



**Daemon Investimentos Ltda.**

**FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA**

**Fevereiro-2024**

# Daemon Investimentos Ltda. (“Daemon Investimentos” ou “Daemon”)

## FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA – PESSOA JURÍDICA

Com base no Anexo E à Resolução CVM 21, de 25.02.2021

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

### Sumário

FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA – PESSOA JURÍDICA.....	2
1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário.....	3
2. Histórico da empresa .....	3
3. Recursos humanos .....	4
4. Auditores.....	5
5. Resiliência Financeira.....	5
6. Escopo das atividades .....	5
7. Grupo econômico.....	10
8. Estrutura operacional e administrativa .....	11
9. Remuneração da empresa .....	21
10. Regras, procedimentos e controles internos.....	22
11. Contingências.....	25
12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, informando sobre: .....	26

## 1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário.

### 1.1. Declarações dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários e pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos desta Instrução, atestando que: (a) reviram o formulário de referência e (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.

Eu, Gabriel Kendjy Koike, inscrito no CPF/ME sob o nº 008.777.089-08, com endereço comercial na cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, na Avenida Brigadeiro Faria Lima, nº 3.015, 15º andar, Jardim Paulistano, CEP 01452-000, declaro que (i) revi o presente formulário de referência, que abaixo subscrevo, e (ii) atesto que o conjunto de informações contido neste formulário de referência é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela Daemon Investimentos, na qual exerço cargo de diretor responsável pela administração de carteira de valores mobiliários ("Diretor de Gestão").

Eu, Vitor Rhein Schirato, inscrito no CPF/ME sob nº 220.168.188-08, com endereço comercial na cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, na Avenida Brigadeiro Faria Lima, nº 3.015, 15º andar, Jardim Paulistano, CEP 01452-000, declaro que (i) revi o presente formulário de referência, que abaixo subscrevo, e (ii) atesto que o conjunto de informações contido neste formulário de referência é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela Daemon Investimentos, na qual exerço cargo de diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos da Resolução CVM nº 21, de 25 de fevereiro de 2021 ("RCVM 21/21") ("Diretor de Compliance").

## 2. Histórico da empresa

### 2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa;

A Daemon Investimentos foi fundada em 2009, como uma empresa de prestação de serviços de consultoria financeira, assessoria na estruturação de operações financeiras e investimento em participações societárias. Em 2015, a Daemon Investimentos obteve autorização da CVM para prestar serviços de administração de carteira de valores mobiliários, passando a desenvolver referidas atividades no ano de 2016, com a constituição de seu primeiro fundo sob gestão, o Daemon CTÉSIOS Fundo de Investimento Multimercado Crédito Privado.

Em 2018, a Daemon Investimentos formou um time dedicado à gestão de investimentos quantitativos e sistemáticos, e, em 2020, lançou o primeiro fundo aberto para investidores, o Daemon Nous Global FIM, e, em 2023, o Daemon Ethos, primeiro fundo de previdência.

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

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

Não houve mudanças relevantes pelas quais a Daemon Investimentos tenha passado nos últimos 5 (cinco) anos.

**b. escopo das atividades;**

A Daemon Investimentos atua em gestão de fundos de investimento quantitativo.

**c. recursos humanos e computacionais; e**

A Daemon Investimentos conta com 41 (quarenta e um) colaboradores (incluindo sócios, empregados e estagiários), divididos em diferentes departamentos e funções.

A Daemon conta com todos os elementos que suportam o gerenciamento e a usabilidade de dados e informações. Estes incluem o hardware físico e instalações como servidores *on premises* e *cloud*, armazenamento e recuperação de dados, sistemas de rede e segurança com *firewall* e antivírus, links de dados redundantes, proteção contra DDoS, sistema de vídeo conferência integrado as principais plataformas do mercado, interfaces legadas e softwares para suportar os objetivos de negócio da empresa. A estrutura também inclui contratação, treinamento, políticas, testes, processos, atualizações e reparos.

**d. regras, políticas, procedimentos e controles internos**

Não houve mudanças relevantes pelas quais a Daemon Investimentos tenha passado nos últimos 5 (cinco) anos.

**3. Recursos humanos**

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

**a. número de sócios;**

A Daemon Investimentos conta com 11 (onze) sócios, conforme dispõe a 26ª alteração do seu contrato social.

**b. número de empregados;**

A Daemon Investimentos conta com 32 (trinta e dois) colaboradores e 1 (um) estagiário.

**c. número de terceirizados; e**

A Daemon Investimentos não possui colaboradores terceirizados.

**d. 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.**

Sr. Gabriel Kendjy Koike, inscrito no CPF/ME sob o nº 008.777.089-08. Ato declaratório nº 20640 de 06 de março de 2023.

#### 4. Auditores

##### 4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:

**a. nome empresarial;**

A Daemon Investimentos não conta com auditores independentes.

**b. data de contratação dos serviços; e**

A Daemon Investimentos não conta com auditores independentes.

**c. descrição dos serviços contratados.**

A Daemon Investimentos não conta com auditores independentes.

#### 5. Resiliência Financeira

##### 5.1. Com base nas demonstrações financeira, ateste:

**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; e**

Sim.

**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).**

Sim.

**c. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Resolução**  
Não aplicável à Daemon Investimentos.

#### 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.);**

A Daemon Investimentos desenvolve atividades de administração de carteira de valores mobiliários, as quais são reguladas pela CVM e estão sujeitas as regras de autorregulação da associação brasileira das entidades dos mercados financeiro e de capitais - ANBIMA.

**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.);**

Especializada na gestão de fundos quantitativos, a divisão de gestão de investimentos busca gerar retornos consistentes enquanto preserva o capital investido. Possuímos atualmente mais de R\$180 milhões em ativos sob gestão através de veículos de investimento no Brasil.

**c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão; e**

A Daemon Investimentos realiza a gestão da carteira de um fundo de investimento multimercado regulado pela ICVM 555/14, que foi substituída pela Resolução CVM nº 175, que entrou em vigor em 1º de outubro de 2023 com efeitos para o ano de 2024.

O fundo de investimento, por sua vez, investe em uma ampla variedade de ativos e valores mobiliários, com destaque para os investimentos em derivativos, ações e títulos públicos federais.

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

Não.

**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

**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.**

N/A

**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);**

456(quatrocentos e cinquenta e seis) investidores de fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e 0 (zero) investidores de fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados.

**b. número de investidores, divididos por:**

**i. pessoas naturais**

441 (quatrocentos e quarenta e um) investidores de fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e 0 (zero) investidores de fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados.

**ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)**

0 (zero).

**iii. instituições financeiras**

0 (zero).

**iv. entidades abertas de previdência complementar**

0 (zero).

**v. entidades fechadas de previdência complementar**

0 (zero).

**vi. regimes próprios de previdência social**

0 (zero).

**vii. seguradoras**

1 (uma).

**viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil**

0 (zero).

**ix. clubes de investimento**

0 (zero).

**x. fundos de investimento**

13 (treze) fundos de investimento

**xi. investidores não residentes**

1 (um) investidor de fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e 0 (zero) investidores de fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados.

**xii. outros (especificar)**

0 (zero).

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

R\$ 182.666.306,24 (cento e oitenta e dois milhões e seiscentos e sessenta e seis mil reais e trezentos e seis reais e vinte e quatro centavos), destinados a investidores qualificados.

R\$ 0 (zero), destinados a investidores não qualificados.

**d. recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior;**

R\$ 66.027.144,36 (sessenta e seis milhões e vinte e sete mil e cento e quarenta e quatro reais e trinta e seis centavos)

**e. recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes)**

<b>Cliente</b>	<b>Valor dos recursos financeiros sob administração</b>
Cliente 1	54,591,319.19
Cliente 2	27,503,760.22
Cliente 3	18,777,472.32
Cliente 4	16,675,017.44
Cliente 5	6,077,555.95
Cliente 6	5,765,644.00
Cliente 7	5,030,945.49
Cliente 8	3,006,657.36
Cliente 9	2,650,268.66
Cliente 10	2,327,252.67

**f. recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:**

**i. pessoas naturais**

R\$ 45,087,933.27 (quarenta e cinco milhões e oitenta e sete mil e novecentos e trinta e três reais e vinte e sete centavos)

**ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais)**

0 (zero).

**iii. instituições financeiras**

0 (zero).

**iv. entidades abertas de previdência complementar**

0 (zero).

**v. entidades fechadas de previdência complementar**

0 (zero).



**vi. regimes próprios de previdência social**

0 (zero).

**vii. seguradoras**

R\$ 27,503,760.22 (vinte e sete milhões e quinhentos e três mil e setecentos e sessenta reais e vinte e dois centavos).

**viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil**

0 (zero).

**ix. clubes de investimento**

0 (zero).

**x. fundos de investimento**

R\$ 55.483.294,08 (cinquenta e cinco milhões e quatrocentos e oitenta e três mil e duzentos e noventa e quatro reais e oito centavos).

**xi. investidores não residentes**

R\$ 54,591,319.19 (cinquenta e quatro milhões e quinhentos e noventa e mil reais e trezentos e dezenove reais e dezenove centavos).

**xii. outros (especificar)**

0 (zero).

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

**a. ações**

R\$ 25.700.880,77 (vinte e cinco milhões e setecentos mil e oitocentos e oitenta reais e setenta e sete centavos).

**b. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras**

0 (zero).

**c. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras**

0 (zero).

**d. cotas de fundos de investimento em ações**

0 (zero).

**e. cotas de fundos de investimento em participações**

0 (zero).

**f. cotas de fundos de investimento imobiliário**

0 (zero).

**g. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios**

0 (zero).

**h. cotas de fundos de investimento em renda fixa**

0 (zero).

**i. cotas de outros fundos de investimento**

R\$ 54.500.044,74 (cinquenta e quatro milhões e quinhentos mil e quarenta e quatro reais e setenta e quatro reais).

**j. derivativos (valor de mercado)**

R\$ 55.020.072,90 (cinquenta e cinco milhões e vinte mil e setenta e dois reais e noventa centavos).

**k. outros valores mobiliários**

0 (zero).

**l. títulos públicos**

R\$ 99.298.701,78 (noventa e nove milhões e duzentos e noventa e oito mil e setecentos e um reais e setenta e oito centavos).

**m. outros ativos**

0 (zero).

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

Não aplicável.

**6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes.**

Não aplicável.

**7. Grupo econômico**

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

#### a. controladores diretos e indiretos

Sr. Sérgio Rhein Schirato e Sr. Edson Corrêa Queiroz, inscrito no CPF/ME sob o nº 029.312.018-80.

#### b. controladas e coligadas

N/A

#### c. participações de sociedades do grupo na empresa

Não há nenhuma pessoa jurídica no quadro societário da Daemon Investimentos.

#### d. sociedades sob controle comum

No Brasil, não há sociedades sob controle comum da Daemon Investimentos.

### 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.

Não é necessário o fornecimento.

## 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 Daemon Investimentos possui 4 (quatro) comitês com 7 (sete) diretorias, que desempenham, respectivamente, as seguintes funções:

- **Órgãos e comitê relacionados às atividades de gestão de carteira de valores mobiliários:**

(i) **Comitê de Riscos** - é responsável pela apreciação dos relatórios de exposição de risco e pela adequação dos fundos de investimento sob gestão da Daemon Investimentos a seus limites de risco e à política de Gestão de Risco e avaliação de corretoras (análise da prestação de serviços e custos). Neste Comitê também serão discutidas, caso necessário, as ações corretivas para reenquadrar as carteiras com os limites previstos na Política de Gestão de Risco;

(ii) **Diretoria de Gestão de Riscos** - responsável pela implementação, revisão, atualização, monitoramento, mensuração, entre outras atividades, relacionadas à metodologia de gerenciamento de riscos previstas na Política de Gestão de Risco. Além disso, coordena as atividades do Comitê de Risco, com destaque para a elaboração de relatórios de exposição de risco das carteiras de fundos de investimento geridos, para discussão nas reuniões do comitê, conforme descrito anteriormente;

(iii) **Diretoria de Gestão de Carteira de Valores Mobiliários** - responsável pela coordenação e desenvolvimento das operações que envolvem a gestão de

recursos, com destaque para a tomada de decisão na alocação de ativos e no exercício da política de voto em assembleias/reuniões dos emissores de títulos e valores mobiliários detidos pelas carteiras e fundos de investimento geridos;

(iv) **Departamento de Análise de Investimentos** - responsável pelo monitoramento, comparação e análise de ativos e valores mobiliários nos mercados financeiro e de capitais;

(v) **Comitê de Investimentos e Research** – responsável pela tomada das decisões sobre operações e estratégias de Investimentos dos Fundos, se necessário análise de novos mercados, avaliação da melhor execução das operações dos fundos de investimentos, uso de “Soft Dollar”, revisão de negociações VWAP/TWAP, Política de Direito do Exercício de Voto, análise da performance dos sistemas desenvolvidos; calibrar parâmetros, se necessário; discussão de novas metodologias e priorização de atividades.

(vii) **Diretoria Jurídica e de Compliance** - responsável por atividades jurídicas, de natureza consultiva ou contenciosa relacionadas à área de gestão de recursos da Daemon Investimentos. É responsável pela elaboração e atualização de políticas internas, monitoramento, fiscalização e aplicação de regras de *compliance* no âmbito da área de gestão de carteira de valores mobiliários da Daemon Investimentos.

(viii) **Comitê de Compliance** – responsável por analisar potenciais riscos oriundos do relacionamento com terceiros, conforme demanda do Departamento de Compliance; Monitorar riscos operacionais, reputacionais e regulatórios aos quais a Daemon poderá estar exposta; Deliberar acerca dos riscos de qualquer demanda trazida pelo Departamento de Compliance; Analisar e aprovar as Políticas internas da Daemon; e quando necessário, analisar eventuais reclamações/denúncias provenientes do Canal de Denúncia da Daemon ou de qualquer outro meio, observando o sigilo e discrição necessários.

#### - Órgãos que suportam todas as atividades:

(i) **Diretoria de TI** - responsável pela manutenção e pleno funcionamento de todos os componentes do sistema de tecnologia da informação. Também responsável pela operacionalização do Plano de Continuidade de Negócios, conforme descrito no item 10.4 deste Formulário de Referência; e

(ii) **Diretoria de Recursos Humanos** - responsável pela coordenação, organização e supervisão dos colaboradores vinculados a Daemon Investimentos. Suas atividades abrangem a estruturação e gerência de planos de carreira, cargos, salários e benefícios, sempre em respeito à legislação vigente e com o objetivo de desenvolvimento dos colaboradores da empresa; e

(iii) **Comitê de Performance dos Colaboradores** – responsável pela avaliação a performance dos Colaboradores da Daemon, que acarretará os valores pagos no bônus de cada um.

(iv) **Diretoria Financeira** – responsável pelo planejamento estratégico financeiro da empresa, garantindo uma visão analítica sobre o planejamento econômico, financeiro e estrutural da organização.

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

Todas os Comitês da Daemon devem ser registrados em ata e estas salvas digitalmente em rede ou sistema interno da Daemon pelo prazo mínimo de 10 (dez) anos contados da data de realização da reunião

Abaixo segue a relação dos Comitês Internos da Daemon e seus respectivos

detalhes:

#### **COMITÊ DE RISCOS:**

Membros	Diretor de Gestão, Diretor de Risco e os demais profissionais que necessitem dessas informações para o desempenho de suas funções.
Frequência	Semanal e, extraordinariamente, sempre que circunstâncias internas da Daemon Investimentos e/ou de mercado tornem recomendável a sua convocação.

#### **COMITÊ DE COMPLIANCE**

Membros	Diretor de Compliance, Gerente de Compliance, Gerente de Operações e Analista de Compliance e os demais profissionais que necessitem dessas informações para o desempenho de suas funções.
Frequência	Quinzenal e, extraordinariamente, sempre que circunstâncias internas da Daemon Investimentos e/ou de mercado tornem recomendável a sua convocação.

#### **COMITÊ DE PERFORMANCE**

Membros	Diretores Estatutários da Daemon, Gestores e representante do Departamento de Recursos Humanos.
Frequência	Semestral

#### **COMITÊ DE INVESTIMENTOS E RESEARCH**

Membros	Diretor de Gestão, times de Gestão de Recursos e os demais profissionais que necessitem dessas informações para o desempenho de suas funções.
Frequência	Semanal ou conforme demanda

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

Conforme disposto no Contrato Social da Daemon Investimentos, a sociedade é

gerida e administrada, sempre em conjunto, pelos sócios administradores Sr. Edson Corrêa Queiroz, Sr. Vitor Rhein Schirato, Sr. Ricardo Gomes dos Santos, Sr. Robson Ramos Abrão, e o Sr. Gabriel Kendjy Koike, sendo este último o diretor responsável pelas atividades de administração de carteira de valores mobiliários e membro do Comitê de Risco.

Ainda nos termos do Contrato Social da Daemon Investimentos, o Sr. Vitor Rhein Schirato será o diretor responsável pela (i) implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos da Sociedade, nos termos do artigo 4º, inciso IV, da RCVM 21; e (ii) prevenção ao combate à fraude e lavagem de dinheiro, na forma da RCVM 50/2021;

O Sr. Robson Ramos Abrão será o diretor responsável pela gestão de risco nos termos do artigo 4º, inciso V, da RCVM 21;

O Sr. Ricardo Gomes dos Santos será o Diretor responsável pela área Financeira (CFO – *Chief Financial Officer*).

A Daemon Investimentos conta, também, com profissionais que ocupam diretorias/departamentos internos, os quais não são nomeados administradores em seu Contrato Social e não contam com poderes de representação de sociedade no âmbito do referido instrumento. Esses profissionais exercem as seguintes funções na Daemon Investimentos:

(i) **Giovana Silva** - Gerente responsável pela área de finanças;

(ii) **Danilo Gouveia** - Gerente responsável pela área de TI.

(iii) **Débora Krelling** – Responsável pela área de Recursos Humanos.

(iv) **Márcia Santos** – Gerente responsável pela área de Operações.

## 8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 8.1.

Não há obrigatoriedade de disponibilização.

## 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:

Diretor Responsável	Diretor de Gestão de Carteira	Diretor de Compliance	Diretor de Gestão de Riscos
Nome	Gabriel Kendjy Koike	Vitor Rhein Schirato	Robson Ramos Abrão
Idade	36 anos	42 anos	36 anos
Profissão	Engenheiro	Advogado	Analista de Sistemas
CPF	008.777.089-08	220.168.188-08	351.072.348-10
Cargo ocupado	Diretor	Diretor	Diretor
Data da posse	28/03/2023	17/05/2010	28/02/2023

<b>Prazo de mandato</b>	Indeterminado	Indeterminado	Indeterminado
<b>Outros cargos na empresa</b>	Membro do Comitê de Investimentos	Diretor Jurídico	Membro do Comitê de Risco; Desenvolvedor Quantitativo

Observação: A Daemon Investimentos não possui diretor responsável pela atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento (item 8.7), pois não exerce essa atividade.

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

**Diretor responsável:** Gabriel Kendjy Koike

##### a. currículo, contendo as seguintes informações:44

##### i. cursos concluídos;

Graduação em Engenharia Eletrônica – ITA

##### ii. aprovação em exame de certificação profissional

Sim. CGF e CGA, ambas as certificações emitidas pela ANBIMA. Sem prazo de validade.

##### iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:

- nome da empresa
- cargo e funções inerentes ao cargo
- atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram
- datas de entrada e saída do cargo

**Nome da empresa:** Daemon Investimentos Ltda.

**Cargo e funções inerentes ao cargo:** Sócio administrador e diretor responsável pelas atividades de gestão de carteira de valores mobiliários e membro do Comitê de Risco.

**Principais atividades:** Responsável pelas atividades de gestão de carteira de valores mobiliários e membro do Comitê de Investimentos da Daemon Investimentos.

**Datas de entrada e saída do cargo:** 14.10.2020 até a presente data.

**Nome da empresa:** Mitsubishi Aircraft Corporation – Japão

**Cargo e funções inerentes ao cargo:** Engenheiro de Regras para Voo Controlado

**Principais atividades:** Responsável pelo programa MRJ durante a fase de desenvolvimento e teste de voo para participar do projeto, verificação e verificação das Leis de Controle de Voo atividades de certificação. Responsável pelo desenvolvimento inicial do conceito de Leis de Controle em novas aeronaves conceituais.

**Datas de entrada e saída do cargo:** Janeiro/2018 até Outubro/2020.

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

**Diretor responsável:** Vitor Rhein Schirato

**a. currículo, contendo as seguintes informações:**

**i. cursos concluídos;**

Graduação em Direito pela PUC/SP; Mestrado em Direito pela Universidade de Osnabruck (Alemanha); e Doutorado em Direito pela USP.

**ii. aprovação em exame de certificação profissional**

Inscrito na Ordem dos Advogados do Brasil, Conselho Seccional de São Paulo, sob nº 222.413.

**iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:**

- **nome da empresa**
- **cargo e funções inerentes ao cargo**
- **atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram**
- **datas de entrada e saída do cargo**

**Nome da empresa:** Daemon Investimentos

**Cargo e funções inerentes ao cargo:** Diretor jurídico e diretor de *compliance*.

**Principais atividades:** Responsável pelas atividades jurídicas de caráter consultivo e contencioso da sociedade. Responsável pela elaboração de políticas internas, atualização de políticas internas, monitoramento, fiscalização e aplicação de regras de *compliance* no âmbito da sociedade

**Datas de entrada e saída do cargo:** 17.5.2010 até a presente data.

**Nome da empresa:** Faculdade de Direito da Universidade de São Paulo

**Cargo e funções inerentes ao cargo:** Professor de Direito Administrativo

**Principais atividades:** Ensino, pesquisa e extensão acadêmica.

**Datas de entrada e saída do cargo:** abril de 2013 até o presente.

**8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer:**

**Diretor responsável:** Robson Ramos Abrão

**a. currículo, contendo as seguintes informações:**

**i. cursos concluídos;**

Graduação em Ciência da Computação pela Universidade Guarulhos. Especialização em Finanças e Economia (CFM) pelo INSPER. MBA em engenharia financeira pela POLI-USP.

**ii. aprovação em exame de certificação profissional**

N/A

**iii. principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:**

- **nome da empresa**
- **cargo e funções inerentes ao cargo**



- **atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram**
- **datas de entrada e saída do cargo**

**Nome da empresa:** Daemon Investimentos

**Cargo e funções inerentes ao cargo:** Desenvolvedor Quantitativo e Diretor de Riscos

**Principais atividades:** Responsável pelo desenvolvimento de sistemas, algoritmos de execução de ordens, sistema de cálculo de risco e PNL.

**Datas de entrada e saída do cargo:** 13.03.2021 até a presente data.

**Nome da empresa:** Bank of America Merrill Lynch

**Cargo e funções inerentes ao cargo:** Engenheiro de Software

**Principais atividades:** Responsável pelo desenvolvimento, evolução e manutenção da plataforma de trading Latam e também por sistemas proprietários locais.

**Datas de entrada e saída do cargo:** 02.12.2018 até 31.08.2020.

**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:**
  - **nome da empresa**
  - **cargo e funções inerentes ao cargo**
  - **atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram**
  - **datas de entrada e saída do cargo**

Não aplicável, pois a Daemon Investimentos não atua na 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**

25 profissionais.

**b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes**

Comitê Executivo: Sergio Schirato, Edson Queiroz e Vitor Schirato;

Pesquisa: Sergio Schirato, Paulo Hermann, Gabriel Koike, Hully Rolemberg, Erik Buischi e Paul Huchro;

Aplicações e Infraestrutura: Robson Ramos, Paulo Rizzardi, Natália Fontanezi, Vinicius Vieira e Samuel Santos;

Execução e Controles: Gabriel Koike, Hully Rolemberg, Vinicius Rabechi, Rodrigo Gesuatto, Victor Leite e Rivando Sousa;

Operações: Marcia Santos, Gabriel de Oliveira e Gustavo Bomfim;

Relações com Investidores: Guilherme Blake, Gabriela Viana e Diego Maksoud;

Compliance e Risco: Robson Ramos Abrão, Vitor Schirato, Giuliana Soldi e Bianca Martins.

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

Nosso processo de investimentos é baseado no método científico. Toda hipótese de investimentos é testada estatisticamente usando uma grande quantidade de dados históricos e simulados. As estratégias quantitativas só entram no nosso portfólio se risco e na diversificação.

Em nossa pesquisa procuramos identificar as exposições a risco subjacentes que contribuem para os retornos dos ativos. Uma vez identificados por testes rigorosos buscamos capturá-los de forma eficiente. Fatores como Momentum, Value, Carry e Low Risk são fundamentais no nosso processo de investimento por gerar retorno ajustado em risco, principalmente quando combinados e diversificados em diferentes classes de ativos.

Nossos modelos de estratégias de investimentos são desenhados não só para capturar os fatores de risco relevantes, mas também evitar riscos que não compensam ser tomados. A gestão do risco é incorporada no desenho de todos os modelos, desde tamanho da exposição e nível de risco por ativo, como também por setor, por fator de risco, por classe de ativo e por região geográfica. Nosso processo de alocação sistemático tem foco na gestão do risco e no controle da volatilidade. *Machine Learning*, isto é, a utilização de técnicas computacionais para determinar padrões e efetuar inferências, é uma ferramenta muito mais potente do que as tradicionais técnicas estatísticas. Nossa capacidade computacional, aliadas à técnicas complexas de aprendizado de máquina são usadas na nossa operação, maximizando o retorno do portfólio.

Diversificação é central no nosso processo de investimentos, diversificamos não só em classes de ativos, mas também em regiões geográficas, fatores de risco e classes de estratégias. Resultado é um produto de investimento global com excelente retorno ajustado ao risco e descorrelacionado com ativos financeiros brasileiros.

Para controlar a posição e risco, utilizamos tanto sistemas proprietários, desenvolvidos em avançadas linguagens de programação, quanto sistemas de terceiros (Lote45).

## **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**

3 (três) profissionais.

### **b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes**

Elaboração e atualização de políticas internas, monitoramento, fiscalização e aplicação de regras de *compliance*, com cominação de sanções e penalidades, se for o caso.

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

O Departamento de *compliance* da Daemon Investimentos envolve, entre outras atividades indicadas em tópicos específicos, as seguintes atividades:

- (i) fiscalização periódica de rotinas, regras e procedimentos previstos nas Políticas Internas, a fim de identificar eventuais violações;
- (ii) manutenção de canal para recebimento de dúvidas, esclarecimentos, denúncias ou reclamações, a serem dirigidas ao Diretor de *Compliance*, por meio de correio eletrônico;
- (iii) aplicação de penalidades aos colaboradores que violem as políticas internas, as quais poderão envolver ações disciplinares, incluindo advertência, desligamento do quadro societário da Daemon Investimentos, dissolução do vínculo empregatício ou rescisão do contrato de prestação de serviços ou do contrato que o vincula à Daemon Investimentos, conforme aplicável, sem prejuízo de eventuais medidas administrativas e/ou legais cabíveis; e
- (iv) atualização periódica de todas as políticas internas da Daemon Investimentos, a fim de refletir mudanças legislativas, regulamentares, de autorregulação e melhores práticas do mercado.

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

- (i) fiscalização periódica de rotinas, regras e procedimentos previstos nas Políticas Internas, a fim de identificar eventuais violações;
- (ii) manutenção de canal para recebimento de dúvidas, esclarecimentos, denúncias ou reclamações, a serem dirigidas ao Diretor de *Compliance*, por meio de correio eletrônico;
- (iii) aplicação de penalidades aos Colaboradores que violem as políticas internas, as quais poderão envolver ações disciplinares, incluindo advertência, desligamento do quadro societário da Daemon Investimentos, dissolução do vínculo empregatício ou rescisão do contrato de prestação de serviços ou do contrato que o vincula à Daemon Investimentos, conforme aplicável, sem prejuízo de eventuais medidas administrativas e/ou legais cabíveis; e
- (iv) atualização periódica de todas as políticas internas da Daemon Investimentos a fim de refletir mudanças legislativas, regulamentares, de autorregulação e melhores práticas do mercado.

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

**a. quantidade de profissionais**

2 (dois) profissionais

**b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes**

As atividades consistem basicamente: (i) no monitoramento, elaboração e atualização de políticas de risco; (ii) análise de relatórios periódicos formulados pelo sistema de backoffice e risco; (iii) operacionalização das atividades do Comitê de Risco; e (iv) determinação de ações corretivas, caso necessário.

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

A Política de Gestão de Risco da Daemon Investimentos apresenta de forma minuciosa todos os elementos que compõem a estrutura desenvolvida para gestão de riscos. A presente política aborda a metodologia, gerenciamento e os instrumentos utilizados para monitoramento de risco operacional, de crédito, de liquidez, de mercado, de concentração e de contraparte.

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

De forma geral, as metodologias de gerenciamento de riscos previstas na Política de Gestão de Riscos:

(i) serão implementadas, revisadas, atualizadas, monitoradas, mensuradas, supervisionadas e operacionalizadas pelo Diretor responsável pela Gestão de Riscos da Daemon Investimentos;

(ii) terão seu cumprimento fiscalizado pelo Diretor de *Compliance* e de Gestão de Riscos da Daemon Investimentos;

(iii) serão revistas e atualizadas anualmente pelo Diretor responsável pela Gestão de Riscos, ressalvadas as hipóteses em que, por força de alterações na legislação, regulamentação, autorregulação e/ou práticas de mercado, referida revisão se faça necessária em periodicidade menor;

(iv) serão objeto de relatórios de exposição de risco das carteiras e fundos de investimentos geridos, elaborados pelo Diretor responsável pela Gestão de Riscos, e discutidos no Comitê de Risco; e

(v) serão observadas pelo Diretor de Gestão, que deverá tomar as providências necessárias para ajustar a exposição a risco das carteiras geridas com base nos limites previstos nos contratos de gestão de carteira, nos regulamentos dos fundos de investimento e nas normas aplicáveis.

**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.**

3 (três) profissionais

**b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes.**

Conciliação da carteira calculada pelo administrador com o sistema interno de controle; conciliação das posições de custódia; conciliação dos cálculos de taxas acumuladas no fundo; conciliação das posições dos cotistas e cálculos de taxas de performance; entre outras.

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

Sistema de terceiro contratado para input das operações, cálculos de marcação a mercado, cálculos de taxas e cálculos das posições de cotistas. O sistema conta com feed de preços próprio.

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

**a. quantidade de profissionais.**

0 (zero).

**b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes.**

Não aplicável.

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

Não aplicável.

**d. infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição.**

Não aplicável.

**e. os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos.**

Não aplicável.

**8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes.**

Não aplicável.

**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**

Em relação às atividades de gestão de carteira de valores mobiliários praticadas pela Daemon Investimentos, a forma de remuneração consiste na taxa de administração, a qual é calculada anualmente com base fixa e expressa em percentual anual do patrimônio líquido do veículo de investimento e também na taxa de performance.

**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 ingresso.**

0 (zero).

**d. taxas de saída.**

0 (zero).

**e. outras taxas.**

0 (zero).

**9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes.**

Não aplicável.

**10. Regras, procedimentos e controles internos**

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

No desempenho de sua função de gestora de recursos, a Daemon adotará procedimentos rigorosos para a contratação e supervisão de terceiros prestadores de serviços, conforme disposto em normas legais e infralegais, em nome dos fundos de investimento sob sua gestão ("Prestadores de Serviços").

A Daemon pode terceirizar outros serviços desde que garanta, com base nesta política, que os prestadores contratados:

- (i) apresentem toda documentação necessária em conformidade com os padrões da Daemon, conforme estabelecido nesta política;
- (ii) possuam procedimentos e controles adequados ao ambiente regulatório e práticas de mercado, o que é verificado pela Daemon neste momento anterior ao início do relacionamento;
- (iii) possuam reputação e imagem íntegras e idôneas (background obrigatoriamente analisado); e
- (iv) apresentem infraestrutura adequada à prestação dos serviços objeto de sua contratação, a fim de assegurar, entre outros, que os respectivos serviços não sejam interrompidos em caso de eventuais indisponibilidades ou problemas técnicos de qualquer natureza não devidamente prevenidos.

Dessa forma, o processo de aprovação de novos Prestadores de Serviços para os fundos de investimento sob gestão da Daemon visa, primordialmente, assegurar a regularidade e conformidade das instituições com as quais a Daemon Investimentos pretende estabelecer parceria. O processo de contratação se diferencia de acordo com o Prestador de Serviço, sobretudo no caso de corretoras de títulos e valores mobiliários.

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

Entre os principais custos de transação, destaca-se a corretagem. Nesse sentido, houve intensa negociação quanto à corretagem paga pelos fundos de investimentos que são geridos pela Daemon Investimentos, de forma que foi padronizada para todas as corretoras. Além disso, os acordos da Daemon Investimentos estabelecem valores substancialmente inferiores à TOB (Taxa Operacional Básica), além de incluir descontos adicionais para operações de *day-trade* e de travas.

O sistema operacional utilizado pela Daemon Investimentos controla e consolida as taxas de corretagem de bolsa e outros custos dos fundos de investimentos sob sua gestão fazendo uma conferência diária com os cálculos do administrador e disponibilizando uma gama de relatórios gerenciais.

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

Conforme previsto em seu Manual de Compliance, a Daemon Investimentos considera

vantagem indevida todo e qualquer tipo de pagamento, doação, remuneração, presente ou favorecimento não admitido legalmente e que possa, mesmo que indiretamente, direcionar ou estimular o desvio de comportamento.

Nesse sentido, são elencadas no Manual de Compliance diversas condutas consideradas como aptas a produzir vantagens indevidas e que, portanto, serão proibidas a todos os colaboradores, dentre as quais, destacam-se:

- (i) pagamento de despesas de viagens de cortesia e de hospitalidade, exceto quando devidamente aprovadas pelo Diretor de *Compliance*, após formalização de processo interno em que se justifique a legitimidade e licitude do pagamento;
- (ii) pagamentos de despesas de alimentação, entretenimento e hospitalidade, exceto quando devidamente aprovadas pelo Diretor de *Compliance*, após formalização de processo interno em que se justifique a legitimidade e licitude do pagamento;
- (iii) pagamentos de almoços, jantares e de despesas de reuniões em restaurantes ou bares em que se reúnam outras pessoas, mesmo que a conta seja paga pela pessoa física, mas em que possam ser tratados assuntos relativos à Daemon Investimentos, acima do limite máximo por pessoa de R\$ 200,00 (duzentos reais). Ainda assim, a Daemon Investimentos aconselha que nessas situações, cada parte arque com suas próprias despesas; e
- (iv) distribuição de brindes, presentes e lembranças, mesmo que de baixo valor, a colaboradores da Daemon Investimentos. A Daemon Investimentos poderá, contudo, institucionalmente, oferecer produtos e lembranças da empresa, sem valor comercial, no contexto de suas iniciativas de promoção e marketing.

Naturalmente, trata-se de um rol exemplificativo e que depende do bom discernimento dos colaboradores da Daemon Investimentos no relacionamento com as partes envolvidas. O referido manual prevê ainda que, em caso de dúvidas sobre a regularidade de determinado ato ou comportamento, os colaboradores da Daemon Investimentos deverão consultar seus superiores hierárquicos, quando o caso, e/ou o Diretor de *Compliance*.

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

O Plano de Continuidade desenvolvido pela Daemon investimentos aborda em 3 (três) seções distintas, a saber (i) a descrição da infraestrutura de tecnologia da informação ("TI"); (ii) cenários de interrupção de negócios; e (iii) os procedimentos de contingência para cada cenário.

Nesse sentido, os serviços de backup de informações utilizados pela Daemon Investimentos no desempenho de suas atividades abrangem:

- (a) backup de informações digitais realizado pela área de TI da Daemon Investimentos e mantido em servidores físicos, instalados na sede da sociedade, e virtuais em nuvem;
- (b) backup a cada 3 horas das informações digitais realizado por software especializado rodando em ambiente cloud de boa reputação e referência no mercado, mantido em servidores geograficamente remotos (ambiente de *cloud computing*); e
- (c) cópias impressas dos documentos essenciais para funcionamento da Daemon Investimentos, que são enviadas para empresa de reputação nacional, especializada na armazenagem segura de documentos e com área segura e à prova de incêndio.



Quanto aos procedimentos em caso de queda de energia, todos os computadores da Daemon Investimentos estão ligados a uma rede elétrica alimentada por "No break" que suporta até aproximadamente 2 (duas) horas sem energia. Os servidores da Daemon Investimentos estão ligados na mesma rede. O sistema de "No break" é testado anualmente pela empresa prestadora de serviços. Além disso, todos os funcionários e colaboradores da Daemon Investimentos possuem laptops e aparelhos de telefone celular corporativo são fornecidos caso seja necessário o acesso remoto ao nosso servidor local e à rede na nuvem. Devido ao uso de laptops, o trabalho em casa, home-office, também é permitido.

Além de todos os procedimentos de prevenção destacados, o Plano de Continuidade aponta situações emergenciais e formas de remediar consequências, como em casos de:

- (a) prédio inacessível ou necessidade de evacuação - hipótese na qual ocorre a ativação da estrutura de home-office com acesso remoto à rede local (se disponível), acesso direto ao diretório na nuvem e redirecionamento de ligações a dispositivos móveis;
- (b) falha na rede de internet - hipótese na qual é feito uso de duplicidade de link com servidores diferentes (MUNDIVOX e ALGAR) e, em caso de queda simultânea dos dois links, utilização de internet de dispositivos móveis corporativos; e
- (c) interrupção por falha no servidor - hipótese na qual é feito uso de duplicidade de servidores, que passam a rodar da infraestrutura do nosso escritório na cidade de Miami, Estados Unidos, compatíveis com a transferência dos back-ups da unidade inacessível para a unidade disponível.

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

O monitoramento, gerenciamento, e controle da Liquidez dos fundos irá buscar assegurar a compatibilidade entre a demanda por liquidez estimada e a oferta de liquidez estimada.

Para isso, contamos com os indicadores:

- Simulação de fluxo de caixa esperado;
- Análise de Concentração do Passivo;
- Estimativa do Comportamento do Passivo;
- Cenários de estresse do passivo;
- Análise do número de dias para vender todas as posições do fundo, sem afetar o preço dos ativos;
- Concentração e posição dos ativos líquidos;
- Índice de Liquidez.

Todos os indicadores são reportados no mínimo semanalmente, em relatório gerencial elaborado pela área de riscos, e enviado para toda a equipe de gestão, membros do comitê de risco, e demais colaboradores que necessitem das informações para o desempenho de suas funções.

É analisada a demanda por liquidez considerando os resgates solicitados e ainda não liquidados, além dos passivos conhecidos, como custos e despesas. Os resgates agendados dos fundos são informados diariamente à equipe de gestão e de riscos para que as devidas ações sejam tomadas. Os algoritmos de operação da Daemon consultam automaticamente os sistemas gerenciais do Backoffice para alterar o tamanho das posições de acordo com as cotizações de movimentações do passivo.



Nenhum fundo gerido pela Daemon oferece a possibilidade de resgate com prazo de cotização reduzido mediante pagamento de taxa de saída.

Todas as análises de risco de liquidez consideram as janelas de 1, 2, 3, 4, 5, 21, 42 e 63 dias úteis, conforme orientação da ANBIMA.

Os indicadores de liquidez serão monitorados de maneira global, consolidando a posição de todos os fundos da mesma estratégia geridos pela Daemon. Ou seja, teremos um relatório para a estratégia *Systematic investments* incorporando todos os fundos e *feeders* desta estratégia.

O Comitê de Riscos define *soft* e *hard limits* com base nos indicadores mencionados acima. Em todas as reuniões dos Comitês são apresentadas a utilização dos limites, e será deliberado sobre a manutenção ou alteração destes. Todas as deliberações precisam ser embasadas e fundamentadas, sendo registradas em ata os motivos para qualquer alteração/manutenção.

**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, caso decida atuar na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor.**

Não aplicável.

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

<https://daemoninvestments.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 existem processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo e que sejam relevantes para os negócios da empresa.

**b. valores, bens ou direitos envolvidos**

Não existem processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo e que sejam relevantes para os negócios da empresa.

**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 existem processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo,

em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários, o Sr. Gabriel Kendjy Koike, figure no polo passivo e que afetem sua reputação profissional.

**b. valores, bens ou direitos envolvidos**

Não existem processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários, o Sr. Gabriel Kendjy Koike, figure no polo passivo e que afetem sua reputação profissional.

**11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores**

Não há outras contingências relevantes não tenham sido abrangidas pelos itens anteriores.

**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:**

**a. principais fatos**

Nos últimos 5 (cinco) anos não houve condenações judiciais, administrativas ou arbitrais transitadas em julgado.

**b. valores, bens ou direitos envolvidos**

Nos últimos 5 (cinco) anos não houve condenações judiciais, administrativas ou arbitrais transitadas em julgado.

**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:**

**a. principais fatos**

Não há 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, o Sr. Gabriel Kendjy Koike, tenha figurado no polo passivo e tenha afetado seus negócios ou sua reputação profissional.

**b. valores, bens ou direitos envolvidos**

Não há 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, o Sr. Gabriel Kendjy Koike, tenha figurado no polo passivo e tenha afetado seus negócios ou sua reputação profissional.

**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 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 do cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos;

- 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; e
- f. títulos contra si levados a protesto.

Os Sres. Gabriel Kendjy Koike e Vitor Rhein Schirato, inscritos no CPF/ME sob o nº 008.777.089-08 e nº 220.168.188-08, respectivamente, declaram que (i) reviram o formulário de referência; (ii) o conjunto de informações contido neste Formulário de Referência é um retrato verdadeiro, preciso e completo de seus negócios (como pessoas físicas) ou da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela Daemon Investimentos; (iii) não existem contra si quaisquer 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 estão inabilitados ou suspensos para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos; (iv) não existem contra si quaisquer 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; (v) não existem contra si quaisquer impedimentos de administrar seus respectivos bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa; (vi) não estão incluídos em cadastros de serviços de proteção ao crédito; (vii) não estão incluídos em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado; e (viii) não têm contra si títulos levados a protesto.

São Paulo, 21 de fevereiro de 2024.

*Gabriel Koike*  
Gabriel Koike (Feb 21, 2024 15:56 GMT-3)  
Gabriel Kendjy Koike  
CPF/ME: 008.777.089-08

*Vitor Rhein Schirato*  
Vitor Rhein Schirato (Feb 21, 2024 16:29 GMT-3)  
Vitor Rhein Schirato  
CPF/ME: 220.168.188-08










# Daemon Investimentos - Formulário Referência \_vFinal2\_2024

Final Audit Report

2024-02-21

Created:	2024-02-21
By:	Bianca Martins (bianca.martins@daemoninvestimentos.com.br)
Status:	Signed
Transaction ID:	CBJCHBCAABAA-JT-zG2kWZZ6gB_RDVOoOGoztFussZla

## "Daemon Investimentos - Formulário Referência\_vFinal2\_2024" History

-  Document created by Bianca Martins (bianca.martins@daemoninvestimentos.com.br)  
2024-02-21 - 6:37:41 PM GMT
-  Document emailed to Vitor Schirato (vitor.schirato@daemoninvestments.com) for signature  
2024-02-21 - 6:37:48 PM GMT
-  Document emailed to Gabriel Koike (gabriel.koike@daemoninvestimentos.com.br) for signature  
2024-02-21 - 6:37:49 PM GMT
-  Email viewed by Gabriel Koike (gabriel.koike@daemoninvestimentos.com.br)  
2024-02-21 - 6:55:43 PM GMT
-  Document e-signed by Gabriel Koike (gabriel.koike@daemoninvestimentos.com.br)  
Signature Date: 2024-02-21 - 6:56:17 PM GMT - Time Source: server
-  Email viewed by Vitor Schirato (vitor.schirato@daemoninvestments.com)  
2024-02-21 - 7:29:02 PM GMT
-  Signer Vitor Schirato (vitor.schirato@daemoninvestments.com) entered name at signing as Vitor Rhein Schirato  
2024-02-21 - 7:29:42 PM GMT
-  Document e-signed by Vitor Rhein Schirato (vitor.schirato@daemoninvestments.com)  
Signature Date: 2024-02-21 - 7:29:44 PM GMT - Time Source: server
-  Agreement completed.  
2024-02-21 - 7:29:44 PM GMT