



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

### Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 26.203.121/0001-24

Nome do Administrador de Carteira: WMR CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA.

Ano de competência: 2023

## 2. Histórico da empresa

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

Inicialmente registrada como consultoria de valores mobiliários em 18 de outubro de 2016, WMR CAPITAL, por meio da sua 1ª (primeira) alteração contratual, datada de 8 de março de 2018, foi transformada em administradora de carteira de valores mobiliários, na categoria gestora de recursos.

### 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

Trata-se de 1ª (primeira) alteração contratual da WMR CAPITAL, datada de 8 de março de 2018, a qual deliberou acerca de sua transformação em administradora de carteira de valores mobiliários, na categoria gestora de recursos.

#### b. Escopo das atividades

Gestão de carteira de valores mobiliários.

#### c. Recursos humanos e computacionais

Recursos Humanos: 5

Recursos Computacionais: Temos 1 DeskTop Acer (i7, HD 1000 GB, Ram 16 GB) e Utilizamos 6 computadores NoteBooks, sendo um para cada profissional e um de reserva (caso algum computador precise de manutenção). São: Acer (i7, HD 1000 GB, Ram 8 GB), Acer (i5, HD 1000 GB, Ram 6 GB), Lenovo (i5, HD 1000 GB, Ram 4 GB), 2 notebooks Samsung (i5, HD 1000, Ram 4 GB), Compaq (i3, HD 1000 GB, 4GB), Contamos com NoBreak 1200VA, Contratação da BELLRISK TECNOLOGIA E COMUN. LTDA para serviços de telefonia e gravação de voz, HD 1000 GB externo para Backup diário dos arquivos, impressora multifuncional, contratação de sistema de servidor da Google para o serviço de e-mails, contratação do Wix para o Site, contratação de serviços de internet de banda larga Virtua e Vivo.

#### d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos

A WMR CAPITAL possui a totalidade dos Manuais e Políticas exigidos nos termos da regulamentação aplicável, presente em sua respectiva página - [www.wmrcapital.com.br](http://www.wmrcapital.com.br) - na rede mundial de computadores: Código de Ética; Manual de Compliance; Política de Gestão de Risco; Política de Risco de Liquidez; Política de Investimentos Pessoais; Política de Confidencialidade e Política de Rateio de Ordens.

A WMR Capital segue os códigos Anbima de Administração de Recursos de Terceiros, Código de Ética, Código dos Processos de Regulação de Melhores Práticas e Código para o Programa de Certificação Continuada.

## 3. Recursos Humanos

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

#### a. Número de sócios:

2

#### b. Número de empregados:

3



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

### c. Número de terceirizados:

0

CPF	Nome
224.591.188-13	GABRIEL BACCI
147.436.608-23	VALDIR CARLOS DA SILVA JUNIOR

## 4. Auditores

Observação: A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.

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

Nome empresarial	Data da contratação	Descrição
------------------	---------------------	-----------

## 5. Resiliência Financeira

### 5.1. Com base nas demonstrações financeiras, 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**

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)**

Não

**5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução (A apresentação destas demonstrações financeiras e deste relatório é obrigatória apenas para o administrador registrado na categoria Administrador Fiduciário, subcategoria Capital Mínimo, de acordo com o inciso II do § 2º do art. 1º.):)**

Demonstração Financeira: Não se aplica

Relatório: Não se aplica

## 6. Escopo das Atividades

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

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



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Gestão de carteira de valores mobiliários, por meio da gestão discricionária de carteira de fundos de investimentos multimercados e demais modalidades previstas na Instrução CVM nº 555, conforme alterada, e/ou de carteiras administradas.

**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.)**

Fundos de investimentos multimercados e demais modalidades previstas na Instrução CVM nº 555, conforme alterada, e/ou de carteiras administradas.

**c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão**

Conforme a política de investimentos prevista nos Regulamentos dos Fundos de investimentos multimercados e demais modalidades previstas na Instrução CVM nº 555, conforme alterada, e/ou de carteiras administradas.

**d. Se atua na distribuição de cotas de fundos de investimentos 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**

Não Aplicável

**b. Informações sobre as atividades exercidas por sociedades controladoras, controladas, coligadas e sob controle comum ao administrador e os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades**

Não Aplicável

**6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundo e carteiras administradas geridas pela empresa, fornecendo as seguintes informações**

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
a. Número de investidores	43	73	116



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

b. Número de investidores, dividido por:	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	41	73	114
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	0	0	0
iii. Instituições Financeiras	0		0
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0		0
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	0		0
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	0	0	0
vii. Seguradoras	0		0
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	0		0
ix. Clubes de Investimento	0	0	0
x. Fundos de Investimento	2		2
xi. Investidores não Residentes	0		0

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
	0	0	0

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	43	73	116

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 158.715.928,03	R\$ 0,00	R\$ 195.569.663,40

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

R\$ 0,00

**e. Recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes) Caso deseje identificar o cliente, informe o nome após o valor dos recursos, utilizando o caracter ";" como separador**



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Valor	Nome
R\$ 16.483.821,25	
R\$ 6.593.950,40	
R\$ 6.031.980,38	
R\$ 4.907.786,44	
R\$ 4.591.835,12	
R\$ 3.229.613,72	
R\$ 3.027.427,78	
R\$ 2.705.294,56	
R\$ 2.559.859,14	
R\$ 2.521.393,61	

### f. Recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	R\$ 101.676.571,96	R\$ 36.853.735,37	R\$ 138.530.307,33
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
iii. Instituições Financeiras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
vii. Seguradoras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	R\$ 0,00		R\$ 0,00
ix. Clubes de Investimento	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
x. Fundos de Investimento	R\$ 57.039.356,07		R\$ 57.039.356,07
xi. Investidores não Residentes	R\$ 0,00		R\$ 0,00

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
-------------	---	---	-------

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 158.715.928,03	R\$ 0,00	R\$ 195.569.663,40

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



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

a. Ações	R\$ 9.493.228,94
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R\$ 178.733,91
c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R\$ 53.973.656,96
d. Cotas de fundos de investimento em ações	R\$ 35.481,66
e. Cotas de fundos de investimento em participações	R\$ 295.000,00
f. Cotas de fundos de investimento imobiliário	R\$ 0,00
g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R\$ 0,00
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 20.997.143,26
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 110.506.337,55
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 12.951,00
k. Outros valores mobiliários	R\$ 71.000,00
l. Títulos públicos	R\$ 6.130,12
m. Outros ativos	R\$ 0,00
Total	R\$ 195.569.663,40

### 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

CPF/CNPJ	Nome
26.203.121/0001-24	WMR CAPITAL GESTORA DE RECURSOS LTDA

#### b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
-	Não Informado

#### c. Participações da empresa em sociedade do grupo

CNPJ	Nome
-	Não Informado

#### d. Participações de sociedades do grupo na empresa

CNPJ	Nome
-	Não Informado

#### e. Sociedades sob controle comum



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

CNPJ	Nome
-	Não Informado

### 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 7.1.

Nenhum arquivo selecionado.

## 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

Gestão: Responsável pela definição, seleção e implementação das estratégias, selecionando os ativos que integrarão a carteira dos fundos de investimento. Risco e Compliance: Avaliação dos ativos negociados pela área de Gestão, se estão de acordo com o regulamento dos fundos, a legislação vigente e o mandato estabelecido para cada operador. Esse departamento fará o controle interno, verificando se as políticas e os procedimentos estão sendo respeitados pelos colaboradores. Análise Ativos Mobiliários: Elabora estudos, relatórios para utilização exclusiva do Departamento de Gestão; (i) a elaboração de estudos e análises de valores mobiliários destinados a embasar as decisões de investimento a serem tomadas pela WMR CAPITAL; (ii) a manutenção de relacionamento com os administradores dos fundos de investimento, para o desempenho de atividades relativas a, mas não se limitando à (a) conferência diária das carteiras relativamente à compra e venda de valores mobiliários; (b) conferência diária da evolução do valor das cotas dos fundos de investimento; (c) conferência diária da evolução do benchmark dos fundos; e (d) conferência diária do cômputo das taxas de administração e performance; (iii) acompanhamento dos trâmites de documentação (a) de constituição de novos fundos de investimento; e (b) de assembleias de cotistas, entre outras; (iv) a preparação de (a) cálculos e planilhas para embasamento de decisões de investimento; (b) cálculos de correlação entre preços de valores mobiliários; e (c) planilhas de sensibilidade de preços de derivativos a variações nos preços dos ativos base, dentre outros; e (v) a realização, dentre outras pesquisas necessárias, daquelas que objetivem (a) o levantamento de séries históricas de preços de valores mobiliários; e (b) a busca e compilação em tabelas de dados macro-econômicos domésticos e internacionais.

#### 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

A Sociedade é composta por 4 (quatro) Diretorias: a) Diretoria de Investimentos, responsável pela administração de recursos de carteira e valores mobiliários de terceiros; b) Diretoria de Compliance, responsável pelo cumprimento dos manuais, normas, regras de conduta, controles internos e regulamentação e legislação aplicáveis; c) Diretoria de Risco, responsável pelo monitoramento, mensuração e ajuste permanentes dos riscos inerentes a cada uma das carteiras de valores mobiliários que administre; e d) Diretoria de Prevenção da Lavagem de Dinheiro, responsável pela aplicação das regras que dispõem sobre a identificação, o cadastro, o registro, as operações, a comunicação, os limites e a responsabilidade administrativa referentes aos crimes de "lavagem" ou ocultação de bens, direitos e valores.

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

Nenhum arquivo selecionado

### 8.3. Em relação a cada um dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar:

CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos
-----	------	-------	-----------	-------	---------------	------------------	---------------

### 8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, indicar:



### COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	224.591.188-13	GABRIEL BACCI	35	GESTOR FINANCEIRO	DIRETOR DE INVESTIMENTOS	06/08/2018	INDETERMINADO	DIRETOR DE INVESTIMENTOS	- Pós-Graduado em Mercados Financeiros e de Capitais, pelas Faculdades Metropolitanas Unidas, em 2009. - Formado em Gestão Financeiras, pela Universidade Anhembi Morumbi, em 2016.	- Detentor do CGA/Anbima





### COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

8.5 (COMPLI ANCE)	147.436.6 08-23	VALDIR CARLOS DA SILVA JR.	45	ADMINI STRADO R DE EMPRES AS	DIRETO R DE COMPLI ANCE	06/08/201 8	INDETE RMINAD O	DIRETO R DE RISCO E PLDFT	Pós- Graduado em Economia Brasileira para Negócios pela USP - Universid ade de São Paulo, em 2016. - Pós- Graduado em Mercados Financeir os e de Capitais, pela Universid ade Nove de Julho, em 2015. - Formado em Administ ração de Empresas, pela FICS - Faculdade s Integradas Campos Salles, em 2001.	- Detentor do CGA/Anb ima. - Detentor do CNPI - Certificad o Nacional de Profission al de Investime ntos. - Detentor do CFP - Certified Financial Planner. - Detentor de SUSEP.
-------------------------	--------------------	--	----	--	----------------------------------	----------------	-----------------------	------------------------------------	--	---



### COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

8.6 (GESTÃO DE RISCO)	147.436.608-23	VALDIR CARLOS DA SILVA JR.	45	ADMINISTRADOR DE EMPRESAS	DIRETOR DE RISCO	06/08/2018	INDETERMINADO	DIRETOR DE COMPLIANCE	Pós-Graduado em Economia Brasileira para Negócios pela USP - Universidade de São Paulo, em 2016. - Pós-Graduado em Mercados Financeiros e de Capitais, pela Universidade Nove de Julho, em 2015. - Formado em Administração de Empresas, pela FICS - Faculdades Integradas Campos Salles, em 2001.	- Detentor do CGA/Anbima. - Detentor do CNPI - Certificado Nacional de Profissional de Investimentos. - Detentor do CFP - Certified Financial Planner. - Detentor de SUSEP.
--------------------------	----------------	----------------------------	----	---------------------------	------------------	------------	---------------	-----------------------	--	--

**8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, fornecer principais experiências profissionais durante os últimos cinco anos, indicando:**



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída
224.591.188-13	GABRIEL BACCI	WMR CAPITAL CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA	Diretor Estatutário de Suitability	CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS	01/10/2016	01/03/2018
224.591.188-13	GABRIEL BACCI	INDEX PREST DE SERV ADMINISTRATIVOS	PLANEJADOR FINANCEIRO	Elaboração de valuation, estudos setoriais da economia brasileira, contato com R.I e participação de reunião de apresentação de resultados de empresas, coletando informações, elaboração de plano de negócios	01/01/2012	01/10/2016
147.436.608-23	VALDIR CARLOS DA SILVA JR.	WMR CAPITAL CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS	DIRETOR DA CONSULTORIA	CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS	01/10/2016	01/08/2018
147.436.608-23	VALDIR CARLOS DA SILVA JR.	AUTONOMO	Consultor de Valores Mobiliários Independente, desde outubro de 2012, Planejador Financeiro Independente (CPF), desde setembro de 2012, e Analista (CNPI) Independente, desde julho de 2012	CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS E PLANEJAMENTO FINANCEIRO	01/01/2012	01/12/2016

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

#### a. Quantidade de profissionais

2

#### b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

O departamento técnico da WMR CAPITAL se encarregará da tarefa de alocação dos investimentos nas diversas carteiras de investimentos sob gestão, analisando os diversos valores mobiliários e ativos no âmbito do escopo das políticas de investimentos que a WMR CAPITAL opera, utilizando-se para tanto de planilhas e modelos de precificação.



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

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

Para a atividade de gestão de recursos, a WMR CAPITAL se utilizará de sistemas próprios de gestão, desenvolvidos internamente, composto por um conjunto de planilhas, seguindo a Instrução CVM 555, de forma a saber em tempo real as medidas de desempenho e risco do fundo e do benchmark nos prazos:

?A partir do início

?Em 12 meses

?No ano corrente

?No mês

?Em relação ao dia anterior

?Treydor

?Sharpe

?Modigliani (M<sup>2</sup>)

?Information Ratio (IR)

?Var Paramétrico 95%

?ETL (Expected Tail Loss) do fundo

?Desvio Padrão

?P.L. do fundo

?P.L. alavancado do fundo

?Duration

?Duration alavancado

?Risco X Retorno dos ativos que compõe o patrimônio líquido do fundo no momento

?Gráfico de dispersão dos resultados diários

?Gráfico de Sino da probabilidade de ocorrência de retornos diários

?Gráfico de desempenho do fundo comparado com gráfico do benchmark ou outro índice que desejar, podendo alterar o intervalo de datas de consulta

?Gráfico da volatilidade anualizada

?Gráfico do fundo menos benchmark

?Gráfico do fundo pelo benchmark

?Gráfico de contribuição de cada ativo para o resultado do fundo, no intervalo de datas selecionada

?Carteira do fundo no momento e qual é desempenho em relação ao dia anterior de cada ativo

?Gráfico de contribuição de cada ativo para o resultado do fundo no dia, no intervalo de datas selecionada

?Gráfico de participação percentual no total do patrimônio do fundo

Os sistemas de informação para consulta e auxílio em tomada de decisões serão o Enfoque e o ComDinheiro que fornecerão dados em forma de gráficos e históricos de P/L e Ebitda, dentre outros, por meio dos quais as carteiras de investimentos serão atualizadas, benchmarks serão comparados, taxas serão cotadas e tendências serão analisadas. Tais planilhas serão reproduzidas mensalmente e serão objeto de reunião mensal a ser efetuada entre o Diretor de Investimentos e o analista interno de investimentos, cujos respectivos termos serão sumarizados em atas objeto de arquivamento na WMR CAPITAL.

### **8.9. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentadores aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:**

#### **a. Quantidade de profissionais**

3

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

Será atribuição da Diretoria de Compliance a verificação permanente do atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade da WMR CAPITAL.

Caberá à Diretoria de Compliance da WMR CAPITAL o desempenho das seguintes funções: (i) validar todas as políticas, rotinas e procedimentos vigentes na WMR CAPITAL, adequando-os, quando necessário, às normas e instruções dos órgãos reguladores; (ii) elaborar e implementar o programa de treinamento dos colaboradores da WMR CAPITAL; (iii) assegurar o controle de informações confidenciais; (iv) assegurar a existência de testes periódicos de segurança para os sistemas de informações; (v) monitorar o cumprimento, por todos os colaboradores, das políticas da WMR CAPITAL, bem como as leis e normas vigentes; (v) identificar, administrar e eliminar eventuais conflitos de interesse; e (vi) conduzir a avaliação dos casos em que forem constatados indícios de descumprimento das políticas e normas legais, assim como aplicar as sanções cabíveis; dentre outras.

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



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

O Diretor de Compliance deverá encaminhar às Diretorias integrantes da WMR CAPITAL, até o último dia útil do mês de janeiro de cada ano, relatório relativo ao ano civil imediatamente anterior à data de entrega, contendo: (i) as conclusões dos exames efetuados; (ii) as recomendações a respeito de eventuais deficiências, com o estabelecimento de cronogramas de saneamento, quando for o caso; e (iii) a manifestação do Diretor de Investimentos ou, quando for o caso, pelo Diretor de Risco a respeito das deficiências encontradas em verificações anteriores e das medidas planejadas, de acordo com cronograma específico, ou efetivamente adotadas para saná-las. Referido relatório deve ficar disponível para a CVM na sede da WMR CAPITAL, por um período mínimo de 5 (cinco) anos contado da sua respectiva emissão. Compõem o sistema de compliance da WMR CAPITAL, desenvolvidos por esta asset, os seguintes Procedimentos Operacionais - POPs: (i) Auditoria Mensal de Conformidade com o Termo de Adesão ao Manual de Compliance; (ii) Auditoria Mensal de Verificação de Treinamento de Combate e Prevenção à Lavagem de Dinheiro; (iii) Cadastro e Revisão de Dados e Documentação de Clientes; (iv) KYC - Know Your Client (Conheça seu Cliente); (v) Auditoria Mensal de Verificação de Documentos de RH; e (vi) Reunião Mensal de Auditoria de Itens do Manual de Compliance. Mensalmente, serão realizadas reuniões entre o Diretor de Compliance e o analista de compliance, cujos respectivos termos serão sumarizados em atas objeto de arquivamento na WMR CAPITAL.

Como parte desse sistema a WMR Capital conta com os serviços da GROWTH® Assessoria em Compliance.

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

O Diretor de Compliance exercerá as suas funções com independência, possuindo acesso total aos processos que envolvem a gestão das carteiras, e não poderá atuar 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 WMR CAPITAL ou fora dela.

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

### **a. Quantidade de profissionais \***

3

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

Serão atribuições da Diretoria de Risco o acompanhamento das carteiras no que tange às respectivas políticas de investimento e os fatores de risco.

Caberá à Diretoria de Risco da WMR CAPITAL o desempenho das seguintes funções: (i) monitorar, por meio da depuração de dados dos emissores e dados de mercado, os riscos de crédito, preço, liquidez, concentração, contraparte e operacional das carteiras que gerencia; (ii) elaborar relatórios de preço, liquidez e demais parâmetros, com base em testes quantitativos; (iii) em caso de resultados verificados fora dos parâmetros determinados, desenquadramentos e riscos excessivos, endereçar alertas para à Diretoria de Investimentos e demais Diretorias da WMR CAPITAL.

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



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

A WMR CAPITAL se utilizará de sistemas próprios de risco, desenvolvidos internamente, composto por um conjunto de planilhas, seguindo a Instrução CVM 555, de forma a saber em tempo real as seguintes informações:

?VaR Paramétrico fundo 95%

?ETL (Expected Tail Loss) do fundo

?Desvio padrão do fundo

?Desvio padrão do benchmark

?P.L. do fundo

?P.L. do fundo alavancado

?Duration

?Duration alavancado

?Modified duration

?Modified duration alavancado

?Para cada classe de ativo:

oPosição,

oVaR Paramétrico 95%,

oETL (Expected Tail Loss),

oVaR 95% do benchmark da respectiva posição,

oDuration

?Teste de Stress, em 4 cenários:

oChoque de -1% na Pré

oChoque de -1% Ibov

oChoque de -1% no Dólar

oChoque de -1% no principal fator de risco

Tais planilhas serão verificadas diariamente e reavaliadas mensalmente, sendo objeto de reunião mensal a ser efetuada entre o Diretor de Risco e o analista de risco, cujos respectivos termos serão sumarizados em atas objeto de arquivamento na WMR CAPITAL.

Como parte desse sistema é utilizado o sistema ComDinheiro para a emissão de relatórios.

Para a PLDFT é utilizado o sistema Data Engine da Cedrotech.

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

O Diretor de Risco exercerá as suas funções com independência, possuindo acesso total aos processos que envolvem a gestão das carteiras, e não poderá atuar 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 WMR CAPITAL ou fora dela.

### **8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, de controle e de processamento de ativos e da escrituração da emissão e resgate de cotas, incluindo:**

#### **a. Quantidade de profissionais**

0

#### **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 atividades**

NÃO APLICÁVEL

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

#### **a. Quantidade de profissionais**

0



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

### **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, programas 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 2.1. do anexo 15-I, indicar as principais formas de remuneração que pratica:**

TAXA DE GESTÃO FIXAS

### **9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total aferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente dos clientes, durante o mesmo período, em decorrência de:**

#### **a. Taxa com bases fixas (%):**

100,00

#### **b. Taxa de performance (%):**

0,00

#### **c. Taxa de ingresso (%):**

0,00

#### **d. Taxa de saída (%):**

0,00

#### **e. Outras taxas (%):**

0,00

#### **Total (%):**

100,00

### **9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:**

## **10. Regras Procedimentos e Controles Internos**





## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

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

i) O agente prestador dos serviços de administração, escrituração e custódia dos fundos e dos investimentos deverá ser selecionado utilizando-se, no mínimo, os seguintes critérios: expertise comprovada em carteira de clientes no Brasil; posição no ranking ANBIMA; avaliação de reais ou potenciais conflitos de interesses entre os serviços de administração e de custódia dos ativos da WMR CAPITAL; clareza nas informações prestadas em relatórios gerenciais de risco e enquadramento; cumprimento de prazos; e custo dos serviços; (ii) como pré-qualificação para administrar as carteiras dos fundos, o candidato deverá possuir um patrimônio compatível com sua atividade bem como estar devidamente autorizado pela CVM e, especificamente, quanto a fundos de ações e multimercado, o candidato deverá administrar outros fundos similares no mercado brasileiro com histórico de cotas mínimo de 36 (trinta e seis) meses; e (iii) ao se avaliar a melhor execução, o Diretor de Investimentos deverá considerar toda a oferta de serviços da corretora avaliada, incluindo, entre outras coisas, a capacidade de execução da ordem, a qualidade dos departamentos de análises, a corretagem cobrada e a solidez financeira da instituição, sendo, ainda, características necessárias, para efeito de aprovação das corretoras, a expertise operacional, a infra estrutura operacional, e os relatórios de research.

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

A WMR CAPITAL acompanhará o mercado dos principais prestadores de serviço, monitorará as diversas opções para avaliar quais oferecem o menor custo para os volumes transacionados pela nossa gestão e revisará permanentemente estes valores, de forma a reduzir os custos de transação.

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

Os Colaboradores obrigam-se a reportar aos Diretores da Gestora caso recebam qualquer presente ou brinde em razão da posição ocupada por este na mesma, inclusive de clientes, fornecedores ou prestadores de serviços. Caso referidos brindes ou presentes tenham valor superior a R\$100,00 (cem reais), os Diretores da Gestora decidirão acerca da destinação do brinde ou presente, podendo a Diretoria, a seu exclusivo critério, dar a destinação que julgar adequada a referido brinde ou presente, inclusive a sua devolução ou distribuição ou sorteio entre todos os Colaboradores.

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

A WMR CAPITAL (i) conta com sistema de back-up, dotado de periodicidade diária, semanal e mensal, por meio do qual será realizado o processamento de cópias de seus respectivos sistema de dados e das ligações telefônicas efetuadas no desempenho da atividade de administração de recursos de terceiros; (ii) possui ainda um HD removível, que será diariamente armazenado em um local seguro e externo ao escritório; (iii) desenvolveu planos de contingência para efeito de gerenciamento de situações de crise, de forma a garantir a continuidade de seus negócios, até a sua completa superação; (iv) caso ocorra algum evento extraordinário que impossibilite a utilização de suas instalações e estrutura físicas, continuará as suas atividades em um escritório remoto, situado próximo a sua sede e que poderá ser utilizado em caso de contingências; (v) manterá telefones, computadores e impressoras adicionais para fins de substituição; (vi) trabalha com dois servidores de banda-larga, um com tecnologia via cabo (cable modem) e outro via telefone (DSL); e (vii) contratou uma empresa prestadora de serviços especializados quanto à realização de suporte técnico nas áreas de telefonia e informática, a qual será acionada sempre que necessário. e conta com um Plano de negócios desenvolvido dentro das melhores práticas da Anbima.

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





## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

São considerados ativos de liquidez imediata: (i) fundos DI; (ii) títulos públicos; (iii) operações compromissadas com liquidez diária; e (iv) ativos de crédito de instituições financeiras com garantia de recompra.

Margem de segurança ao risco de liquidez é o percentual do PL do fundo alocado em ativos de liquidez imediata. Este percentual é reavaliado diariamente pelo gestor baseado na previsão de fluxos de caixa futuros.

Todos os fundos da WMR CAPITAL possuem planilhas de controle dos fluxos de caixa futuros que contemplam: (i) aplicações de cotistas; (ii) resgates de cotistas; (iii) liquidação de ativos financeiros; (iv) despesas operacionais dos fundos; e (v) expectativa de come-cotas.

Com base nestas planilhas, é definido pelo gestor o volume máximo que pode ser alocado em ativos financeiros e quanto deve permanecer em ativos líquidos para cobrir os fluxos de caixa estimados para os próximos 30 dias, com margem de segurança. Como os fundos WMR CAPITAL não operam em mercados futuros, não há risco de chamadas de margem.

No caso da previsão indicar falta de liquidez para o cumprimento do pagamento dos próximos 30 dias, o gestor inicia imediatamente a venda de ativos não considerados de liquidez imediata.

Situações limites podem levar o gestor a liquidar os ativos do fundo a preços depreciados para fazer frente a obrigações, influenciando negativamente o patrimônio líquido do fundo. Outras alternativas são o fechamento do fundo para resgates ou o resgate via entrega de ativos do fundo ao cotista.

E conta plano dentro das melhores práticas Anbima

### **10.6. Descrever as políticas, as práticas e 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**

[www.wmrcapital.com.br](http://www.wmrcapital.com.br)

## **11. Contingências**

Importante: Não é necessário avaliação do administrador a respeito da chance de perda ou do valor que acredita ser efetivamente devedor em caso de eventual condenação.

### **11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, e sejam relevantes para seu patrimônio pessoal, incluindo:**

#### **a. Principais fatos \***

Não Aplicável, pois a WMR CAPITAL não é sujeito passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

#### **b. Valores, bens ou direitos envolvidos**

Não Aplicável, pois a WMR CAPITAL não é sujeito passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

### **11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteira de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem o seus negócios ou sua reputação profissional, incluindo:**

#### **a. Principais fatos**

Não Aplicável, pois a WMR CAPITAL não é sujeito passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

#### **b. Valores, bens ou direitos envolvidos**

Não Aplicável, pois a WMR CAPITAL não é sujeito passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

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

Não Aplicável, pois a WMR CAPITAL não é sujeito passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

**11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas no últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que tenha figurado no polo passivo, indicando:**

**a. Principais fatos**

Não Aplicável, pois a WMR CAPITAL não é sujeito passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

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

Não Aplicável, pois a WMR CAPITAL não é sujeito passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

**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, pois a WMR CAPITAL não é sujeito passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

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

Não Aplicável, pois a WMR CAPITAL não é sujeito passivo de quaisquer processos judiciais, administrativos ou arbitrais.

## 12. Declarações

**Declaração do administrador, atestando:**

**Que reviu o formulário de referência**

Mercado

**Que o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo de seus negócios (PF) ou da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa (PJ)**

Mercado

**Declarações adicionais do administrador, informando sobre**

**Acusações decorrentes de processos administrativos, bem como punições sofridas, nos últimos 5 (cinco) anos, em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, Banco Central do Brasil, Superintendência de Seguros Privados - SUSEP ou da Superintendência Nacional de Previdência Complementar - PREVIC, incluindo que não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos**

**Nada a declarar**

Mercado



## COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

**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**

**Nada a declarar**

Mercado

**Impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa**

**Nada a declarar**

Mercado

**Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito**

**Nada a declarar**

Mercado

**Inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado**

**Nada a declarar**

Mercado

**Títulos contra si levados a protesto**

**Nada a declarar**

Mercado

Data de envio: 20/03/2023 - 11:51:00

Data de impressão: 18/03/2024

Hora de impressão: 12:39:53