COMITÊ DE GESTÃO Atua na gestão de um fundo multimercado na categoria Trading, no qual aplica os recursos em mercados de renda fixa e variável, tendo como principais atribuições:

- Discussão do cenário econômico interno e externo, avaliação técnica dos mercados e monitoramento da performance/risco do fundo;
- Definir estratégias de investimentos em conformidade com as regras e políticas de Gestão de Riscos;
- Definição da metodologia de alocação de recursos do ponto de vista de segurança ao risco de liquidez;
- Garantir o pleno conhecimento dos produtos, limites operacionais e seus riscos inerentes por todos os envolvidos da área.
- Monitoramento contínuo tendo como base o comprometimento e disciplina na gestão, no gerenciamento de risco e na reavaliação dos ativos da carteira.
- Acompanhar a performance da carteira e analisar como comparativo os pares da indústria de fundos;

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

COMITÊ EXECUTIVO: O Comitê Executivo é composto por 5 pessoas: Sócio-diretor, Diretora administrativa, Diretor de Risco e Compliance, Gestor Sênior e pelo Financial Advisory. Reúne-se semestralmente ou a qualquer tempo sempre que acharem necessários ou alguma pauta importante se apresente. Decisões são registradas em ata.

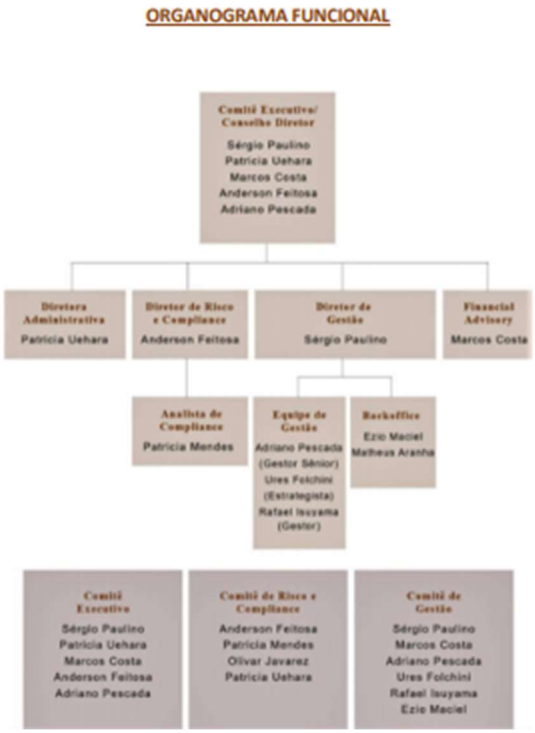
COMITÊ DE RISCO: O Comitê é composto pelo Diretor de Risco e Compliance e seus analistas mais a Diretora Administrativa. Realizam reuniões semanais e encontros extraordinários sempre que os membros acharem necessário. Suas decisões são registradas em ata.

COMITÊ DE GESTÃO Participam deste Comitê o Diretor de Gestão, o Gestor sênior, o Estrategista, o Gestor júnior, o Financial Advisory e o gerente de BackOffice, Reúnem-se diariamente. A pedido, suas decisões são registradas em ata.

c. em relação aos membros da diretoria, suas atribuições e poderes individuais.

Todos os diretores têm poderes decisórios, compartilhando junto aos membros dos seus respectivos comitês.

8.2. Organograma da estrutura administrativa da empresa:



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:

a. Nome	Sergio Paulino Ferreira
b. Idade	54 anos
c. Profissão	Economista
d. CPF ou número do Passaporte	049.147.198-00
e. Cargo ocupado	Sócio Executivo e Diretor de Gestão
f. Data da Posse	Data da Posse 13/02/2020
g. Prazo do mandato	Não há
h. Outros cargos ou funções exercidas na empresa	Todos os executivos listados no item 8.3 exercem somente os cargos definidos conforme descrito no mesmo

a. Nome	Anderson Feitosa Pereira
b. Idade	39 anos
c. Profissão	Contador
d. CPF ou número do Passaporte	218.881.158-58
e. Cargo ocupado	Diretor de Risco e Compliance
f. Data da Posse	Data da Posse 08/12/2020
g. Prazo do mandato	não há
h. Outros cargos ou funções exercidas na empresa	Todos os executivos listados no item 8.3 exercem somente os cargos definidos conforme descrito no mesmo

8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer currículo:

Sergio Paulino Ferreira

Economista, formado pela PUC-SP, experiência de mais de 30 anos no mercado financeiro tendo atuado em tesourarias de banco e assets, com destaque para empresas de capital estrangeiro como Bankboston (9 anos), ABN Amro (6 anos), Caixa geral de Depósitos (4anos) e CA-Indosuez (5 anos). Gestor autorizado pela CVM desde 2011 através do Ato Declaratório 11.620 de 31 de março de 2011.

8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos desta Instrução, fornecer currículo:

Anderson Feitosa Pereira

Contador e Mestre em Controladoria e Contabilidade na área de Mercado Financeiro, de Crédito e de Capitais no departamento de Contabilidade e Atuária da Universidade de São Paulo- FEA USP. Sênior de auditoria externa da PricewaterhouseCoopers, com experiência de auditoria de fundos de investimento, administradoras de cartões de crédito e indústrias de grande porte. Sócio de Controladoria na Mauá Sekular, atuando na área de Controladoria. Fundador da Fepin Contabilidade e Consultoria, responsável pela captação de clientes do segmento financeiro, mais notadamente gestoras de recursos com fundos locais e offshore, orientando clientes com relação a questões de planejamento tributário, contabilidade e compliance, por vezes atuando em conjunto com escritórios como Cepeda Advogados, Landi, Rodrigues, Nakano e Giovannetti Advogados – LRNG. Programa de intercâmbio cultural e cursos de língua inglesa no Golders Green College London (360 horas/aula) – abril a novembro/2008 TOEIC: Advanced – 785 pontos no teste realizado em junho/2009.

8.6 Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos. Também Gestor de Risco:

Trata-se do mesmo diretor indicado no item 8.5

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 TF1 Investimentos não atua na distribuição de cotas.

8.8. Informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:

a. Quantidade de profissionais:

Área de gestão de recursos da TF1 Investimentos conta com 06(Seis) profissionais qualificados.

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A Mesa de Operações está sob a responsabilidade do Diretor de Administração de Carteiras de Valores Mobiliários.

A equipe de gestão de recursos tem como embasamento técnico a fundamentação macroeconômica, faz a leitura top-down dos mercados desenvolvidos e emergentes. O posicionamento estratégico consiste em uma visão multidisciplinar dos instrumentos de mercado com a característica de trading nas operações, fazendo o posicionamento em momentos estratégicos no mercado.

A equipe de gestão de recursos faz o monitoramento com comprometimento e disciplina na gestão, no gerenciamento de risco e na reavaliação dos ativos dos fundos e das empresas investidas nos estruturados, com as seguintes periodicidades: Diariamente – para avaliação das notícias, discussão das posições estratégicas e/ou táticas, análise técnica dos mercados e acompanhamento do gerenciamento de risco da carteira;

Semanalmente – para discussão do cenário macroeconômico e avaliação técnica dos mercados e seus ativos, e da performance do fundo;

Mensalmente – para Discussão do cenário macroeconômico, avaliação da performance do fundo realizada, análise da concorrência, reavaliações das oportunidades de investimentos

c. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

Sistema Com dinheiro e Bloomberg são os sistemas de informações disponíveis para auxiliar a área de gestão da TF1 Investimentos.

8.9 Fornecer informações sobre a estrutura mantida para 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 :3(Três)

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:

A Diretoria de Risco e Compliance é responsável por divulgar, monitorar e analisar a aderência da gestora aos Manuais e diretrizes de Controles Internos e o atendimento ao cumprimento das normas fiduciárias, regulatórias e autorregulatórias.

c. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos.

Com a finalidade de assegurar o permanente atendimento às regras internas e normas legais para o bom cumprimento das atividades da TF1 Investimentos, cabe a área de Risco e Compliance as seguintes rotinas e procedimentos:

- Realizar o acompanhamento da política de negociação dos sócios, colaboradores, estagiários e prestadores de serviços; manter atualizado os manuais e políticas da instituição;
- Realizar testes de conformidade entre rotinas operacionais e as normas estabelecidas;
- Analisar e validar o processo de credenciamento de novos parceiros;
- Promover a implementação de melhorias nos processos executados;
- Revisar materiais publicitários da Instituição;
- Coordenar a realização dos comitês estabelecidos no manual;
- Assegurar o devido preenchimento dos anexos ao manual de Compliance.

Para os serviços de terceiros, o método de seleção utilizado é buscar no mercado pelo menos três empresas que se enquadrem nos requisitos desejados, a partir daí serão buscadas informações para que sejam avaliados os equipamentos utilizados pelo prestador assim como a atividade desenvolvida. Outro ponto importante e caso seja possível é ouvirmos os colaboradores dos prestadores de serviços, conversarmos com empresas que já utilizaram os seus serviços, conhecermos os planejamentos a curto e longo prazo e, principalmente, a filosofia do prestador do serviço. Após todos estes levantamentos, o resultado juntamente com os custos operacionais e o cálculo do custo-benefício do projeto é levado para análise da diretoria responsável para aprovação.

d. A forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor

Com relação às rotinas e procedimentos, a Área de Compliance da TF1 Investimentos verifica de forma autônoma e independente se os procedimentos adotados estão em conformidade com a legislação vigente, bem como com as normas e padrões estabelecidos internamente. Seu Diretor estatutário, que participa também do Conselho Diretor, tem total autonomia para tomar decisões e executar atos que garantam a aderência a todas as diretrizes estabelecidas e assumidas pela empresa sem a necessidade de submeter a aprovação por qualquer instancia.

Com relação aos serviços de terceiros, a partir do fechamento do Contrato de Prestação de Serviço a TF1 Investimentos faz um monitoramento do serviço prestado para que se constate a qualidade e eficácia na prestação do serviço. São avaliadas as prováveis inocorrências que possam surgir, e como é dado o devido tratamento de resposta e correção, também são avaliados os suportes e atendimento respeitando o contrato.

8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de riscos, incluindo:

a. quantidade de profissionais: 2(Dois)

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:

A TF1 Investimentos possui políticas, procedimentos, limites e sistemas de informações projetados para prover:

Estrutura organizacional com áreas de responsabilidades definidas, efetiva segregação de funções, linhas de comunicação e reporte claros, com ênfase particular na independência das funções de gestão de riscos;

Conhecimento por parte dos administradores dos riscos e limites dentro dos quais é permitido que os fundos operem;

Informações adequadas, tempestivamente disponibilizadas de forma que os gestores e o quadro funcional tenham um cenário completo e preciso dos riscos que estão administrando e seu impacto potencial.

A estrutura de Gerenciamento de Riscos da TF1 Investimentos é definida através de políticas internas, limites, controles e procedimentos específicos da instituição, todos definidos pelo Comitê de Risco.

A equipe conta com profissionais capacitados, possui autonomia operacional e por determinação do Comitê Executivo possui soberania decisória.

c. Os sistemas de informação as rotinas e os procedimentos envolvidos:

A TF1 Investimentos possui sistemas adequados para a mensuração e controle das exposições ao risco, de forma a garantir que o nível de exposição ao risco esteja de acordo com o mandato de cada fundo e da instituição como um todo.

Através de sistemas estruturados para utilizar diversos modelos e medições de risco, além da análise quantitativa de risco de mercado pelo VaR e de cenários de Stress, diariamente a equipe analisa os dados de exposição, como os níveis de concentração, exposição a diferentes mercados, aderência dos portfólios aos seus benchmarks entre outros buscando antecipar possíveis impactos no processo de investimento.

A Equipe de Risco busca monitorar todos os limites com a frequência mínima diária, não se limitando a apenas esta verificação obrigatória, mas com a máxima frequência que achar necessário, gerando relatórios que demonstram uma visão detalhada das posições de carteiras e sua exposição ao risco com relação ao mercado. c. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos. Para o acompanhamento da carteira e do controle de riscos, a TF1 utiliza o sistema da Administradora de seus fundos, juntamente com o serviço terceirizado da empresa COM DINHEIRO, além do monitoramento constante da legislação através dos portais da BOVESPA, ANBIMA, CVM e BACEN.

d. a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor.

O Diretor de Risco e Compliance com poderes para agir em todas as áreas da organização, tem acesso a todas as informações das operações e total autonomia para tomada de decisões no âmbito de suas responsabilidades. Além disso, a área de Compliance e Gestão de Risco da TF1 Investimentos atuam de forma independente da diretoria de gestão, a fim de garantir a plena execução e obediência de seus manuais de procedimentos.

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

Estas atividades são desenvolvidas pela Administradora de nossos fundos.

b. O sistema de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

Estas atividades são desenvolvidas pelos Administradores de nossos fundos.

c. Indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade

Estas atividades são desenvolvidas pelos Administradores de nossos fundos.

8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:

a. Quantidade de profissionais: A TF1 Investimentos não atua na distribuição de cotas

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes :Não se aplica.

c. programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas

Não se aplica.

d. Infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição :Não se aplica.

e. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos: Não se aplica.

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes: Não há

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.

A única forma de remuneração da gestora é relacionada a atividades de gestão de Recursos de Terceiros como taxa de gestão, performance ou consultoria na estruturação de Fundos.

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: 5,10%

b .Taxas de performance: 94,90%

c. Taxas de Ingresso: 0

d. Taxas de saída: 0

e. Outras taxas: 0

9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes: Não há

10. Regras, procedimentos e controles internos

10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços.

A TF1 Investimentos somente contrata prestadores de serviços devidamente autorizados pela legislação e regulamentação a exercer suas atividades e com experiência comprovada em suas áreas de atuação.

Além disso, a TF1 é aderente a determinados Códigos de autorregulação que obrigam que parte de seus prestadores de serviços também sigam determinados padrões em suas atividades. Por fim, todos os contratos da TF1 com seus prestadores de serviços contêm cláusula relacionada ao cumprimento das leis anticorrupção existente no Brasil. Além disso como as atividades da TF1 são conduzidas diretamente por seus sócios administradores, a seleção, contratação e supervisão é realizada diretamente por tais profissionais.

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

Os custos de transação para renda variável são as despesas operacionais e de corretagem cobradas pelas corretoras com as quais operamos, mediante tabelas de repasse previamente acordadas. O monitoramento destes custos é feito diariamente através da nota de corretagem. Para Renda Fixa, o critério é cotar sempre que possível em 3 casas idôneas e fechar as operações no melhor preço.

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

O soft dollar não é permitido, exceto na reversão de sistemas que auxiliam na tomada de decisão da gestão.

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

A Política de Gestão de Continuidade de Negócios da TF1 Investimentos Ltda tem como diretrizes básicas assegurar a existência de Planos de Continuidade de Negócios (PCN) que garantam, à Gestora, a perpetuidade de suas atividades e processos de negócios considerados críticos, inclusive quando terceirizados e garantir que os produtos, serviços e atividades sejam avaliados quanto aos aspectos intrínsecos à sua continuidade.

A Gestora tem previamente definido seus planos de contingência, continuidade e recuperação de desastres.

a) Fornecimento de Energia, contamos com NO-BREAKS e geradores em 3(três) níveis:

- A alimentação da rede elétrica básica das mesas de trabalho e salas de reunião;
- Alimentação da telefonia;
- Alimentação do CPD.

b) Internet e E-mails:

- Utilizamos 2 (dois) links de Internet;
- Firewall e antivírus que são constantemente atualizados.

c) Telefonia:

- Back-up de telefonia VOIP;
- Linha disponível para cada um dos funcionários, utilizando tecnologia VOIP.

d) Back-up de Informações:

- Armazenagem principal dos micros dos usuários;
- Armazenagem de dados dos servidores;
- E-mails dos funcionários;
- Back-up em “NUVEM”.

e) Acesso ao ambiente:

- Em caso de impedimento de acesso ao ambiente da gestora, todos os funcionários têm condições de acessar remotamente os sistemas necessários ao desempenho de sua atividade a partir de computadores pessoais e acesso à internet garantindo que seja dada continuidade a todas as atividades da gestora. Esse acesso é definido e monitorado pela Área de Risco e Compliance e as ferramentas são disponibilizadas pela gestora.

Cumpre mencionar que a Administradora também mantém o controle das posições o que caracteriza mais uma instância de segurança para a gestora.

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

São assumidas duas formas distintas, porém intimamente relacionadas: risco de liquidez de ativos ou de mercado (tempo de zeragem de posição) e risco de liquidez de funding ou de fluxo de caixa (disponibilidade de caixa para obrigações com o passivo da carteira).

Abrangência: As diretrizes abrangem todos os fundos, com comprometimento à adequação às especificidades de cada fundo.

Comprometimento: A instituição está comprometida em garantir que todos os limites e políticas sejam conhecidos, compreendidos e respeitados.

Equidade: O critério preponderante do processo de escolha de metodologia, fontes de dados e/ou qualquer decisão é, sempre, o tratamento equitativo dos cotistas.

Frequência: Os controles são realizados nas modalidades: On Line, prévios e pós-execução. Os controles pós-execução têm, como frequência mínima, a periodicidade de divulgação das cotas.

Gerenciamento de Riscos: A instituição possui um processo formalizado de gerenciamento de Riscos. Para tal, a metodologia encontra-se determinada em manual e todos os controles são registrados em modelos padrão e arquivados.

Segregação de Funções: A área responsável pelo gerenciamento de risco possui autonomia e poder decisório, respondendo diretamente ao Comitê Executivo. Seus membros são independentes à gestão, realizando atividades segregadas.

Objetividade: As informações e/ou fontes de dados utilizados nos processos de risco são, preferencialmente, obtidas de fontes externas independentes.

Consistência: Em todos os fundos sob gestão da TF1 Investimentos, serão executados os controles. As metodologias de precificação e risco são confiáveis e passíveis de verificação.

Controles Internos: No início do dia, as carteiras enviadas pelo Administrador dos fundos são conferidas. Nesse processo as informações constantes nas carteiras são validadas. O processo consiste em analisar a carteira do dia anterior (D-1) e se somar a ela as movimentações efetuadas, atualizações de preços e eventos.

São ainda testados os valores dos ativos, a ocorrência de eventos/provisões, a incidência de despesas e custos. Com isso conseguimos eliminar quaisquer possibilidades de utilização de dados errados pelos gestores e garantir o controle para gestão do risco de liquidez das carteiras dos fundos geridos pela TF1 Investimentos.

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. 30, na atuação como distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor:

A TF1 Investimentos não atua na distribuição de cotas

10.7. Endereço da página do administrador na rede mundial de computadores na qual podem ser encontrados os documentos exigidos pelo art. 14 da Instrução CVM 558:

http://www.thefortune1.com

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:

a. principais fatos: Não se aplica

b. valores, bens e/ou direitos envolvidos: Não se aplica

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:

a. principais fatos: Não se aplica

b. valores, bens e/ou direitos envolvidos: Não se aplica

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 tenha figurado no polo passivo, indicando:

Atualmente, não temos nenhum sócio ou funcionário que tenha processo com CVM, BC, MP e/ou Conselho de Recursos Arbitrais do Sistema Financeiro.

a. principais fatos: Não se aplica

b. valores, bens e/ou direitos envolvidos: Não se aplica

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:

Atualmente, não temos nenhum sócio ou funcionário que tenha processo com CVM, BC, MP e/ou Conselho de Recursos Arbitrais do Sistema Financeiro.

a. principais fatos: Não se aplica

b. valores, bens e/ou direitos envolvidos: Não se aplica

12. Declaração do diretor responsável pela administração

Próxima página

THE FORTUNE 1

DECLARAÇÃO

Em atendimento ao item 12 do Anexo 15-II do formulário de referência - Pessoa Jurídica, eu Sergio Paulino Ferreira, portador do CPF 049.147.198-00, diretor estatutário da TF1 INVESTIMENTOS E GESTÃO DE RECURSOS LTDA, devidamente habilitado pela CVM para atuar no exercício profissional de administração de carteiras de valores mobiliários pelo Ato Declaratório nº 11.620 de 31 de março de 2011, Certificações CGA e CPA20 ANBIMA declaro que:

a. não estou inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pela CVM, pelo Banco Central do Brasil, pela Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou pela Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC;

b. não fui 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;

c. não estou impedido de administrar meus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa;

d. não estou incluído no cadastro de serviços de proteção ao crédito;

e. não estou incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado;

f. que não tenho contra mim títulos levados a protesto;

g. que, nos últimos 5 (cinco) anos, não sofri punição em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, do Banco Central do Brasil, da Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC;

h. que, nos últimos 5 (cinco) anos, não fui acusado em processos administrativos pela CVM, pelo Banco Central do Brasil, pela Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou pela Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC.

SERGIO PAULINO FERREIRA