Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 10.290.382/0001-99
Nome do Administrador de Carteira: NEBRASKA CAPITAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA
Ano de competência: 2022

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

Em 2005, os sócios Rafael Sá e Leonardo Fração, iniciaram as atividades de um clube de investimento para administrarem seus próprios recursos. Assim, buscando uma maior profissionalização, os sócios constituíram um agente autônomo para a distribuição de fundos geridos por terceiros.
Em 2008 juntaram-se os atuais sócios os Srs. Gabriel Barbosa e Bruno Claudino para trabalharem como agentes autônomos, constituindo a SWG Agentes Autônomos.
Com a crescente demanda nas atividades, surgiu a necessidade de abrir uma gestora para que fosse possível gerir recursos de terceiros. Assim, entrou na sociedade o Sr. Astir Brasil, a fim de atuar na gestão profissional de recursos de terceiros.
Posteriormente, ingressou na sociedade o Sr. Guilherme Partel para atuar na área de análise. Em 25 de fevereiro de 2015, o sr. Astir brasil Santos e Silva deixou a empresa e o Sr. Gabriel Rodrigues Barbosa assumiu diretamente a atividade de gestão de recursos de terceiros. Em 02/04/2020 o Sr. Guilherme Partel deixou a sociedade. Em 2020 nos tornamos aderentes ao código de FIP na ABVCAP/ANBIMA. Em 19 de Julho de 2021, o sr. Gabriel Rodrigues Barbosa deixou o cargo de Diretor de Gestão e Distribuição e o Sr. Bruno Otavio Claudino dos Santos assumiu diretamente a atividade de gestão de recursos de terceiros, distribuição e suitability. Sr. Luiz Leonardo Fração acumulou a diretoria de Gestão de Risco. Em outubro de 2021, a Nebraska incluiu no escopo de suas atividades o serviço de gestão de patrimônio, sendo certo que o Sr. Bruno Otavio Claudino dos Santos assumiu a Diretoria de Gestão de Patrimônio. No mês de Agosto de 2023 o sr. Mauro Barcellos entrou na sociedade.

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

Entrada dos sócios Gabriel Rodrigues Barbosa, Bruno Otávio Claudino, Astir Brasil Santos E Silva e Guilherme Partel. Por último, saída do sócio Astir Brasil Santos e Silva e Guilherme Partel. Sr. Bruno Otavio Claudino dos Santos assumiu diretamente a atividade de gestão de recursos de terceiros, distribuição e suitability. Em 2021, houve alteração no Contrato Social para a inclusão da atividade de Gestão de Patrimônio, bem como delegação desta Diretoria ao Sr. Bruno Otavio Claudino dos Santos. Ademais, o nome da empresa foi alterado de Value Assessoria e Participações LTDA para Nebraska Capital Gestão de Recursos LTDA. No mês de Agosto de 2023 o sr. Mauro Barcellos entrou na sociedade.

b.Escopo das atividades

Em 2019 a empresa incluiu a possibilidade da distribuição de fundos de investimentos. Em 2021, a empresa incluiu a possibilidade de exercer a atividade de Gestão de Patrimônio.

c. Recursos humanos e computacionais

A empresa partiu de 2 sócios para 9 sócios atualmente. Em termos computacionais a empresa acompanhou a evolução tecnológica, com base de dados em nuvem, sistema de firewall, e aquisição de computadores mais modernos.

d.Regras, políticas, procedimentos e controles internos

Em Agosto/2019 houve a alteração e melhoria dos manuais e políticas da Gestora, a fim de implementar as melhores práticas de mercado e controle. Em outubro/2021, houve a atualização normativa, realização de melhorias e inclusão de disposições sobre a atividade de Gestão de Patrimônio, quando aplicável, aos manuais e políticas da Nebraska Capital, bem como elaboração da Política de Adequação dos Investimentos ao Perfil do Investidor, documento próprio para o exercício da atividade de Gestão de Patrimônio.

3. Recursos Humanos

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

a. Número de sócios:
9

b. Número de empregados:
2

c. Número de terceirizados:
0

CPF	Nome
954.347.390-00	GABRIEL RODRIGUES BARBOSA
004.495.610-03	BRUNO OTÁVIO CLAUDINO DOS SANTOS
761.135.230-04	RAFAEL TADDEI SÁ

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 destra 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.)

A Nebraska Capital tem por objeto o exercício profissional da atividade de (i) administração de carteiras de valores mobiliários na categoria "gestor de recursos", incluindo a aplicação de recursos financeiros no mercado de valores mobiliários por meio de fundos de investimentos sob sua gestão e a proteção e defesa dos direitos e interesses dos investidores em operações financeiras, na qualidade de gestor; (ii) gestão patrimonial

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.)

A Nebraska Capital desenvolve os serviços de administração de carteiras de valores mobiliários na categoria "gestor de recursos", para fundos de investimento regulados pela Instrução CVM nº 555 e a gestão de fundos de investimento em participação. Além desses produtos, a Nebraska Capital iniciou a gestão patrimonial de valores mobiliários e carteiras administradas.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

A Nebraska Capital foca seus esforços na gestão de fundos de investimentos regulados pela Instrução CVM nº 555, também gere fundos de investimentos em participação e carteiras administradas
A Nebraska Capital atua como distribuidor de fundos geridos pela própria Nebraska Capital, nos termos da Resolução CVM nº 21/2021.

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

Sim

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

O objeto social da Nebraska Capital prevê além do exercício da atividade de administração de carteiras, a atividade de distribuição de cotas de fundos de investimentos de seus próprios fundos. Entendemos que estas atividades listadas são complementares e não há conflito de interesses. Não obstante, em caso de qualquer situação que configure, possa configurar ou enseje conflito de interesses, a mesma será tratada na forma prevista nos manuais e políticas da Nebraska Capital.

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 Nebraska Capital é uma empresa independente não ligada a nenhum grupo econômico. Não há sociedades controladas ou sob controle comum.

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	90	0	90

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	80	0	80
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	5	0	5
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	5		5
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	90	0	90

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R$ 952.261.151,24	R$ 0,00	R$ 952.261.151,24

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

R$ 72.931.902,22

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

Valor	Nome
R$ 78.202.906,74	
R$ 78.186.772,83	
R$ 78.183.794,05	
R$ 69.418.330,51	
R$ 67.062.527,18	
R$ 53.048.369,10	
R$ 51.040.700,11	
R$ 48.361.048,92	
R$ 48.250.678,48	

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$ 882.743.903,33	R$ 0,00	R$ 882.743.903,33
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R$ 20.408.625,32	R$ 0,00	R$ 20.408.625,32
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$ 49.108.622,59		R$ 49.108.622,59
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
	R$ 0,00	R$ 0,00	R$ 0,00

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R$ 952.261.151,24	R$ 0,00	R$ 952.261.151,24

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

a. Ações	R$ 421.719.478,55
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R$ 0,00
c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R$ 0,00
d. Cotas de fundos de investimento em ações	R$ 79.729.318,15
e. Cotas de fundos de investimento em participações	R$ 79.138.548,27
f. Cotas de fundos de investimento imobiliário	R$ 0,00
g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R$ 13.177.775,93
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R$ 103.369.274,33
i. Cotas de outros fundos de investimento	R$ 228.441.895,84
j. Derivativos (valor de mercado)	R$ 0,00
k. Outros valores mobiliários	R$ 0,00
l. Títulos públicos	R$ 30.759.395,59
m. Outros ativos	R$ -4.074.535,43
Total	R$ 952.261.151,23

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

N/A. A Nebraska Capital não exerce atividade de administração fiduciária.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não há outras informações que a empresa julgue relevante.

7. Grupo Econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
10.290.382/0001-99	NEBRASKA CAPITAL

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

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

Departamento Técnico: O departamento técnico da Nebraska Capital é composto pelo Diretor de Gestão e por analistas responsáveis pela análise de empresas e indicadores financeiros, research, análise de investimentos, modelagem financeiro-econômica, análise de projetos imobiliários sob o ponto de vista econômico-financeiro, suporte ao Diretor de Gestão na tomada de decisões relacionadas aos fundos sob gestão, e contato com outros players de mercado relacionados à área, suporte ao Diretor de Gestão na tomada de decisão dos investimentos relacionados à crédito.

Comitê de Gestão: Instância que analisa as condições do mercado, cenários econômicos, acompanhamento de empresas, apresentação das avaliações financeiras das empresas; alocação de recursos e elaboração de estratégias dos portfolios. Decisões e comentários são registrados em Atas; bem como análise do cenário econômico, indicadores de mercado, índices de retornos de renda fixa, renda variável, crédito.

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

Comitê de Gestão: São feitas reuniões semanais no comitê de gestão para a análise e tomada de decisão de investimentos, sendo lavradas atas mensalmente acerca das deliberações e análises realizadas nas reuniões do mês de competência. Além disso é realizada uma planilha para controle das análises e acompanhamento das mesmas.

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

Diretor de Gestão: responsabilidade pela administração de carteiras de valores mobiliários, nos termos do art. 4º, III, da Resolução CVM nº 21/2021, estando devidamente autorizado para tanto, nos termos do Ato Declaratório CVM nº 15.419, de 27 de dezembro de 2016, e pela prestação de consultoria de valores mobiliários, nos termos do artigo 4º §2º da Resolução CVM nº 21/2021.

Diretor de Compliance: responsável pelo cumprimento das regras, políticas, procedimentos e controles internos, nos termos do art. 4º, IV, da Resolução CVM nº 21/2021 e pela gestão de risco, nos termos do art. 4º, V, da Resolução CVM nº 21/2021. Com exceção dos atos relacionados à atividade de gestão de carteiras e consultoria de mobiliários, os quais são desempenhados pelo Diretor de Gestão; e pelos atos relacionados à compliance, risco e controles internos, a sociedade é validamente representada isoladamente ou em conjunto por cada um dos diretores, nos termos do Clausula 5ª do Contrato Social da Sociedade;

Diretor de Risco: responsável pelo acompanhamento e gestão de risco, em cumprimento das regras, políticas, procedimentos e controles internos, nos termos do art. 4º, V, da Resolução CVM nº 21/2021; e

Diretor de Distribuição: responsável pela atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento, em cumprimento das regras, políticas, procedimentos e controles internos, nos termos da Resolução CVM nº 21/2021.

Diretor de Suitability: responsável pela verificação da adequação dos produtos, serviços e operações ao perfil do cliente.

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:

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	954.347.390-00	BRUNO OTAVIO CLAUDINO DOS SANTOS	37	ENGENHEIRO DE PRODUÇÃO	Diretor Gestão	19/07/2021	indeterminado	Diretor de Distribuição Diretor de Suitability	Engenheiro Produção	Engenheiro de Produção autorizado a prestar serviços de Administrador de Carteiras de Valores Mobiliários pelo ato declaratório 13.848. Certificado pela ANBIMA no CPA-20, CFG. CGA e CGE.
8.5 (COMPLIANCE)	00.000.407/4510-48	Luiz Leonardo Abelin Fracao	39	Engenheiro Civil	DIRETOR COMPLIANCE	11/09/2017	INDETERMINADO		Engenheiro Civil	Engenheiro Civil pela UFRGS
8.7 (DISTRIBUIÇÃO DE COTAS)	00.000.449/5610-03	BRUNO OTAVIO CLAUDINO DOS SANTOS	37	ENGENHEIRO DE PRODUÇÃO	DIRETOR DE GESTÃO	19/07/2021	INDETERMINADO	DIRETOR DE GESTÃO DIRETOR DE SUITABILITY DIRETOR DE DISTRIBUIÇÃO	Engenheiro de Produção pela UFRGS. Autorizado a prestar serviços de Administrador de Carteiras de Valores Mobiliários pelo ato declaratório 13.848, de 09/09/2014.	Certificado CPA-20, CFG, CGE e CGA pela Anbima.

8.6 (GESTÃO DE RISCO)	00.000.407/4510-48	Luiz Leonardo Abelin Fracao	39	Engenheiro Civil	Diretor de Risco	19/07/2021	Indeterminado		Engenheiro Civil	Engenheiro Civil pela UFRGS

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

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída
00.000.407/4510-48	Luiz Leonardo Abelin Fracao	Nebraska Capital	Diretor de Compliance	Engenheiro Civil e Diretor de Compliance	11/09/2017	
00.000.407/4510-48	Luiz Leonardo Abelin Fracao	Nebraska Capital	Diretor de Risco.	Diretor de Risco.	19/07/2021	
00.000.449/5610-03	BRUNO OTAVIO CLAUDINO DOS SANTOS	Nebraska Capital	Diretor de Gestão, Distribuição e Suitability	Engenheiro de Produção pela UFRGS. Autorizado a prestar serviços de Administrador de Carteiras de Valores Mobiliários pelo ato declaratório 13.848, de 09/09/2014. Certificado CPA-20, CFG, CGE e CGA pela Anbima.	19/07/2021	

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

a. Quantidade de profissionais

3

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Análise de empresas e indicadores financeiros, research, análise de investimentos, modelagem financeiro-econômica, análise de projetos sob o ponto de vista econômico-financeiro e suporte ao Diretor de Gestão na tomada de decisões relacionadas aos fundos sob gestão.

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

Sistema Phibra: O sistema Phibra® foi desenvolvido para controlar todos os processos de Gestão de Fundos nas seguintes áreas de atuação: Frontoffice, Backoffice, Compliance, Passivo/CRM, Gerencial e Risco.
Está também capacitado para trabalhar com várias empresas, várias filiais e controla operações e saldo de c/c em vários países. Trabalha em um ambiente único, com isso, todas as informações são retiradas de um único Banco de Dados com informações íntegras. Abaixo, demonstramos as principais funcionalidades do sistema:
Frontoffice (Boletador, resultado por estratégia/trader/operação, Painel com prévia da cota em tempo real, Saldo de Caixa em D+3 e Simulador de Rateio).
Backoffice (Batimento de cotas, Carteira do Fundo, Fluxo de Caixa, Custos / Receitas, Rebate, Performance, IR e IOF, Controle de Distribuidores (Rebate).
Compliance (Enquadramento, Restrição de horários para aplicações e resgates, Permissão de Usuários por tela, usuários habilitados para exportar consultas para arquivos e/ou impressão de relatórios. O Banco de Dados fica fisicamente no cliente.
Passivo/CRM (Workflow de movimentações do Passivo (Aplicações, Resgates, Come-cotas) com seus respectivos cálculos de IR e IOF, compensação de prejuízo. Relatórios gerenciais de assessores (officers) comerciais por mês, por cotista, prévia de impostos por nota, controle de documentação e envio por e-mail de cotas e comunicados pelo sistema. Emissão de lâmina a qualquer momento.).
Gerencial (Attribution, Exposição em Derivativos, Taxa de Administração/Performance provisionadas.)
Risco (Risco de Liquidez, Alertas, Prazo médio e Consolidado de ações por empresa.)
VaR (Histórico e Paramétrico)
Stress Test (Em desenvolvimento)

Pacote Office (Word; Excel; Power Point e Outlook)

A seguir, descrevem-se especificamente as atividades e procedimentos desenvolvidas pelo responsável junto ao Comitê de Gestão e Investimento, do qual participa desde a criação:

1)O requerente realiza e apresenta ao Comitê de Gestão e Investimento uma análise do levantamento de dados das empresas interessados.

2) Cabe assinalar que este estudo leva em conta todas as informações destas empresas desde os Balanços Patrimoniais, DRE, ITR, até as vantagens comparativas de seus produtos ou serviços.

3)Depois de apresentadas pelo gestor, as análises são debatidas pelo Comitê.
Por fim, o requerente é responsável por se manter informado e atualizado através da leitura e análise de eventuais novas informações sobre Balanços Patrimoniais, DRE, ITR e notícias da imprensa quanto às empresas investidas.

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

1

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Todas as informações pessoais e financeiras de clientes da Nebraska Capital contarão com o sigilo e privacidade, devendo a Nebraska Capital tratar todas as informações recebidas como sigilosas, não sendo, portanto, permitida sua transmissão a terceiros, salvo expressa anuência do cliente ou por ordem judicial ou administrativa. A Nebraska Capital adota, ainda, como parte integrante da Política de Confidencialidade a assinatura, por cada Integrante da Nebraska Capital, do Termo de Confidencialidade e Ética.

As informações confidenciais da Nebraska Capital são protegidas de forma física e lógica. Sob o ponto de vista físico, a área destinada às atividades de gestão de recursos é segregada das demais áreas da Sociedade, sendo certo que tal local possui controle de acesso no qual apenas colaboradores da área de gestão podem ter acesso. Neste sentido, os documentos e informações relacionados à gestão de recursos são arquivados em locais dentro da própria sala de gestão de recursos.

As demais áreas da sociedade (compliance e backoffice) desenvolvem suas atividades em sala diversa da sala de gestão de recursos e seu acesso também é eletronicamente controlado.

Todos os Integrantes da Nebraska Capital deverão ter conhecimento dos dispositivos constantes da Lei nº 9.613, de 03 de Março de 1998, que trata dos crimes de "lavagem" ou ocultação de bens, direitos e valores. Os Integrantes da Nebraska Capital envidarão seus maiores esforços a fim de coibir operações que tenham esse cunho.

A Nebraska Capital manterá política específica referente à prevenção dos crimes de "lavagem" ou ocultação de bens, direitos e valores para atendimento da legislação aplicável.

A Nebraska Capital possui Manual de Procedimento para Combate e Prevenção à Lavagem de Dinheiro, o qual deverá ser revisado anualmente.

O treinamento aos Integrantes da Nebraska Capital se dará no ingresso do colaborados, sendo atualizado periodicamente nos termos descritos no Manual de Procedimento para Combate e Prevenção à Lavagem de Dinheiro.

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

As atividades desenvolvidas pelo Compliance constam expressamente no Código de Ética e Conduta, Manual de Compliance da Nebraska Capital e demais manuais e políticas da Nebraska Capital, os quais estão em conformidade com o disposto no item 2.7 do Ofício Circular/CVM/SIN/Nº 05/2014 e na Resolução CVM nº 21/2021, e tem por objetivo estabelecer 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 com a Nebraska Capital, tanto na sua atuação interna quanto na comunicação com os diversos públicos.

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

Na estrutura da Nebraska Capital, o Compliance e, portanto, o Diretor de Compliance, não se subordinam à equipe de gestão de investimentos, razão pela qual possui total autonomia no exercício de suas atividades. Além disso, o descumprimento, suspeita ou indício de descumprimento de quaisquer das regras estabelecidas no Manual ou das demais normas aplicáveis às atividades da Nebraska Capital por qualquer de seus colaboradores (inclusive pelo Diretor de Gestão) deverá ser levado para apreciação dos administradores e sócios da Nebraska Capital, de acordo com os procedimentos estabelecidos no Manual de Compliance, sendo que competirá ao Diretor de Compliance aplicar as sanções decorrentes de tais desvios, nos termos do Manual de Compliance e conforme definido pelos administradores da Nebraska Capital, garantido ao colaborador amplo direito de defesa.

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

a. Quantidade de profissionais *

2

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

As atividades desenvolvidas pela área de Gestão de Riscos têm por objetivo monitorar a exposição aos fatores de risco inerentes aos investimentos realizados, analisando as informações diárias dos fundos, seus limites e volatilidade dos ativos em relação à exposição aos mercados, considerando a relação dos mesmos com os cenários apresentados, buscando identificar os potenciais eventos que possam vir a afetar os resultados da instituição.

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

A Nebraska Capital utiliza os sistemas Phibra, Quantum e Excel.

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

Via Política de Investimento e Gestão de risco foi criado relatórios e controles para monitoramento total dos riscos a serem apresentados de forma automática e independente pela área. Todas as rotinas e procedimentos da área de Gestão de Riscos constam expressamente da Política de Gestão de Riscos da Nebraska Capital e deverão variar de acordo com o tipo de risco envolvido, considerando a operação objeto do controle.

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

n/a

c. A indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividades

n/a

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

a. Quantidade de profissionais

1

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

Atividade de distribuição exclusivamente das cotas dos fundos de investimento cujas carteiras são administradas pela Nebraska Capital. O Diretor de Gestão é, em última análise, responsável pela definição das estratégias e tomada de decisões quanto à distribuição das cotas dos fundos de investimento geridos pela Nebraska Capital.

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

Política de Treinamento: Os colaboradores da Nebraska Capital envolvidos na atividade de distribuição são submetidos aos treinamentos e atualizações, conforme expressamente constante do Manual de Ética e Compliance, Manual de Suitability e Manual de PLD-FT.

d. Infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos, programas e serviços utilizados na distribuição

A área de distribuição dispõe de toda infraestrutura das demais áreas da Nebraska Capital e utiliza os serviços e controles internos para gerenciar o relacionamento com os clientes, além dos servidores nas nuvens para armazenar informações cadastrais, registrar operações e obter relatórios gerencias.

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

Para cadastro das informações dos investidores a Nebraska Capital utiliza o sistema de interno de planilhas e pré-cadastro para facilitar o fluxo de informações na finalização e conferência dos dados. A rotina consiste em obter as informações cadastrais dos clientes, em consonância com a regulação vigente, avaliação da capacidade financeira do cliente e a origem dos recursos, avaliação e identificação do perfil de risco para a correta adequação dos produtos. Nesse sistema também são registradas todas as operações executadas pelos clientes.

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

n/a

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:

As principais formas de remuneração da Nebraska Capital serão através das taxas com bases fixas (taxas de gestão) e taxa de performance.

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:

n/a

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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

A Nebraska Capital adota programa de seleção e treinamento destinado a compatibilizar as práticas de desempenho da totalidade de seus integrantes, estejam estes envolvidos ou não no trato de informações confidenciais ou na tomada de decisões de investimentos, de forma a compatibilizar seus comportamentos e atuações, no curso de suas atividades na Nebraska Capital, com as melhores práticas, doutrinas e regras expedidas pelos órgãos legisladores e reguladores nacionais.

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

Utilizamos dois critérios para a seleção de corretoras, nesta ordem:

1) Reputação de serviço e solidez; e
2) Taxas praticadas em comparação ao mercado.

Dentro destes critérios, pode ser priorizada alguma corretora. Uma vez que ao lidarmos com uma quantidade grande de valores de nossos clientes, acreditamos que seja necessário prezar muito pela solidez de nossos parceiros.

A Nebraska Capital produz relatórios mensais apresentados ao Diretor, detalhando custos por operador e por corretora, bem como seus valores acumulados no ano corrente. Assim é possível verificar se alguma corretora ou operador está incorrendo em custos que fogem à média dos demais e tomar-se uma providência seja quanto a descontratação de alguma corretora do rodízio ou a readequação da conduta do operador.

Toda devolução de corretagem é revertida integralmente aos fundos.

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

Qualquer vantagem auferida a título de soft dollar pertencerá aos clientes, com a exceção dos serviços de Bloomberg e/ou sistemas de informação de mercado.

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

Falta Energia Elétrica: Em caso de falta de energia, os computadores e servidores da Nebraska Capital contam com sistemas de No-Break com capacidade de 120 minutos de autonomia, o que permite gravar e salvar quaisquer tipos de arquivos ou informações que estavam sendo processadas no momento da falta de energia elétrica, bem como permitir que as atividades se mantenham por período razoável para que se reestabeleça a energia.
Nosso prédio atual conta com um sistema de geradores a diesel, assegurando a energia;

Telefone Inoperante: Em caso de problemas de telefone, o Back Office possui telefone celular corporativo, que é disponibilizado ao contato com clientes e/ou realizar chamadas de emergência.

Internet Inoperante: A Nebraska Capital conta com 2 provedores de internet distintos, de forma que em caso de problemas com internet em um dos servidores, o outro provedor e utilizado. Ainda, o Back Office possui telefone celular (SmartPhone) com a função de internet 4G, podendo ser utilizado para tal emergência por meio de sua função 'roteador de sinal'.

Rede Local Inoperante: Em caso de problemas com a rede, o Back Office possui dispositivo de PenDrive com capacidade de 4G para que as informações possam ser gravadas nele e posteriormente gravadas nas nuvens e na rede.

Acesso a Gravação de Voz Inoperante: Em caso de problemas com acesso a gravação de voz, o Back Office tem acesso ao HD físico mantido com o servidor da gravação de voz que armazena todas as gravações efetuadas pela empresa.

Computadores Danificados: Em caso de problemas com os computadores utilizados pelos integrantes da Nebraska Capital, contamos com um sistema de Back UP on line via nuvens, o qual é atualizado no mínimo diariamente.

Incêndio: Em caso de incêndio, o escritório da Nebraska Capital possui 6 sprinklers espalhados em todos os ambientes do escritório. Além disso, o prédio possui saídas de emergência (escadas) com portas antifogo. Ainda, o escritório da empresa possui seguro contra incêndio fornecido pela imobiliária.

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

POLÍTICA DE GESTÃO DO RISCO DE LIQUIDEZ.
1 - Introdução
Esta Política de Gestão de Risco de Liquidez da Nebraska Capital Gestão de Recursos Ltda. ("Nebraska Capital") tem por objetivo descrever os procedimentos, metodologia e controles relacionados à gestão de risco de liquidez, que devem ser obedecidos por todos os integrantes da Nebraska Capital que façam ou venham a fazer parte de áreas relacionadas à escolha de ativos e/ou administração de recursos. São descritos os procedimentos necessários à identificação e ao acompanhamento da exposição aos riscos liquidez que sejam relevantes para as carteiras de valores mobiliários.
Estas regras servem de apoio para cumprir fielmente o regulamento do fundo de investimento ou o contrato previamente firmado por escrito com o cliente, contrato este que deve conter as características a serem prestadas.
A Política de Gestão de Risco de Liquidez abordará os seguintes itens:
1 Estabelecer metodologia que evidencie a garantia da gestão de liquidez dos fundos.
2 Descrever a estrutura organizacional utilizada para tomada de decisões
3 Descrever os controles utilizados para gerenciamento da liquidez.
4 Descrever quais providências seriam tomadas no caso de fechamento dos mercados e/ou em casos excepcionais de iliquidez dos Ativos componentes da carteira possam influenciar a liquidez dos fundos 555.
1 Estabelecer metodologia que evidencie a garantia da gestão de liquidez dos fundos
A Área de Risco possui sistema proprietário de gestão de risco de liquidez desenvolvido com a finalidade de monitorar as métricas por meio de diferentes metodologias de cálculo de risco de liquidez. As métricas e cálculos de risco de liquidez são igualmente realizadas para todas as categorias de fundos geridos pela Nebraska Capital. A Área de Risco realizará testes de aderência (backtest) anualmente para garantir a eficácia das métricas de risco de liquidez utilizadas. A Área de Risco guardará os documentos que contenham os registros das análises de risco, testes de aderência das métricas de risco utilizadas e decisões tomadas por, pelo menos, 5 anos. São apresentadas, a seguir, as metodologias para gerenciamento dos riscos de liquidez aos quais as carteiras dos fundos da Nebraska Capital estão expostas.
O Objetivo é estabelecer indicadores que busquem assegurar a compatibilidade entre a demanda por liquidez e a oferta de liquidez de nossos fundos 555 de condomínio aberto.
Oferta de liquidez dos ativos:
No processo de análise da oferta de liquidez dos fundos, será utilizada a seguinte metodologia para estimar o volume máximo diário que poderíamos liquidar de cada tipo de ativo:
? Ações negociadas na BMF Bovespa: consultaremos em fontes confiáveis do mercado (preferencialmente a própria BMF Bovespa ou em nossos sistemas), o volume médio negociado nos últimos 3 meses para cada ativo. Assumimos que, caso necessário, poderíamos realizar diariamente 1/3 deste volume médio no mercado (haircut). Ativos que não tenham sido negociados nos últimos 3 meses serão considerados ilíquidos e em nossas estimativas consideraremos que não conseguiríamos liquidá-los.
? Compromissadas lastreadas em títulos públicos: pela liquidez e características deste ativo, em nossas análises será considerado que este ativo tem liquidez de acordo com o seu prazo de vencimento.
? Títulos Públicos: pela liquidez e características deste ativo, em nossas análises será considerado que este ativo tem liquidez imediata.
? Fundos de Investimento de renda fixa: O caixa do fundo poderá ser aplicado em fundos de investimentos de renda fixa cujo objetivo seja seguir a variação do certificado de depósito interbancário (CDI) ou da taxa SELIC, desde que tenham liquidez diária. Devido às características destes ativos, consideramos que possuem liquidez imediata.
? Cotas de Fundos de Investimentos: Dado que não é possível ter controle a respeito da carteira do fundo de investimento investido, a liquidez desse tipo de ativo é da

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

Cadastro de Clientes: A Nebraska Capital adota a política de análise e identificação de seus clientes com o objetivo de conhecê-los, estabelecendo um conjunto de regras que propiciem identificar e conhecer a origem e constituição do patrimônio e dos recursos financeiros do cliente. Nas atividades desempenhadas pela Nebraska Capital, os colaboradores deverão cadastrar os clientes da Nebraska Capital previamente ao início das atividades.

Normas de Adequação - Suitability: A Nebraska Capital, nos termos do Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento, adota procedimentos formais que possibilitem verificar a adequação do investimento realizado por seus clientes ao perfil de risco a ele atribuído, levando-se em consideração sua situação financeira, sua experiência em matéria de investimentos, grau de tolerância a volatilidade e os objetivos visados ao investir nos fundos de investimento geridos pela Nebraska Capital.

Normas sobre lavagem de dinheiro e ocultação de bens: é dever de todos os colaboradores da Nebraska Capital a prevenção quanto e utilização dos ativos e sistemas para fins ilícitos, tais como crimes de "lavagem de dinheiro", ocultação de bens e valores, nos termos do determinado pela Lei 9.613/98 e de acordo com a Circular BACEN 3.978/2020 e Carta-Circular BACEN 4.001/2020, bem como a Resolução CVM nº 50, de 31 de agosto de 2021, conforme alterada, e o Ofício-Circular nº 5/2015/SIN/CVM.

Troca de Informações: A Nebraska Capital adota como política a troca contínua e frequente de informações com as instituições administradoras dos fundos de investimento para os quais presta serviços de distribuição. Não obstante, a Nebraska Capital deve guardar sigilo de informações confidenciais a que tenha acesso no exercício de sua função, bem como zelar para que tal dever seja observado, por si, seus diretores e demais representantes, prepostos e empregados, agentes, consultores e empresas contratadas que venham a ter acesso a tais informações.

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.nebraskacapital.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 *

A Nebraska Capital declara não ter conhecimento de nenhum processo administrativo ou arbitral, transitado em julgado ou não, prolatada nos últimos 5 anos.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

n/a

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

A Nebraska Capital declara não ter conhecimento de nenhum processo administrativo ou arbitral, transitado em julgado ou não, prolatada nos últimos 5 anos.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

n/a

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

A Nebraska Capital declara não ter conhecimento de nenhum processo administrativo ou arbitral, transitado em julgado ou não, prolatada nos últimos 5 anos.

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

A Nebraska Capital declara não ter conhecimento de nenhum processo administrativo ou arbitral, transitado em julgado ou não, prolatada nos últimos 5 anos.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

n/a

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

A Nebraska Capital declara não ter conhecimento de nenhum processo administrativo ou arbitral, transitado em julgado ou não, prolatada nos últimos 5 anos.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

n/a

12. Declarações

Declaração do administrador, atestando:

Que reviu o formulário de referência

Marcado

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)

Marcado

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

Marcado

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
Marcado

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

Nada a declarar
Marcado

Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

Nada a declarar
Marcado

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

Nada a declarar
Marcado

Títulos contra si levados a protesto

Nada a declarar
Marcado

Data de envio: 24/08/2023 - 11:23:00
Data de impressão: 24/08/2023
Hora de impressão: 11:23:48