

Índice

1. Responsáveis pelo formulário

1.1 – Declaração e Identificação dos responsáveis

2. Histórico da empresa

2.1 – Breve histórico sobre a constituição da empresa

2.2 – Principais eventos societários, alterações do escopo de atividades, de recursos humanos e computacionais, e de regras, políticas, procedimentos e controles internos

3. Recursos humanos

3.1 – Descrição dos recursos humanos

4. Auditores independentes

4.1 – Identificação dos Auditores

5. Resiliência Financeira

5.1 – Atestado das Demonstrações Financeiras

5.2 – Demonstrações Financeiras e Relatório

6. Escopo das atividades

6.1 - Descrição das atividades da empresa

6.2 – Outras atividades

6.3 – Descrição do perfil dos Investidores

6.4 – Valor dos Recursos Financeiros sob administração

6.5 – Descrição do perfil dos Gestores

6.6 – Outras informações relevantes

7. Grupo econômico

7.1 – Descrição do Grupo Econômico

7.2 – Organograma do Grupo Econômico

8. Estrutura operacional e administrativa

8.1 – Descrição da estrutura administrativa

8.2 – Organograma da estrutura administrativa

Índice

8.3 – Composição da administração e demais comitês da empresa

8.4 – Experiências dos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários

8.5 – Experiência do diretor responsável pelo *compliance* da ICVM 558

8.6 – Experiência do diretor responsável pela gestão de risco

8.7 – Experiência do diretor responsável pela atividade de distribuição de cotas do Fundo

8.8 – Informações sobre a estrutura da gestão de recursos

8.9 – Informações sobre a estrutura de *compliance* e de fiscalização da atividade e dos serviços prestados por terceiros

8.10 – Informações sobre a estrutura da gestão de riscos

8.11 – Informações sobre a estrutura das atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da estruturação de cotas

8.12 – Informações sobre a área de distribuição de cotas de fundos

8.13 – Outras informações relevantes

9. Remuneração da empresa

9.1 – Principais formas de remuneração

9.2 – Receita de clientes decorrente de taxas

9.3 – Outras informações relevantes

10. Regras, procedimentos e controles internos

10.1 – Descrição da política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços

10.2 – Descrição do monitoramento e minimização dos custos de transação com valores mobiliários

10.3 – Descrição das regras para tratamento de *soft dollar*

10.4 – Descrição dos planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados

10.5 – Descrição das políticas, práticas e controles internos para gestão do risco de liquidez das carteiras de valores mobiliários

10.6 – Descrição das políticas, práticas e controles internos para cumprimento do inciso I, artigo 30, da ICVM 558

10.7 – Endereço do administrador na rede mundial

11. Contingências

Índice

11.1 – Descrição dos processos judiciais, administrativos ou arbitrais que a empresa figura no polo passivo

11.2 – Descrição dos processos judiciais, administrativos ou arbitrais que o diretor responsável pela gestão da carteira figura no polo passivo

11.3 – Outras contingências relevantes

11.4 – Descrição das condenações judiciais, administrativas ou arbitrais transitadas em julgado em que a empresa tenha figurado no polo passivo

11.5 – Descrição das condenações judiciais, administrativas ou arbitrais transitadas em julgado em que o diretor responsável pela administração de carteiras tenha figurado no polo passivo

12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração

1. Responsáveis pelo formulário

1.1. Declaração e identificação dos responsáveis

Nome do responsável pelo conteúdo do formulário

Daniel Mathias Alves Pinto

Cargo do responsável

Diretor Responsável pela de Administração de Carteira e *Suitability*

Nome do responsável pelo conteúdo do formulário

Walter André Vannini

Cargo do responsável

Diretor de Operações, Gestão de Riscos e *Compliance*

Os diretores acima qualificados declaram que:

- a. Reviram o formulário de referência;
- b. O conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa.

Daniel Mathias Alves Pinto

Walter André Vannini

2. Histórico da Empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

Em 2013, a O3 Gestão de Recursos Ltda. (“O3”) foi adquirida pela Família de Abilio Diniz, passando a integrar o Grupo Península, que compreende as empresas de investimento responsáveis pela gestão dos ativos de propriedade da Família de Abilio Diniz (“Grupo Península”). Nesse sentido, a O3 passou a atuar como uma unidade de negócios para gestão dos recursos do Grupo Península.

A O3 atua na gestão de investimentos, através da administração de carteiras de ativos, inclusive títulos e valores mobiliários, e gestão de fundos de investimentos com as mais variadas políticas de investimento. A O3 trabalha prioritariamente com a gestão de recursos próprios e co-investimentos de terceiros que optem por investir juntamente com a Família de Abilio Diniz/Grupo Península em ativos previamente determinados.

A O3 é formada por qualificados profissionais com grande experiência em gestão de recursos. O seu principal objetivo é gerar valor no médio e longo prazo para os investimentos da Família de Abilio Diniz através de oportunidades de investimento em todas as classes de ativos.

A O3 embasa sua estratégia de investimento em estudos e análises de cenários macro e microeconômicos e mantém uma rigorosa política de gerenciamento de risco. Assim, atua de forma conservadora, com retornos atrativos de longo prazo, o que garante maior segurança no gerenciamento do risco de seus fundos de investimento.

Para gerir os recursos da Família de Abilio Diniz/Grupo Península, a O3 possui estrutura totalmente segregada das demais sociedades da Família de Abilio Diniz/Grupo Península com profissionais, procedimentos e processos próprios, sendo a sua estrutura operacional integralmente segregada das demais áreas. Com efeito, há segregação física do time de gestão de recursos da O3 e definições claras de políticas de sigilo que evitam a circulação de informações e o conflito de interesse entre as diferentes áreas.

A O3 é regida por regras meritocráticas, transparentes e que buscam a valorização do capital humano por meio da formação e treinamento de novos talentos. Dessa forma, entende ser capaz de reter, treinar e motivar bons profissionais e, como consequência, gerar resultados diferenciados ao longo do tempo.

Do ponto de vista societário, a O3 foi constituída em 29 de fevereiro de 2008, sob a denominação social de “FRAM Capital Private Equity - Gestão de Ativos Ltda.”, pelos Srs. Henry Singer Gonzalez, Gustavo Adolfo Funcia Murgel, Guilherme Pellegrini Mammana Cesare Rivetti, e pela empresa FRAM Capital Participações Ltda.

Em 17 de setembro de 2013, com a saída dos então sócios, a denominação social da gestora foi alterada para “O3 Gestão de Recursos Ltda.”, e seu quadro social passou a ser composto por empresas e pessoas, direta ou indiretamente, ligadas à Família de Abilio Diniz/Grupo Península.

Após algumas reorganizações societárias ocorridas entre 30 de junho de 2014 a 25 de abril de 2016, conforme detalhadas abaixo, a O3 passou a ser controlada pela Península Capital Participações S.A.

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

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

Alteração no controle societário – Aquisição da O3 pela Família de Abilio Diniz/Grupo Península e Outras Medidas até a Configuração Societária Atual

Em 17 de setembro de 2013 os sócios FRAM Capital Participações S.A. e SHERPA Holding Participações Ltda. retiraram-se da sociedade, cedendo e transferindo a totalidade de suas cotas à PAIC Participações Ltda., que por sua vez, cedeu uma cota ao Sr. Eduardo Pongrácz Rossi. Nesta data, a O3 passou a ser indiretamente controlada pela Família de Abilio Diniz/Grupo Península e adotaram-se as primeiras medidas para adoção da estrutura societária, governança, valores e políticas atuais.

A partir de então, gradativamente, a O3 **(i)** mudou a sua sede social para endereço no qual se localizam outras empresas da Família de Abilio Diniz/Grupo Península, passando a adotar nova estrutura física e de sistemas; **(ii)** passou por uma reformulação na governança interna que envolveu a contratação de profissionais especializados, com vasta experiência nas respectivas áreas de atuação, **(iii)** tomou as medidas necessárias para aderir aos Códigos da ANBIMA e ABVCAP referentes às atividades que exerce, privilegiando a transparência das atividades que realiza, na esteira de outras atividades já realizadas por seus novos controladores.

De 30 de junho de 2014 a 25 de abril de 2016, a O3 realizou diversas etapas de uma reorganização societária com os seguintes objetivos:

- (i)** reconhecer a entrada na sociedade de novos sócios, sendo que atualmente a O3 é controlada pela Península Capital Participações S.A.;
- (ii)** consolidar na O3 as atividades de gestão de ativos líquidos e ilíquidos (*private equity*); e
- (iii)** organizar a governança interna e otimizar a estrutura das sociedades da Família de Abilio Diniz/Grupo Península, visando a perpetuidade e a continuidade dos negócios.

Em 29 de agosto de 2016, o Sr. Daniel de Barbosa Vaz apresentou sua renúncia ao cargo de Diretor da O3 e à atribuição de diretor responsável pela administração de carteira de valores mobiliários. Em virtude da renúncia apresentada, na mesma data, os sócios da O3 decidiram atribuir ao Diretor Daniel Mathias Alves Pinto a responsabilidade pela administração de carteiras de valores mobiliários sob administração da O3, incluindo a verificação de adequação do produto ao perfil de cada cliente (*suitability*), conforme exigências na regulamentação aplicável.

- b. escopo das atividades

Na presente data, o escopo de nossas atividades é a gestão de investimentos, através da administração de carteiras de ativos, inclusive títulos e valores mobiliários, e gestão de fundos de investimentos, nos termos da legislação e regulamentação em vigor. Exercemos a atividade de consultoria de títulos e valores mobiliários e consultoria em *private equity* apenas de forma incidental, como atividade acessória no curso da prestação dos nossos demais serviços descritos acima.

Trabalhamos prioritariamente com a gestão de recursos próprios e co-investimentos de terceiros, que optem por investir juntamente com a Família de Abilio Diniz/Grupo Península em determinados investimentos.

c. recursos humanos e computacionais

Na presente data, a O3 conta com uma equipe de 18 pessoas, além de 10 Diretores, sendo: 3 Diretores sem designação específica, cujo foco é atuação em *private equity*; 1 Diretor sem designação específica com foco em investimentos líquidos; 1 Diretor de Operações, Gestão de Risco e *Compliance*; 1 Diretor responsável pela administração de carteiras, *Suitability* perante a CVM e Head Portfolio Manager; 3 Diretores sem designação específica com atuação como Portfolio Managers; 1 Diretora de Recursos Humanos; 1 *Trader*; 4 Analistas de Mercados; 7 analistas de PE; 3 analistas de backoffice; 1 analista de macroeconomia; 1 programador e 1 Gerente de Backoffice. Cada um desses profissionais possui computadores com os recursos modernos que estão sendo constantemente atualizados, de forma que estão sempre aptos ao exercício de suas funções.

Além disso, a O3 compartilha determinadas áreas, recursos e profissionais de suporte com a Península Participações S.A., tais como salas de reunião, profissionais de TI, jurídico e contabilidade, recursos humanos.

d. regras, políticas, procedimentos e controles internos

Possuímos as seguintes políticas internas:

- **Manual de Ética e *Compliance*** – Documento que contém as nossas principais regras sobre os padrões de conduta, políticas de confidencialidade de informações, políticas de segregação de atividades, políticas de conflito de interesse, treinamento, segurança da informação e controles para prevenção à lavagem de dinheiro. Adicionalmente, o Manual de *Compliance* estabelece as regras a serem seguidas no tocante a vantagens, benefícios e presentes a serem dados e recebidos por colaboradores, bem como no tocante a investimentos pessoais. São realizados treinamentos anuais sobre o conteúdo do Manual de *Compliance* e as principais regras aplicáveis, sendo que os nossos Colaboradores (conforme definido abaixo) atestam e registram tal participação.
- **Política de Exercício de Direito de Voto** – Documento que regula a forma como exercemos nosso voto em assembleias gerais de fundos de investimento e companhias emissoras de valores mobiliários que integrem as nossas

carteiras, elaborado de acordo com orientações do nosso comitê de investimento, seguindo orientações da ANBIMA.

- **Metodologia de Gestão de Riscos da O3 Gestão de Recursos Ltda.** – Documento que estabelece a nossa metodologia de gestão de riscos, contendo regras de monitoramento da exposição aos fatores de risco inerentes aos investimentos realizados, especialmente no tocante a tipos de riscos e pontos de controle.
- **Política de Controle e Gerenciamento de Risco de Liquidez da O3 Gestão de Recursos Ltda.** – Documento adotado com o objetivo de atender às regras estabelecidas no Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento (“Código ANBIMA de Fundos”) e estabelece os procedimentos de controle e gerenciamento de liquidez a serem observados nas carteiras dos fundos de investimento os quais gerimos.
- **Plano de Contingência e Continuidade dos Negócios da O3 Gestão de Recursos Ltda.** – Documento que contém os procedimentos que seguiremos no caso de contingência, de modo a impedir a descontinuidade operacional por problemas técnicos. Foram estipuladas estratégias e planos de ação com o intuito de garantir que os nossos serviços essenciais sejam devidamente identificados e preservados após a ocorrência de um imprevisto ou um desastre.
- **Política Formal de Decisão de Investimentos e de Seleção e Alocação de Ativos da O3 Gestão de Recursos Ltda.** – Documento adotado com objetivo de atender às regras estabelecidas no Código ANBIMA de Fundos, que estabelece os princípios, conceitos e diretrizes básicas que nortearão as nossas decisões no tocante à seleção e alocação de ativos no exercício de sua atividade de gestão de recursos.
- **Política de Negociação de Valores Mobiliários Aplicável aos Colaboradores** – Documento que estabelece princípios, conceitos e valores que orientam a conduta de todos aqueles que possuam cargo, função, posição, relação societária, empregatícia, comercial, profissional, contratual ou de confiança (“Colaboradores”) em relação a aplicação de seus próprios recursos.

As nossas políticas estão disponíveis para consulta dos investidores, em português, no nosso *website* (<http://o3capital.com.br/>).

3. Recursos Humanos

3.1. Descrição dos recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:

a. número de sócios

A O3 possui atualmente 9 (nove) sócios.

b. número de empregados

A O3 possui atualmente 18 (dezoito) empregados.

c. número de terceirizados

A O3 não possui empregados terceirizados. Contudo, como mencionado acima, a O3 compartilha determinados profissionais com a sua controladora tais como o time de TI, jurídico, recursos humanos e contabilidade.

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

| Nome | CPF |
|------------------------------|----------------|
| Daniel Mathias Alves Pinto | 310.100.728-38 |
| Bruno Ribeiro de Macedo | 296.586.028-27 |
| Eduardo Pongrącz Rossi | 162.864.248-30 |
| Daniel Barbosa Vaz | 014.306.686-28 |
| Ricardo Jun Maeji | 248.242.428-35 |
| Marcelo Giovanetti D´Arienzo | 227.962.378-18 |

4. Auditores

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

a. Nome empresarial

Ernst & Young Auditores Independentes S/S

b. Data de contratação dos serviços

31 de dezembro de 2016

c. Descrição dos serviços contratados

Auditoria das Demonstrações Contábeis

| | |
|---|---|
| Possui Auditor? | SIM |
| Código CVM do auditor | 00471-5 |
| Tipo auditor | Nacional |
| Nome/Razão social | Ernst & Young Auditores Independentes S/S |
| CPF/CNPJ | 61.366.936/0001.25 |
| Data de contratação dos serviços | 31.12.2016 |
| Descrição dos serviços contratados | Auditoria das Demonstrações Contábeis |

5. Resiliência Financeira

5.1. Atestado das Demonstrações Financeiras

Com base nas demonstrações financeiras, atestamos que:

- a. a receita em decorrência de taxas com bases fixas a que se refere o item 9.2.a abaixo é suficiente para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários

A receita recebida é suficiente para cobrir os custos e os investimentos da O3.

- 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 abaixo e mais do que R\$300.000,00 (trezentos mil reais).

O patrimônio líquido da O3 representa mais do que 0,02% dos recursos financeiros sob administração e mais do que R\$300.000,00 (trezentos mil reais).

5.2. Demonstrações Financeiras e relatório de que trata o §5º do art. 1º da ICVM 558

A O3 não exerce administração fiduciária de fundos de investimento. Contudo, as demonstrações financeiras são auditadas para maior segurança e transparência. As demonstrações financeiras estão disponíveis para consulta mediante contato com a O3.

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.)

Trabalhamos prioritariamente na gestão de recursos próprios e co-investimentos de terceiros que optem por investir juntamente com a Família de Abilio Diniz/Grupo Península em determinados investimentos, bem como de recursos de nossos colaboradores que invistam em conjunto conosco e os co-investidores terceiros, conforme o caso. Nesse sentido, atuamos na:

- gestão discricionária de fundos de investimento, nos quais são investidos exclusivamente recursos próprios;
- gestão discricionária de carteiras administradas, nos quais são investidos exclusivamente recursos próprios;
- gestão de carteiras de fundos de investimento em participação, nos quais os investidores podem, ou não, participar do planejamento da carteira;
- gestão discricionária de fundos de investimento constituídos no exterior; e
- outros tipos de investimento, desde que realizado com os recursos da Família de Abilio Diniz/Grupo Península.

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.)

Atuamos como gestores de:

- fundo de investimento em ações, quando a O3 atua na eleição dos valores mobiliários a serem adquiridos, controle dos riscos aos quais o fundo está exposto em virtude da aquisição, e análise do mercado para verificar estratégias de saída;
- fundos de investimento multimercado, quando a O3 atua na eleição dos ativos financeiros a serem adquiridos pelo fundo, bem como no controle dos riscos aos quais o fundo está exposto; e
- fundos de investimento participações, quando a O3 atua na eleição das participações a serem adquiridas, bem como na administração das estratégias de saída.

Adicionalmente, atuamos como administradores de determinadas carteiras de investimento e como gestores de fundos de investimento constituídos no exterior.

c. tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Por favor, vide item (b) acima.

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

Atualmente, não atuamos como distribuidores de cotas de fundos de investimento.

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 interesse existentes entre tais atividades

A O3 desenvolve a atividade de consultoria de valores mobiliários apenas de forma incidental, como maneira acessória no curso da prestação dos nossos serviços de administração e gestão de carteiras de valores mobiliários. Considerando que a O3 realiza somente a gestão de recursos próprios e/ou co-investimentos específicos, não há potenciais conflitos de interesses entre tais atividades de consultoria incidental e a atividade de administração de carteira de valores mobiliários.

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 O3 é controlada pela Península Capital Participações S.A. (CNPJ/ME: 23.190.517/0001-96), sociedade por ações controlada por Flavia Buarque de Almeida e Eduardo Pongrácz Rossi. Considerando que a Península Capital Participações S.A. participa exclusivamente do capital da O3 que, por sua vez, somente realiza a gestão de recursos próprios e/ou co-investimentos específicos, não há de se falar em atividades exercidas e/ou potenciais conflitos de interesses envolvendo sociedades controladoras, controladas, coligadas e/ou sob controle comum à O3.

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)

| | Fundos e carteiras destinados à: | | | |
|-----------------------------------|---|----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------|
| | Investidores Não Qualificados | Investidores Qualificados | Investidores Profissionais | Total |
| Nº de investidores | 10 | 0 | 21 | 31 |
| Recursos sob administração | 5,1 milhões | 0 | R\$7,9 bilhões | R\$7,905 bilhões |

b. Número de investidores, dividido por:

| | Nº de Investidores |
|--|---------------------------|
| i. Pessoas Naturais | 9 |
| ii. Pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais) | 11 |
| iii. Instituições financeiras | 0 |
| iv. Entidades abertas de previdência complementar | 0 |
| v. Entidades fechadas de previdência complementar | 0 |
| vi. Regimes próprios de previdência social | 0 |
| vii. Seguradoras | 0 |
| viii. Sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil | 0 |
| ix. Clubes de investimentos | 0 |
| x. Fundos de investimento | 0 |
| xi. Investidores não residentes | 1 |
| xii. Outros | 10 por conta em ordem |
| Total | 31 |

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

A O3 gere R\$6,105 bilhões em fundos e R\$1,8 bilhões em carteiras perfazendo o total de R\$7,905 bilhões.

d. Recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior

| | |
|---|----------------------|
| Recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior | R\$1,5bilhões |
|---|----------------------|

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

| 10 maiores clientes | Recursos sob administração |
|----------------------------|-----------------------------------|
| 1º | 17,3% |
| 2º | 15,1% |
| 3º | 14,9% |
| 4º | 14,7% |
| 5º | 6,5% |
| 6º | 6,5% |
| 7º | 4,3% |
| 8º | 4,3% |
| 9º | 3,9% |
| 10º | 3,4% |

f. Recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

| | Recursos sob administração |
|--|-----------------------------------|
| i. Pessoas Naturais | R\$3,9 bilhões |
| ii. Pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais) | R\$2,9 bilhões |
| iii. Instituições financeiras | 0 |
| iv. Entidades abertas de previdência complementar | 0 |
| v. Entidades fechadas de previdência complementar | 0 |
| vi. Regimes próprios de previdência social | 0 |
| vii. Seguradoras | 0 |
| viii. Sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil | 0 |
| ix. Clubes de investimentos | 0 |
| x. Fundos de investimento | 0 |

| | |
|--|-------------------------|
| xi. Investidores não residentes | R\$1,1 bilhões |
| xii. Outros | R\$ 5 milhões |
| Total | R\$7,905 bilhões |

6.4. Valor dos recursos financeiros sob administração

| | Valor dos recursos financeiros (R\$) |
|--|---|
| Ações | 9,3 bilhões |
| Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira | 0 |
| Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras | 0,4 bilhões |
| Cotas de fundos de investimento em ações | 0,1 bilhões |
| Cotas de fundos de investimento em participações | 0,1 bilhões |
| Cotas de fundos de investimento imobiliário | 0 |
| Cotas de fundos de investimentos em direitos creditórios | 0 |
| Cotas de fundos de investimentos em renda fixa | 0 |
| Cotas de fundos de investimentos | 1,9 bilhões |
| Derivativos (valor de mercado) | 2,0 bilhões |
| Outros valores mobiliários | 0 |
| Títulos públicos | 0,7 bilhões |
| Outros ativos (loans e derivativos) | 6,9 bilhões |

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, tendo em vista que a O3 atua exclusivamente na gestão de carteira.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevante

Não há outras informações que julguemos relevantes em relação a esta seção 6.

7. Grupo Econômico

7.1. Descrição do Grupo Econômico

a. controladores diretos e indiretos

O controlador direto da O3 é a Península Capital Participações S.A. (CNPJ/ME: 23.190.517/0001-96), sociedade por ações que, por sua vez, é controlada por Flavia Buarque de Almeida e Eduardo Pongrácz Rossi.

b. controladas e coligadas

A O3 não possui controladas e coligadas.

c. participações da empresa em sociedades do grupo

A O3 não possui participação em sociedades.

d. participações de sociedade do grupo na empresa

A Península Capital Participações S.A. possui 98,02% das cotas da O3.

e. sociedade sob o controle comum

A O3 não possui sociedade sob controle comum.

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

A O3 optou por não divulgar o seu organograma.

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 diretoria da O3 é composta por 2 a 10 membros, sócios ou não, eleitos pelos sócios e indicados no Contrato Social ("Diretores"). Encontram-se nomeados os senhores: Bruno Ribeiro de Macedo, Walter Andre Vannini, Flavia Buarque de Almeida, Eduardo Pongrácz Rossi, Daniel Mathias Alves Pinto, Laura Tourinho Jaguaribe, Ricardo Jun Maeji, Daniel Barbosa Vaz, Marcelo Giovanetti D'Arienzo e Juliana Grossi Alonso, todos com mandato por prazo indeterminado.

Os Diretores poderão ser destituídos, a qualquer tempo, mediante deliberação dos sócios, observados os quóruns previstos em lei e ficam dispensados de prestar caução para o exercício de seus cargos.

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

Não aplicável.

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

Além das atribuições necessárias à realização dos fins sociais da O3, os Diretores ficam investidos do poder para representar a O3, ativa e passivamente, judicial e extrajudicialmente, transigir, renunciar, firmar compromissos, confessar dívidas, fazer acordos, contrair obrigações, celebrar contratos e adquirir, alienar e onerar bens, observadas as condições estabelecidas no contrato social.

A O3 será representada por:

- (i) por 2 (dois) Diretores do Grupo A em conjunto;
- (ii) por 02 (dois) Diretores do Grupo B em conjunto;
- (iii) por 01 (um) Diretor do Grupo A em conjunto com 01 (um) Diretor do Grupo B; e
- (iv) por 01 (um) Diretor do GRUPO A ou do GRUPO B em conjunto com um procurador com poderes específicos.

A representação da O3 em assembleia geral ou reunião de sócios de qualquer de suas entidades investidas (incluindo, sem limitação, sociedades e fundos de investimento)

poderá ser realizada por apenas 1 (um) Diretor isoladamente, desde que munido de procuração com poderes específicos, outorgada nos termos do contrato social.

Ao Diretor Daniel Mathias Alves Pinto é atribuída a responsabilidade pela administração de carteira de valores mobiliários sob gestão da O3, além da consultoria em *private equity* e de títulos e valores mobiliários, incluindo a verificação da adequação do produto distribuído pela O3 ao perfil de cada cliente.

Ao Diretor Walter Andre Vannini é atribuída a responsabilidade pelo cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e da Comissão de Valores Mobiliários, inclusive a responsabilidade pela gestão de risco das carteiras de valores mobiliários sob gestão da O3.

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

A O3 optou por não incluir o organograma da estrutura administrativa.

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:

| Nome | Idade | Cargo ocupado | Prazo do mandato |
|---------------------------|------------|---------------|---|
| CPF | Profissão | Data de posse | Outros cargos ou funções exercidas na empresa |
| Walter Andre Vannini | 48 | Diretor | Indeterminado |
| 179.943.988-71 | Economista | 30/06/2014 | Head de Operações, <i>Compliance</i> e Gestão de Riscos |
| Bruno Ribeiro de Macedo | 37 | Diretor | Indeterminado |
| 296.586.028-27 | Economista | 17/09/2013 | <i>Portfolio Manager</i> |
| Flavia Buarque de Almeida | 52 | Diretora | Indeterminado |

| | | | |
|------------------------------|----------------|------------|--|
| 149.008.838-59 | Administradora | 23/01/2017 | Diretora |
| Eduardo Pongrácz Rossi | 48 | Diretor | Indeterminado |
| 162.864.248-30 | Administrador | 23/01/2017 | Diretor |
| Daniel Mathias Alves Pinto | 37 | Diretor | Indeterminado |
| 310.100.728-38 | Administrador | 29/08/2016 | Responsável por Administração de Carteira e <i>Suitability</i> perante a CVM e <i>Head Portfolio Manager</i> |
| Ricardo Jun Maeji | 42 | Diretor | Indeterminado |
| 248.242.428-35 | Economista | 08/04/2019 | <i>Portfolio Manager</i> |
| Laura Tourinho Jaguaribe | 37 | Diretora | Indeterminado |
| 097.376.897-55 | Administradora | 25/04/2016 | Diretora |
| Daniel Barbosa Vaz | 36 | Diretor | Indeterminado |
| 014.306.686-28 | Administrador | 31/01/2020 | <i>Portfolio Manager</i> |
| Marcelo Giovanetti D'Arienzo | 35 | Diretor | Indeterminado |
| 227.962.378-18 | Administrador | 31/01/2020 | Diretor |
| Juliana Grossi Alonso | 45 | Diretor | Indeterminado |
| 212.556.258-80 | Publicitária | 31/03/2020 | Diretora |

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

a. currículo, contendo informações estabelecidas na ICVM 558

Experiência profissional

Daniel Mathias Alves Pinto – 310.100.728-38

O Sr. Daniel Mathias Alves Pinto formou-se em administração de empresas na Fundação Getúlio Vargas – FGV em 2006, tendo cursado MBA em Mercados Financeiros na FIPECAFI em 2007 e um mestrado profissional em Macroeconomia Financeira na Fundação Getúlio Vargas em 2015. Recebeu a certificação CGA da ANBIMA.

Trabalhou como *trader* na Forsix Adm. de Recursos de março de 2008 até dezembro de 2010, como gerente financeiro na Eldorado Celulose e Papel de janeiro de 2011 até janeiro de 2013 e como diretor financeiro no Grupo Bandeirantes de Comunicação, de fevereiro de 2013 até dezembro de 2013.

Juntou-se à O3 em janeiro de 2014, atuando como administrador de carteiras.

Bruno Ribeiro de Macedo – 296.586.028-27

O Sr. Bruno Ribeiro de Macedo formou-se em ciências econômicas pela PUC-SP em 2006, tendo realizado também MBA em Finanças na faculdade de economia e administração da Universidade de São Paulo (FEA USP), em 2008. Recebeu a certificação CGA da ANBIMA.

Atuou como analista financeiro na CDB – Companhia Brasileira de Distribuição de dezembro de 1998 até agosto de 2006. Trabalhou na Península Capital Participações S.A. de setembro de 2006 até outubro de 2010, tendo passado a atuar como administrador de carteiras na O3 desde o início de suas atividades.

Flávia Buarque de Almeida – 149.008.838-59

A Sra. Flávia Buarque de Almeida é atualmente Sócia da Península Capital Participações S.A., onde é responsável pela área de Private Equity. Flavia é Conselheira da BRF S.A., Conselheira do Carrefour S.A., Conselheira da Wine.com.br, Conselheira da GAEC Educação S.A., Conselheira da Universidade de Harvard e Conselheira na Península Participações. Flavia foi Sócia do Monitor Group. Também foi Diretora Geral da Participações Morro Vermelho S.A. e Conselheira em empresas públicas e privadas. Flavia foi Sócia da McKinsey & Company. Flavia é Bacharel em Administração de Empresas. Ela também é membro do conselho do Instituto Península.

Eduardo Pongrácz Rossi – 162.864.248-30

O Sr. Eduardo Pongrácz Rossi é atualmente Sócio da Península Capital Participações S.A., onde é responsável pela área de administração de carteiras. Eduardo é membro do Conselho de Administração do Atacadão S.A., além de atuar como presidente do Comitê de Recursos Humanos, membro do Comitê de Auditoria Estatutário e membro do Comitê de Estratégia dessa mesma companhia. Em 2019 assumiu o assento de Vice Presidente do Conselho de Administração da Península Participações. Eduardo Rossi é bacharel em Administração de Empresas com dupla especialidade em Finanças e Marketing na Fundação Getúlio Vargas (FGV), onde foi eleito Representante Estudantil no Conselho de Administração da escola. Formou-se com honras na Master Business Administration na Columbia University. Possui 22 anos de experiência no mercado financeiro, incluindo a vice-presidência da JP Morgan e Salomon Smith Barney em Nova York. Ele também é membro do conselho de duas organizações não governamentais: Criança Segura, desde 2005, e Instituto Península, desde 2010.

Ricardo Jun Maeji - 248.242.428-350

Sr. Ricardo Jun Maeji formou-se em ciências econômicas na universidade de São Paulo (FEA-USP) em 2001 com pós-graduação em finanças pelo CFA Institute em 2006.

Iniciou sua carreira como analista de renda variável para a América Latina pelo ABN AMRO Asset Management em 2000, seguindo sua carreira como gestor de portfólios para a América Latina e especialista em Mercado Emergentes pela mesma instituição baseado em Amsterdã até 2008. Trabalhou como especialista de mercados emergentes pelo ING Investment Management e retornou ao Brasil para liderar a área de renda variável pela Sulamerica/ING até 2011. Foi gestor de carteiras pela Itau Asset Management e chefe de pesquisa em ações no período de 2011 até 2018.

Juntou-se à O3 em abril de 2019, atuando como Portfolio Manager.

Laura Tourinho Jaguaribe – 097.376.897-55

A Sra. Laura Tourinho Jaguaribe formou-se em administração de empresas na Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro (PUC – RJ) em 2004, tendo também realizado pós-graduação em Marketing Estratégico na Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro (PUC – RJ) em 2007.

Trabalhou como Gerente Sênior no Grupo Monitor de novembro de 2009 até outubro de 2013 e em Estratégia Corporativa e Inteligência de Negócios na Braskem, de outubro de 2013 até março de 2016.

Juntou-se ao Grupo Península em 2016, atuando como Diretora de Private Equity.

Marcelo Giovanetti D’Arienzo – 227.962.378-18

O Sr. Marcelo Giovanetti D’Arienzo formou-se em administração de empresas na Fundação Armando Alvares Penteado – FAAP em 2005, tendo realizado também curso de extensão em logística na Fundação Getúlio Vargas – FGV.

Trabalhou como consultor na Unisys atuando como executivos de pré-vendas de 2003 a 2006, como Analista e *Trainee* no Banco Safra de 2006 a 2007 e como Gerente Senior no Monitor Group de 2007 a 2013.

Juntou-se a O3 em 2013, atuando como Diretor de Private Equity.

Daniel Barbosa Vaz – 014.306.686-28

O Sr. Daniel Barbosa Vaz formou-se em administração de empresas na Fundação Getúlio Vargas – FGV em 2006 e, posteriormente recebeu a certificação CGA da ANIBIMA.

Trabalhou como *associate* no Banco JP Morgan de 2008 até 2010, tendo exercido atividades relacionadas a gestão de recursos. Trabalhou como vice presidente no Bradesco Securities, em Nova Iorque, de março a outubro de 2010, tendo atuando também na gestão de recursos.

Juntou-se ao Grupo Península em novembro de 2010, tendo atuado na O3 desde o início de suas atividades.

Atualmente é Portfolio Manager.

Juliana Grossi Alonso - 212.556.258-80

A Sra. Juliana Grossi Alonso formou-se em Marketing na Pontifícia Universidade Católica de Campinas (PUCAMP), tendo realizado também pós graduação em Marketing na Escola Superior de Propaganda e Marketing (ESPM). É, ainda, coach certificada pelo NeuroLeadershipGroup, com mais de 1.000 (mil) horas de prática. É qualificada nas seguintes ferramentas: Emotional Intelligence (EQI 2.0), Leadership Effectiveness Analysis™ from the Management Research Group Institute®, Myers Briggs Type Indicator –MBTI®, Birkman®, FIRO B®, TKI®, TMP –Team Management Profile®, L.A.B.E.L®, FACET 5®, dentre outras.

Iniciou sua carreira em marketing, atuando com comunicação, marcas, desenvolvimento de produtos e planejamento estratégico. Atuou como Diretora de Marketing e Recursos Humanos na Caloi (fabricante de bicicletas), bem como foi membro do Comitê Executivo de referida empresa.

8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos e da ICVM 558, fornecer:

a. currículo, contendo as informações estabelecidas na ICVM 558

Experiência profissional

Walter André Vannini – 179.943.988-71

Sr. Walter André Vannini formou-se em Ciências Econômicas na universidade Mackenzie em 1999, tendo se formado em MBA em Economia do Setor Financeiro FIPE USP em 2002. Possui Certificação CPA 20.

Trabalhou como gerente de controladoria do Banco Safra S.A., de 1993 até 2008. Posteriormente, de março de 2008 a agosto de 2009, atuou como Senior Manager no Safra International Bank Bahamas Ltda. e, de setembro de 2009 até março de 2012 como diretor de administração fundiária do Banque Safra Luxemburgo SA. Tem vasta experiência nos setores bancário e de administração fundiária, sendo sempre responsável pelo controle e atividades de *back office*.

Juntou-se ao Grupo Península em junho de 2013 nas funções de Diretor de Operações e Compliance Officer, estando na O3 desde o início de suas atividades.

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

a. currículo, contendo as informações estabelecidas na ICVM 558

Walter André Vannini acumula a função da Gestão de Riscos.

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 informações estabelecidas na ICVM 558

Não aplicável.

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

a. quantidade de profissionais

Quantidade de profissionais: 28

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

- 1) Daniel Mathias Alves Pinto - Head Portfolio Manager, sua atuação é focada principalmente no mercado de moedas e outras transações fundamentadas em análise macroeconômica, bem como na supervisão de transações de private equity;
- 2) Bruno Ribeiro de Macedo - Portfolio Manager especialista em Real Estate;
- 3) Ricardo Jun Maeji - Portfolio Manager especialista em RV;
- 4) Eduardo Pongrácz Rossi - Diretor, atuando na área de Investimentos Líquidos (CIO);
- 5) Gustavo Tarifa Coelho - Analista especialista em ações;
- 6) Luiz Fernando Macedo - Trader;
- 7) Marcelo Lyra Gurgel do Amaral Filho - Analista Macroeconomia;
- 8) Flavia Buarque de Almeida - Diretora, atuando na área de private equity (CEO);
- 9) Laura Tourinho Jaguaribe - Diretora, atuando na área de private equity;
- 10) Stephanie Shao Ni NG - Analista de private equity;
- 11) Tuany Kaori Nakama - Analista private equity;
- 12) Gabriel Casella -- Analista private equity;
- 13) Michel Zaidler - Analista private equity;
- 14) Walter Andre Vannini – Diretor de compliance e gestão de riscos;
- 15) Daniel Barbosa Vaz- Portfolio Manager especialista em RV e Macro estratégia;
- 16) Marcelo Giovanetti D’Arienzo - Diretor, atuando na área de private equity;
- 17) Ligia Vidigal Vazsony - Analista de private equity;
- 18) Fabiana Du Plessis Lang - Analista de private equity;
- 19) Bernardo Brega - Analista de ações;
- 20) Matheus Soares Cardum - Analista de Real Estate;
- 21) Frederico Stein – Gerente de Backoffice e controles internos;
- 22) Paulo Parisi – Analista de backoffice e controles internos;
- 23) Vitor Santos - Analista de backoffice e controles internos;
- 24) Diego Leon - Analista de backoffice e controles internos;
- 25) Pedro Paulo Sant’Anna Pinheiro – Analista de private equity;
- 26) Joaquim Pedro Palhares de Albuquerque Sampaio – Analista de macroeconomia;
- 27) Rafael Correia das Neves – programador; e
- 28) Juliana Grossi Alonso – Diretora, atuando na área de Recursos Humanos.

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

A área de gestão de recursos utiliza principalmente a *Bloomberg* como ferramenta de análise, o Lote 45 que controla estoques, caixa e resultado em tempo real além das modelagens em planilha Excel.

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

Atualmente, possuímos 5 profissionais trabalhando na área de *compliance* e fiscalização da atividade e dos serviços prestados por terceiros.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Walter Andre Vannini – *Head of Operations* e *Compliance Officer*;
Frederico Stein – Gerente de *Backoffice* e Controles Internos;
Vitor Gaiovicz dos Santos - Assistente de *Backoffice* e Controles Internos;
Paulo Parisi – Analista Pleno de *Backoffice* e Controles Internos; e
Diego Leon - Analista Pleno de *Backoffice* e Controles Internos.

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

A área de *Backoffice* e Controles Internos utiliza principalmente o sistema Lote 45, além de suas próprias programações em planilha Excel. A área é responsável por conciliar diariamente as informações recebidas da Mesa de Operações vs. Contrapartes externas, além do espelhamento de cota de todos os fundos administrados. Além disso, acompanhamos diariamente todos os enquadramentos dos fundos para que a gestão esteja sempre dentro dos limites estabelecido em cada regulamento.

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

O *Head* de Operações e *Compliance* reporta diretamente aos sócios da O3 e não está subordinado diretamente a nenhum outro diretor da O3.

O Diretor de *Compliance* exerce suas atividades com independência e não se envolverá em funções relacionadas à administração de carteiras de valores mobiliários, à intermediação e distribuição ou à consultoria de valores mobiliários, ou em qualquer atividade que limite a sua independência, na O3 ou fora dela.

8.10. Informações sobre a estrutura de gestão de riscos

a. quantidade de profissionais

Atualmente, possuímos 2 profissionais trabalhando na área de gestão de riscos das nossas carteiras de valores mobiliários.

b. natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Walter Andre Vannini – *Head of Operations* e *Compliance Officer*, e
Frederico Stein – Gerente de *Backoffice* e Controles Internos.

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

Utilizamos o sistema de acompanhamento de Fundos Lote 45 que calcula o risco das carteiras tanto individualmente como de forma consolidada, atualizando em tempo real, as medidas de VaR Histórico; Paramétrico e Stress conforme as métricas da B3.

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

O Head de Operações, Compliance e Risco reporta diretamente aos sócios da O3.

8.11. Informações sobre a estrutura de das atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da estruturação de cotas

a. quantidade de profissionais

Não aplicável.

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

Não aplicável.

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

Não aplicável.

8.12. Informações sobre a área de distribuição de cotas de fundo

a. quantidade de profissionais

Atualmente, não temos profissionais trabalhando na área de distribuição de cotas de fundo.

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. Outras informações relevantes

Conforme mencionado no item 2.2. (c) acima, a O3 ainda divide determinadas áreas com a Península Participações S.A., tais como TI, jurídico, recursos humanos e contabilidade.

9. Remuneração da empresa

9.1. Principais formas de remuneração

As principais formas de remuneração são por meio de pagamento pelos fundos geridos de taxa de gestão, incluindo taxa de *performance*.

9.2. Receita de clientes decorrentes de taxas

100% das receitas de clientes decorrem de taxas.

a. taxas com bases fixas

A taxa de gestão cobrada é de: 0,26% a.a. a 1,00% a.a. de acordo com o cliente e produto. A taxa de gestão sempre é calculada em bases mensais sobre o patrimônio líquido dos fundos/carteiras.

b. taxas de performances

Somente no Península II FIP - Multiestratégia a O3 cobra taxa de performance de 15% HWM do excedente do índice IPCA acrescido de 9% a.a.

c. taxas de ingressos

Não aplicável.

d. taxas de saída

Não aplicável.

e. outras taxas

Não aplicável.

9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

Não há outras informações que julguemos relevantes em relação a esta seção 9.

10. Regras, procedimentos e controles internos

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

Não aplicável.

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

Uma avaliação adequada dos ativos dos clientes é fundamental para as operações da O3, uma vez que a avaliação pode afetar as decisões do portfólio, cálculos das taxas e desempenho informado.

A O3, na qualidade de gestora de fundos de investimento, está sujeita a custos de transação relacionados principalmente aos prestadores de serviços contratados para prestação de serviços relacionados aos serviços de gestão; aos custos de *spread* previstos nas operações que envolvem ativos de renda fixa; e aos custos de emolumentos relacionados às operações em mercados organizados.

Os custos relacionados à contratação de prestadores de serviços decorrem da necessidade de serviços legais, contábeis, de assessoria econômico-financeira, dentre outros. Neste sentido, a O3 buscará selecionar prestadores de serviços que atendam suas regras e procedimentos internos, e que sejam capazes de entregar um serviço de melhor qualidade, dentro do melhor preço.

Os custos decorrentes de *spread* previstos nas operações de renda fixa serão minimizados através de uma seleção ativa pelos membros da equipe de gestão, que buscarão negociar e adquirir ativos financeiros levando em conta tais custos de transação a serem incorridos.

Finalmente, os custos de emolumentos relacionados às operações em mercados organizados são monitorados quando da seleção e execução de transações sujeitas à registro e negociação nestas entidades. A fim de minimizar estes custos, a seleção de ativos pela O3 levará em conta estes custos a serem incorridos, bem como buscará selecionar o mercado organizado disponível para registro dos ativos levando em conta os custos de transação relacionados a esta escolha.

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

Os Colaboradores da O3 poderão aceitar presentes, refeições ou outros benefícios sem prévia autorização do Diretor de *Compliance* nos seguintes casos:

- (a) refeição, que não possua valor suficientemente alto a ponto de influenciar o bom desempenho das funções do Colaborador;
- (b) material publicitário ou promocional até um valor de R\$400,00 distribuídos no curso normal dos negócios;

(c) qualquer presente ou benefício com valor superior a R\$400,00 habitualmente oferecidos na ocasião de um aniversário ou outra ocasião semelhante, que não seja incomum;

(d) qualquer presente ou benefício com valor de até R\$ 400,00; e

(e) presente de família ou amigos não ligados com os deveres e responsabilidades profissionais.

Qualquer benefício ou presente não identificado no rol acima, somente poderá ser aceito pelo Colaborador mediante prévia autorização do Diretor de *Compliance*.

10.4. Descrição dos planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados

O Plano de Contingência da O3 prevê ações que durem até o retorno à situação normal de seu funcionamento dentro do contexto de seu negócio e identifica duas variáveis para o funcionamento adequado da empresa: (i) a Infraestrutura, que engloba todas as variáveis utilizadas para realização dos processos: energia, telecomunicações, informática e sistemas internos. Para cada um dos itens que compõem a infraestrutura existe uma ação a ser tomada e (ii) processos, que são as atividades realizadas para operar os negócios da O3. Os processos dependem da infraestrutura toda ou de parte da estrutura em funcionamento. Somente com os processos em andamento pode-se definir que o plano de ação foi bem executado.

Diariamente, sempre às 22:00 horas, todos os arquivos localizados na rede de arquivos da O3 são copiados, de maneira automática, para uma Unidade de Fita LTO.

A O3 possui 3 *notebooks* próprios, devidamente autorizados, e com acesso à Internet móvel para qualquer eventualidade além de 2 formas de conexão com Internet de banda-larga diferente: Nextel e Vivo. A O3 possui sistema de rede sem fio em todos os departamentos. O serviço de e-mail da O3 é garantido por parceiro que provém suporte 24/7, serviço de antispam, antivírus, recuperação de informação, site de recuperação de desastre e alertas relacionados ao vazamento de informações confidenciais e privilegiadas. A O3 utiliza ainda o OWA, que possibilita o acesso remoto de todas as mensagens pelos Colaboradores. A O3 conta com 2 operadoras de telefone. Em caso de falhas nas linhas telefônicas, os Colaboradores da O3 ainda possuem celulares que podem substituir a telefonia fixa.

As informações do portfólio além de estarem nos sistemas internos da O3 são disponibilizadas diariamente pelo administrador, que também informará qualquer movimentação no passivo dos fundos para adequação do caixa dos fundos. Em caso de falha de fornecimento de energia, a O3 possui nobreak para suportar o funcionamento de seus servidores, rede corporativa, telefonia e de outras quatro estações de trabalho (desktops) para a efetiva continuidade dos negócios. Em caso de efetiva necessidade de utilização da estrutura de contingência, deverão ser encaminhadas para o local de contingência as seguintes pessoas: um responsável pela gestão das carteiras, um *trader* e uma pessoa da equipe de *backoffice*. O serviço de e-mail da O3 é garantido por dispositivo de segurança *Sonic Wall* que executa funções de firewall no nível do roteador

e antivírus *Kaspersky*. Além disso, o firewall de software é ativado em cada computador individual na rede de escritório.

Com seus procedimentos de *back-up* externo e acesso remoto a e-mails, a O3 pode continuar a funcionar mesmo que não possa ter acesso físico ao escritório.

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

A Política de Gerenciamento de Risco de Liquidez da O3 observa o risco de liquidez a partir da possibilidade de uma operação da carteira de um Fundo não ser realizada por envolver um volume superior ao volume total do mercado.

A estratégia gerida pela O3 privilegia os investimentos em ativos e derivativos de maior liquidez, por exemplo, renda variável. O processo de construção da carteira penaliza a concentração em instrumentos menos líquidos, reduzindo assim a eventual alocação final em tais ativos e derivativos.

O controle da liquidez dos ativos inseridos nas carteiras dos Fundos é realizado diariamente com base média na de volume de negociação diária e comparado com o tamanho total dos ativos individuais. O tratamento dos ativos utilizados como margem, ajustes e garantias considera, no mínimo, os seguintes aspectos: liquidez dos ativos, participação de cada ativo na carteira dos Fundos e expectativa da O3 em relação à manutenção dos ativos em carteira.

O perfil do passivo de cada Fundo é composto, mas não se limitando, por encargos como despesas de corretagem, custódia, auditoria, consultoria legal, impostos, taxa de administração, entre outros, além de pagamento de resgates e compras de ativos. O perfil de resgates dos Fundos será medido de acordo com a média mensal dos últimos 12 (doze) meses.

O risco de liquidez pode ser majorado em situações especiais de iliquidez, relacionadas a fatores sistêmicos ou eventos específicos de cada ativo. A O3, nestas situações, manterá uma maior participação do patrimônio líquido de cada Fundo em ativos de maior liquidez e realizará, com a periodicidade necessária, o controle e o gerenciamento da liquidez de cada ativo.

O controle e gerenciamento da liquidez dos ativos inseridos nas carteiras dos Fundos é realizado através da elaboração de planilhas com periodicidade diária. A definição dos critérios e procedimentos de controle e gerenciamento de liquidez dos ativos inseridos nas carteiras dos Fundos, assim como a avaliação dos relatórios de risco desta natureza, é realizada pelo Diretor de *Compliance*.

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 do administrador na rede mundial

<http://o3capital.com.br>

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 aplicável, tendo em vista que não existem processos judiciais relevantes que a O3 seja parte.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável, tendo em vista que não existem processos judiciais relevantes que a O3 seja parte.

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 aplicável, tendo em vista que não existem processos judiciais nos quais a diretora responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários seja parte.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável, tendo em vista que não existem processos judiciais nos quais o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários da O3 seja parte.

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

Não aplicável, tendo em vista que a O3 não possui outras contingências relevantes.

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:

Não aplicável, tendo em vista que a O3 não possui condenações transitadas em julgado nos últimos 5 anos.

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 aplicável, tendo em vista que não existem condenações transitadas em julgado nos últimos 5 anos nos quais o Diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários seja parte.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não aplicável, tendo em vista que não existem condenações transitadas em julgado nos últimos 5 anos nos quais o Diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários seja parte.

12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração

O diretor responsável pela administração de carteira de valores mobiliários, acima qualificado, declara ainda:

- a.* Que não há 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, assim como não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos;
- b.* Que não há 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.* Que não há impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa;
- d.* Que não está incluído no cadastro de serviços de proteção ao crédito;
- e.* Que não está incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado; e
- f.* Que não tem contra si títulos levados a protesto.

Daniel Mathias Alves Pinto