



FORMULÁRIO DE CREDENCIAMENTO

Data Base: Abril/2021


I – IDENTIFICAÇÃO DA INSTITUIÇÃO

Razão Social: BB Gestão de Recursos Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.

C.N.P.J.: 30.822.936/0001-69

Endereço: Praça XV de Novembro, 20 - 2º Andar.

Cidade: Rio de Janeiro

UF: RJ

CEP: 20.010-010

Contatos

1 – Nome: Marcelo Amorim Cerqueira

Telefone: (021) 3808-7549

E-mail: amorimarcelo@bb.com.br

2 – Nome: Fernanda Vieira Lima

Telefone: (021) 3808-7769

E-mail: fernanda_lima@bb.com.br

II – DOCUMENTAÇÃO LEGAL

Instituição Financeira constituída conforme Estatuto Social, e alterações posteriores, emitido em 15/05/1986. Entidade autorizada a exercer a atividade de Administração de Carteiras, conforme Ato Declaratório de nº 1.481 expedido em 13/08/1990 pela CVM.

Atestado de Regularidade:

- | | | |
|-------------------------------------|------------------|---------------------------|
| <input checked="" type="checkbox"/> | Fiscal Municipal | Vencimento em 04/08/2021; |
| <input checked="" type="checkbox"/> | Fiscal Estadual | Vencimento em 12/07/2021; |
| <input checked="" type="checkbox"/> | Fiscal Federal | Vencimento em 11/07/2021; |
| <input checked="" type="checkbox"/> | Previdenciário | Vencimento em 11/07/2021. |

III – CLASSIFICAÇÃO DA INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

- | | | | | | |
|--------------------------|--------------|--------------------------|-----------------|-------------------------------------|----------------------|
| <input type="checkbox"/> | GESTOR | <input type="checkbox"/> | ADMINISTRADOR | <input type="checkbox"/> | GESTOR/ADMINISTRADOR |
| <input type="checkbox"/> | DISTRIBUIDOR | <input type="checkbox"/> | AGENTE AUTÔNOMO | <input checked="" type="checkbox"/> | DTVM |

❖ POSSUI RATING DE GESTÃO DE QUALIDADE?

Sim.

Emissor: MOODY'S AMERICA LATINA

Rating: MQ1

Emissor: FITCH RATINGS

Rating: Excelente



Patrimônio sob Gestão (Nacional): R\$ 1.242.493,54 milhões*

Patrimônio sob Gestão (Global): R\$ 1.242.493,54 milhões *

Patrimônio sob Gestão (RPPS): R\$ 70.061,18 milhões*

* Fonte: SITE ANBIMA - Ranking Global de Administração de Recursos de Terceiros – Abril/2021.

- ❖ A INSTITUIÇÃO É SIGNATÁRIA DO CÓDIGO DE MELHORES PRÁTICAS E AUTORREGULAÇÃO DA ANBIMA?

Sim.

- ❖ AS FUNÇÕES DE GESTÃO, ADMINISTRAÇÃO E CUSTÓDIA SÃO SEGREGADAS?

Sim.

Administração: BB Gestão de Recursos Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.

Gestão: BB Gestão de Recursos Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.

Custódia: Banco do Brasil S.A.

- ❖ A INSTITUIÇÃO POSSUI PROCESSO INTERNO QUE COMPROVE O CUMPRIMENTO DAS DISPOSIÇÕES DA RESOLUÇÃO BACEN/CMN Nº 3.721, DE 30 DE ABRIL DE 2009, EM ATENDIMENTO À PORTARIA MPAS Nº 170, DE 24 DE AGOSTO DE 2011? CASO A RESPOSTA SEJA POSITIVA, ANEXAR DOCUMENTO COMPROBATÓRIO.

Essa responsabilidade está a cargo da Diretoria de Crédito do Banco do Brasil.

IV – PRODUTOS APRESENTADOS AO RPPS

- ❖ RELACIONAR OS PRODUTOS DESTINADOS AOS RPPS DE ACORDO COM A LEGISLAÇÃO VIGENTE. INFORMAR SEUS RESPECTIVOS PATRIMÔNIOS, TAXA DE ADMINISTRAÇÃO, PERFORMANCE (SE HOVER) E BENCHMARK. AINDA COM RELAÇÃO AOS PRODUTOS, INFORMAR O DESEMPENHO DOS MESMOS, COMPARADOS COM SEUS RESPECTIVOS BENCHMARKS NOS ÚLTIMOS 24 (VINTE E QUATRO MESES), BEM COMO O COMPARATIVO COM RELAÇÃO À VOLATILIDADE APRESENTADA (RISCO: VAR).

As informações estão disponíveis no anexo “Desempenho dos Fundos”.

V – POLÍTICA DE TRANSPARÊNCIA

- ❖ O CLIENTE NECESSITA QUE AS CARTEIRAS DOS FUNDOS SEJAM ABERTAS DIARIAMENTE NOS FORMATOS PDF E XML, E QUE OS EXTRATOS (CONTA



CORRENTE E DOS INVESTIMENTOS), POSSAM SER CONSULTADOS. FAVOR INFORMAR A PERIODICIDADE PARA DISPONIBILIZAÇÃO DA DEMANDA ACIMA.

Diário.

- ❖ A INSTITUIÇÃO POSSUI FERRAMENTA ELETRÔNICA QUE POSSIBILITE À CONSULTA (VISUALIZAR) AS OPERAÇÕES EFETUADAS: SALDOS, APLICAÇÕES, RESGATES, TRANSFERÊNCIAS E MIGRAÇÕES, POR MEIO DA REDE MUNDIAL DE COMPUTADORES? CASO NÃO HAJA POSSIBILIDADE, INFORMAR O PROCEDIMENTO ATUAL COMPATÍVEL COM A NECESSIDADE DESCRITA.

Através do Gerenciador Financeiro do Banco do Brasil S.A., o cotista pode acessar informações sobre sua conta corrente, como, por exemplo, saldos, aplicações, resgates, transferências etc. Além disso, as informações sobre Fundos de Investimentos ficam disponíveis no site da BB DTVM (www.bbdsvm.com.br), demais informações podem ser enviadas por e-mail, quando solicitadas, e se autorizado pelos clientes.

VI – HISTÓRICO DA EMPRESA

- ❖ A INSTITUIÇÃO FINANCEIRA OU OS DIRIGENTES JÁ FORAM AUTUADOS PELA CVM OU PELO BANCO CENTRAL PELO DESCUMPRIMENTO DE NORMAS REGULARES? ALGUM PROCESSO EM INVESTIGAÇÃO? CASO POSITIVO, INFORMAR O NÚMERO DO PROCESSO.

Não há ocorrência materialmente relevante nos últimos 5 anos.

VII – GESTÃO DE RISCOS

- ❖ QUAIS SÃO OS RELATÓRIOS DE RISCOS, COM QUE FREQUÊNCIA SÃO GERADOS E O QUE CONTÊM ESTES RELATÓRIOS?

Como principal ferramenta para mensuração dos riscos de mercado é utilizado o sistema RiskWatch da IBM. Além deste, diversos sistemas auxiliares foram desenvolvidos ou adquiridos para gestão e controle dos riscos de mercado dos fundos de investimento.

Todas as informações sobre os riscos de mercado e liquidez dos fundos de investimento e carteiras administradas, bem como sobre limites e consumos, são disponibilizadas diariamente na intranet, em área específica de acesso restrito aos funcionários da BB DTVM, ou por meio de correio corporativo, a saber:

- VaR diário e Histórico do VaR diário
- Volatilidade
- Perdas em Cenários de Estresse histórico
- Duration



- Nível de utilização dos limites de risco
- Descasamento de ações
- LVaR e Índice de Liquidez dos fundos (em normalidade e em cenário de estresse)

Além dos gestores dos fundos, os relatórios também são analisados pelos analistas da equipe de risco.

O monitoramento da liquidez é realizado diariamente através de relatórios disponibilizados na intranet. Em primeira camada, o controle é realizado pelos gestores e em segunda camada, pela Divisão Gestão de Riscos de Mercado, Liquidez e de Crédito, através de sistema interno.

Mensalmente é elaborado o Relatório Mensal de Exposição ao Risco, em atendimento ao Art.23, parágrafo 1º, inciso V da Instrução CVM nº 558. Este relatório apresenta o limite de estresse e o consumo do limite de todos os fundos e carteiras administradas, o índice de liquidez e o nível de exposição de crédito nos fundos sob a administração/gestão da BB DTVM, destacando os pontos de atenção referentes aos riscos abordados, sendo encaminhado à Diretoria Executiva e aos Gerentes Executivos de Gestão. O Relatório Mensal de Exposição ao Risco apresenta ainda indicadores de risco operacional, risco de estratégia e risco de reputação.

❖ **METODOLOGIA DE GESTÃO DO RISCO DE CRÉDITO DAS CARTEIRAS E COMO CADA OPERAÇÃO DE CRÉDITO É ANALISADA, APROVADA E MONITORADA:**

As aquisições de títulos de instituições não financeiras (debêntures, notas promissórias etc.) são avaliadas pela Divisão de Análise de Crédito da BB DTVM, mediante análise técnica individualizada da empresa e da operação.

Concluída a etapa de análise de crédito do emissor/operação, caso a decisão seja favorável pela aquisição do título, essa se dará com base em limites previamente estabelecidos pela BB DTVM.

A decisão sobre o estabelecimento de limite para emissores é dada pelo Comitê de Crédito e Governança dos Ativos e a Diretoria Executiva da BB DTVM.

A gestão de fundos decide pela aquisição ou não do título e os papéis ingressam nos procedimentos normais da Gestão.

As decisões de investimento em títulos representativos de dívidas privadas devem atender aos critérios contidos no Manual de Gestão de Risco de Crédito, documento interno aprovado em instância colegiada que define critérios objetivos para análise e estabelecimento de limites em operações de crédito privado.

Os valores investidos devem obedecer às normas legais, ao regulamento e à norma de gestão das carteiras e dos fundos geridos (exposição a risco de crédito privado). Além das alçadas internas da BB DTVM.

O macroprocesso de Gestão de Crédito pode ser subdividido em:



- Originação: define os meios e os processos de relacionamento da BB DTVM com o mercado, com vistas à identificação de oportunidades negociais, investimentos e desinvestimentos em ativos privados de renda fixa;
- Análise: define os procedimentos de apreciação da qualidade de crédito dos títulos ofertados aos fundos, para embasamento da decisão de crédito;
- Decisão de Crédito: define os procedimentos de decisão de crédito para autorização de participação em emissões e estabelecimento de limites de crédito;
- Gestão: define os procedimentos de gestão dos títulos privados de renda fixa nos fundos e carteiras;
- Acompanhamento: define os procedimentos de acompanhamento da qualidade do crédito de títulos e carteiras;
- Recuperação: define os procedimentos de recuperação de créditos inadimplidos ou em processo de inadimplência.

Na originação, as emissões de renda fixa em títulos privados de empresas financeiras e não financeiras são identificadas no mercado mediante demanda das Gerências de Gestão de Fundos ou mediante oferta dos agentes de mercado em emissão primária ou oferta secundária dos papéis.

Via de regra, são consideradas para análise de estabelecimento de limite de crédito junto à BB DTVM as emissões e/ou emissor que sejam classificados na categoria Grau de Investimento (Rating AAA, AA, A, BBB), em escala nacional, por uma das principais agências de classificação de risco de renome internacional, representadas atualmente pela Fitch, Moody's e Standard & Poor's.

O estabelecimento de limite de crédito para as emissões passa pela análise da capacidade de pagamento do emissor, mediante projeções de fluxo de caixa, além da análise de garantias e estrutura jurídica da operação, nível de governança corporativa dos emissores e histórico de operações com o mercado de capitais. Também é observado o estabelecimento de *covenants* ajustados e factíveis para cada realidade de mercado.

As operações são deferidas em Comitê de Crédito e Governança dos Ativos composto por cinco executivos, por unanimidade de votos, onde são estabelecidos limites segregados e concorrentes para o emissor e para a emissão, considerando-se sempre a exposição geral a grupos econômicos.

Importante destacar que os limites estabelecidos têm base em critérios de classificação de risco próprios, que não se confundem com os ratings estabelecidos por agências de rating externas.

Uma vez encarteiradas, as operações passam a contar com acompanhamento permanente da qualidade do crédito, em especial dos índices financeiros acordados na escritura da emissão. Eventual alteração do risco da emissão ensejará medidas proativas para reequilíbrio da



qualidade do crédito, repactuação de condições contratuais ou redução da exposição ao risco, o que for mais aplicável.

Já para as operações que tem como emissores instituições financeiras (Letras Financeiras, CDBs), seus limites e prazos operacionais são revisados periodicamente, quando são elencadas as instituições aptas a operar com os fundos da BB DTVM.

Casos omissos e/ou exceções às regras estabelecidas no Manual de Gestão de Risco de Crédito serão decididos pela Diretoria Executiva da BB DTVM, mediante parecer do Comitê de Crédito e Governança dos Ativos.

- ❖ COMO SÃO ANALISADAS AS GARANTIAS DAS OPERAÇÕES E QUAIS OS CRITÉRIOS UTILIZADOS (ANÁLISE DE FORMALIZAÇÃO, EXECUÇÃO, ETC)? HÁ REAVALIAÇÃO PERIÓDICA DA QUALIDADE DO CRÉDITO E DE SUAS GARANTIAS? QUAL SUA PERIODICIDADE?

A análise de garantias é feita com base em laudos de especialistas e com apoio do suporte jurídico, sempre que necessário.

A qualidade do crédito é revisada anualmente e as garantias, em geral, são reavaliadas em periodicidade definida em escritura.

- ❖ AS QUESTÕES E RISCOS ASG – AMBIENTAIS, SOCIAIS E DE GOVERNANÇA CORPORATIVA – SÃO CONSIDERADOS NA ANÁLISE DE RISCO DE CRÉDITO? (EXEMPLOS: PERDA DE LICENÇA AMBIENTAL, CORRUPÇÃO, ENVOLVIMENTO EM CASOS DE TRABALHO ESCRAVO OU INFANTIL, ETC.).

Sim, a BB DTVM, em seus processos de avaliação dos ativos investidos de recursos de terceiros, busca considerar uma combinação de retorno financeiro com a Governança Corporativa, de acordo com princípios de ASG, atendendo a Resolução Bacen nº 4.327/2014, as diretrizes do PRI, (*Principles for Responsible Investment*) e seguindo o Código AMEC de Princípios e Deveres dos Investidores Institucionais – *Stewardship*.

A empresa não assume risco de crédito de emissor: inadimplente com suas dívidas ou em litígio com a BB DTVM, exceto no contexto de recuperação de créditos ou para redução da exposição; em exercício de atividade que apresente restrições legais ou prejudique nossa imagem; enquadrado nos crimes de “lavagem de dinheiro” ou ocultação de bens, direitos e valores ou que exerça qualquer outra atividade ilegal; responsável por dano doloso ao meio ambiente; que submeta trabalhadores a formas degradantes de trabalho ou os mantenha em condições análogas à de trabalho escravo; que pratique a exploração sexual de menores; que pratique a exploração de mão-de-obra infantil; entidade religiosa; partido político; e clube, federação e confederação desportivos profissionais.

Para as operações de crédito privado, os aspectos ASG compõem uma régua qualitativa e quantitativa que influencia a tomada de decisão, podendo implicar na objeção ao limite de crédito, redução ou ampliação do limite.



- ❖ A GESTORA, INDEPENDENTEMENTE DO CRITÉRIO DE APREÇAMENTO, POSSUI ALGUM PROCEDIMENTO OU ESTRATÉGIA NO CASO DA IMINÊNCIA OU OCORRÊNCIA DE EVENTOS DE INADIMPLÊNCIA? DESCREVA

A deterioração do risco de crédito e os eventos de perda ou quase perda são tratados de forma individualizada, com vista a minimizar o risco de crédito, tais como: suspensão do limite de crédito, redução de exposição, reforço de garantias, renegociação do ativo. Em função da severidade dos fatos podem ser propostas provisões parciais ou integrais dos ativos em risco.

- ❖ A INSTITUIÇÃO POSSUI ÁREA DE TECNOLOGIA DA INFORMAÇÃO PRÓPRIA? CASO AFIRMATIVO, DETALHAR AS ATIVIDADES ATUAIS, ORGANOGRAMA E A QUALIFICAÇÃO DOS PROFISSIONAIS.

Sim. A Equipe de Tecnologia da Informação é responsável por:

- Planejar e desenvolver a Tecnologia da Informação - TI e telecomunicação da BB DTVM;
- Desenvolver e propor plano de priorização para atendimento das demandas internas de TI;
- Prospectar soluções de TI para os processos da BB DTVM;
- Negociar com o BB e fornecedores externos as soluções técnicas de TI;
- Prestar assessoramento no desenvolvimento e automação dos processos;
- Conduzir as atividades relativas às demandas de TI da BB DTVM em sistemas próprios, corporativos e de terceiros;
- Desenvolver, implantar e manter aplicativos próprios;
- Conduzir as atividades relacionadas aos serviços de telecomunicações;
- Administrar as bases de dados;
- Desenvolver, normatizar e implementar critérios, padrões e procedimentos relativos à coleta e tratamento de dados e geração de informações dos produtos e negócios da BB DTVM;
- Orientar a prestação de serviço de help-desk terceirizado;
- Acompanhar os serviços de TI fornecidos pelo BB e por fornecedores externos;
- Subsidiar os processos relativos aos sistemas e aplicativos no Plano de Continuidade dos Negócios.

Essa Divisão trabalha em consonância com as diretrizes da Diretoria de Tecnologia do Banco do Brasil S.A. – DITEC, responsável pelos processos de estruturação, construção, e operação das soluções de TI além da governança de TI e sua aderência às estratégias de negócio do Conglomerado.



❖ DESCREVA OS PROCEDIMENTOS DE VERIFICAÇÃO DE ORDENS EXECUTADAS E DE CHECAGEM DAS POSIÇÕES DAS CARTEIRAS.

As ordens de compra e venda de ativos financeiros são cadastradas pelos gestores, especificando volumes e comitentes, expedidas sempre com a identificação prévia e precisa do fundo, registradas nos sistemas internos em nome do qual elas devem ser executadas.

A mesa de operações acessa as ordens nesses aplicativos através de telas específicas que não permitem aos seus operadores identificar os comitentes, somente a área gestora. Caso as ordens sejam cumpridas apenas parcialmente, o próprio aplicativo procede ao rateio proporcional entre os comitentes.

Quando do grupamento de ordens, por meio desses sistemas internos previamente programados, os rateios são realizados automaticamente mediante critérios equitativos (distribuição "pro-rata" com Preço Médio), em conformidade com o artigo 82, Parágrafo Único da ICVM 555.

❖ EXISTE SISTEMA DE GRAVAÇÃO DE LIGAÇÕES TELEFÔNICAS? EM CASO POSITIVO, QUAL A POLÍTICA DE ESCUTA DAS GRAVAÇÕES?

Sim. O Manual de Diretrizes de Conduta Ética da BB DTVM que é aplicado aos Conselheiros, membros da Diretoria Executiva, empregados e colaboradores da empresa, clarifica que um dos deveres de todos é: autorizar, incondicionalmente, a escuta telefônica nos ramais corporativos gravados (a qualquer tempo, sem prévia solicitação ou comunicado, para efeito exclusivo de verificação de conformidade com as diretrizes da BB DTVM), que poderão ser executadas pelo Gerente da Divisão de Operações em Mercado (para os respectivos operadores), pelo Gerente da Divisão de *Compliance* e Controles Internos ou pelo Gerente Executivo de Gestão de Riscos. A Diretoria de Tecnologia - DITEC, do Banco do Brasil fornece a estrutura de telefonia da Distribuidora, um sistema que permite a gravação e recuperação de ligações telefônicas de ramais de áreas estratégicas, como Diretoria, Gestão, Mesa de Operações, Central de Atendimento e Equipe de Suporte ao Administrador e Distribuidor. A disponibilidade da escuta ao requisitante autorizado se dá em sua própria estação de trabalho, (de forma reservada, que mantém a privacidade de seu conteúdo).

❖ DESCREVA OS PROCEDIMENTOS DE BACK-UP E REDUNDÂNCIA DE INFORMAÇÕES, DESKTOPS E SERVIDORES (PARA BACK-UP, CITE ESPECIFICAMENTE A PERIODICIDADE, LOCAL E PRAZO DE ARMAZENAMENTO).

A garantia de backup está definida em Instruções Normativas do Banco do Brasil, provedor de toda nossa infraestrutura tecnológica utilizada pela BB DTVM.

O ambiente distribuído do Rio de Janeiro compreende uma rede de comunicação de dados e serviços com suporte técnico à BB DTVM. Toda a infraestrutura de TI é redundante entre diferentes sites, a exemplo de *storages* com serviço de replicação síncrona entre sites,



switches SAN, servidores e fitotecas, para armazenamento em mídias do tipo cartucho, gerenciadas pelo software TSM (*Tivoli Storage Manager Server*).

Os procedimentos são realizados de forma automatizada, utilizando a solução discriminada acima, controlado através de regras de retenção e políticas diferenciadas, acordadas com os gestores das unidades de negócio.

O gerenciamento do ciclo de vida dos dados é uma forma de controlar o fluxo dos sistemas de informação desde a criação e armazenamento inicial até o momento onde ele torna-se obsoleto e é deletado. Este processo prevê a organização dos dados em camadas ou "tierização", controladas por políticas específicas e migração de dados entre as camadas de forma automatizada.

As políticas utilizadas para o controle do ciclo de vida dos dados são definidas pela Equipe de Engenharia de TI do Banco do Brasil.

Estas políticas determinam:

- Periodicidade - tempo de retenção (1 ano, 3 anos, 5 anos, 30 anos, dependendo da política aplicada diretórios/pastas);
- Tipos de arquivos - quais os tipos de arquivos são controlados; e
- Localização dos arquivos - definição quanto aos servidores e drives de redes que contêm os diretórios/pastas a serem monitorados.

❖ **DESCREVA A POLÍTICA DE CONTROLE DE ACESSO AO DATA CENTER (FÍSICO E LÓGICO)**

O acesso ao Data Center é permitido somente para pessoas autorizadas e gerenciadas, via sistema de controle de acesso, com cartões de aproximação. Os acessos devem ser limitados à quantidade mínima de pessoas estritamente necessária à execução dos serviços e nos respectivos turnos.

Todas as pessoas que circulam pelo ambiente estão devidamente identificadas. É vedado, sob qualquer pretexto, permitir a entrada ou saída de pessoas sem a devida identificação e o registro nos dispositivos de controle de acesso.

O serviço de vigilância compreende período 24 por 7, o vigilante é orientado a abordar as pessoas que estejam circulando sem o crachá ou cartão de identificação.

O crachá (identidade funcional) ou cartão de identificação é de uso obrigatório durante toda a permanência no prédio, inclusive por ocasião da entrada e saída. Deve estar afixado acima da linha da cintura, de forma a facilitar sua visualização. A utilização do crachá ou cartão de identificação é individual e não pode ser emprestado, cedido ou repassado a outra pessoa.

O cartão de identificação é fornecido pela unidade responsável pelo gerenciamento do ambiente.

O monitoramento é efetuado por meio do sistema de CFTV e deve ocorrer em período 24 horas, 7 dias por semana, integrando o aparato de segurança das unidades, sendo seu uso destinado, exclusivamente, à proteção do patrimônio e das pessoas.



- ❖ DESCREVA O PARQUE TECNOLÓGICO ATUAL DA INSTITUIÇÃO. CITAR NO-BREAKS, CAPACIDADE DOS SERVIDORES, LINKS DE INTERNET E TELEFONIA ETC.

O parque tecnológico provido pelo Banco do Brasil é suportado por servidores próprios para ambiente de missão crítica, em cluster geográfico e com replicação síncrona de dados, com redundância de links e operadoras de telecom.

O Data Center é suportado por vários geradores (4 x 275 kVA e 3 x 160 kVA) em paralelo redundante. Todo ambiente é contingenciado e com alta disponibilidade, inclusive com sites de contingência para usuários.

- ❖ A GESTORA POSSUI FILTRO DE E-MAIL, FIREWALL E SISTEMAS DE ANTIVÍRUS?
Sim.

- ❖ SÃO REALIZADOS TESTES PERIÓDICOS PARA VERIFICAÇÃO DE SEGURANÇA E INTEGRIDADE DE SISTEMAS? COM QUE FREQUÊNCIA?

Todo o ambiente de TI é monitorado continuamente, e são realizados testes de contingência anuais, com simulação de “*disaster recovery*”.

➤ **Compliance e Controles Internos**

- ❖ A GESTORA ADOTA PROCEDIMENTOS DE MONITORAMENTO CONTÍNUO DAS REGULAMENTAÇÕES E AUTORREGULAMENTAÇÃO APLICÁVEIS AO SEU SEGMENTO DE ATUAÇÃO COM EXECUÇÃO DE AÇÕES PREVENTIVAS E CORRETIVAS? EM CASO POSITIVO, DESCREVA OS PROCEDIMENTOS ADOTADOS.

A Divisão de Regulação e Autorregulação acompanha a legislação, normativos e matérias de interesse para a empresa, fundos e carteiras administradas. Para isso, monitora diariamente publicações das entidades externas de regulação, autorregulação e controle, tais como CVM, ANBIMA, CGU, BACEN, Receita Federal, entre outras. Após cuidadosa análise das matérias, são divulgadas na Intranet da BB DTVM aquelas relacionadas às atividades e rotinas da empresa, de forma a dar ampla divulgação aos funcionários. Além disso, a Divisão de Regulação e Autorregulação analisa e coordena o processo de adaptação da legislação de fundos de investimentos e carteiras administradas, analisando os impactos e oportunidades em conjunto com as demais áreas da BB DTVM. A referida Divisão faz parte da Gerência de Governança, Regulação e Gestão Financeira, que é subordinada diretamente à Diretoria de Administração de Fundos e Gestão Corporativa.



- ❖ DESCREVA OS PROCEDIMENTOS ADOTADOS PELA GESTORA PARA CONTROLAR A FAIXA DE PREÇOS DOS ATIVOS E VALORES MOBILIÁRIOS NEGOCIADOS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO SOB SUA GESTÃO.

As ordens de compra e venda de ativos financeiros são cadastradas pelos gestores no sistema "*FRONT OFFICE*", especificando volumes e fundos a serem alocados. A Divisão de Operações acessa as ordens no sistema que não permitem aos operadores identificarem os fundos.

No caso dos títulos públicos e através do sistema "*OFERTA*" os gestores acompanham em tempo real as ofertas de compra e venda dos títulos e os negócios realizados junto ao mercado. Esse mesmo sistema serve para controle dos preços dos ativos, bem como insumo para o Comitê de Precificação de Ativos e na função de *Price Maker* junto à ANBIMA.

No caso de Renda Variável os ativos são listados em Bolsa (B3) e disponíveis para acompanhamento em tempo real pelo sistema de cotações da B3.

- ❖ DESCREVA O PROCESSO PARA ADESÃO AO CÓDIGO DE ÉTICA E CONDUTA, BEM COMO SUAS ATUALIZAÇÕES, PELAS PROFISSIONAIS QUE TRABALHAM NA GESTORA.

Anualmente, ou quando da ocorrência de alterações, os empregados assinam eletronicamente o Termo de Ciência do Manual de Diretrizes de Conduta Ética da BB DTVM, e também a Declaração Anual de Observância ao Manual de Diretrizes de Conduta Ética.

- ❖ DESCREVA COMO É REALIZADO O MONITORAMENTO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS PESSOAIS.

Os empregados e membros da Diretoria Executiva da BB DTVM estão sujeitos às regras discriminadas no Capítulo V – Normas para Investimentos Pessoais do Manual de Diretrizes de Conduta Ética. O monitoramento é realizado trimestralmente verificando se as negociações realizadas foram devidamente autorizadas pela área de *Compliance* e estão em conformidade com as regras vigentes.

- ❖ EXISTE FUNDO OU OUTRO INSTRUMENTO DE INVESTIMENTO EXCLUSIVO PARA SÓCIOS E EXECUTIVOS DA GESTORA?

Não.

- ❖ DESCREVA OS PROCEDIMENTOS DE MONITORAMENTO IMPLEMENTADOS PARA PREVENÇÃO E DETECÇÃO DE PRÁTICAS ILÍCITAS DE TRADING (EX: *FRONT RUNNING*, *INSIDER TRADING*, *SPOOFING*, ETC.).

Solicitações de compra ou venda de ativos alvo por parte de empregados e membros da Diretoria Executiva da BB DTVM devem ser encaminhadas via sistema próprio para ciência e análise pela Divisão *Compliance* e Controles Internos. A solicitação será analisada e então autorizada ou negada também via sistema.



Além disso, são efetuados testes periódicos em que são confrontadas as operações registradas e aquelas efetivamente cursadas pelos funcionários. Ressalte-se que todas as operações autorizadas devem ser realizadas exclusivamente por meio do *home-broker* do Banco do Brasil. Os resultados dos testes são levados ao conhecimento dos órgãos de administração competentes.

❖ **DESCREVA OS PROCEDIMENTOS ADOTADOS PARA PLDFT NO PROCESSO DE SELEÇÃO E ALOCAÇÃO E MONITORAMENTO NA NEGOCIAÇÃO DE ATIVOS.**

A BB DTVM realiza o monitoramento diário das negociações de ativos públicos e privados (mercado secundário), nas Carteiras e nos Fundos geridos por meio de testes específicos, em conformidade com o estabelecido nas Instruções da CVM e da ANBIMA.

❖ **CASO A GESTORA DESENVOLVA OUTRAS ATIVIDADES, DESCREVA SUA POLÍTICA DE CHINESE WALL, INFORMANDO COMO SE DÁ A PROTEÇÃO DE INFORMAÇÕES ENTRE DEPARTAMENTOS E OS POTENCIAIS CONFLITOS DE INTERESSE ADVINDOS DAS DIFERENTES ATIVIDADES.**

A BB Gestão de Recursos DTVM S.A. é uma subsidiária integral do Conglomerado Banco do Brasil, sendo responsável pela gestão dos fundos de investimento e carteiras administradas. Atendendo às Resoluções CMN 2451 e 2486 (*Chinese Wall*), a BB DTVM concentra-se exclusivamente em gestão de recursos de terceiros. A segregação é garantida pela autonomia administrativa, caracterizada pela existência de quadro de pessoal, Conselho de Administração, Conselho Fiscal e Diretoria próprios. Além disso, internamente a área de gestão de ativos é segregada da área de riscos e de gestão da empresa.

❖ **DESCREVA AS REGRAS E PROCEDIMENTOS DE MONITORAMENTO DAS OPERAÇÕES REALIZADAS FORA DE PLATAFORMAS ELETRÔNICAS DE NEGOCIAÇÃO, ENFATIZANDO ESTABELECIMENTO DE PREÇOS E FONTES DE REFERÊNCIA UTILIZADAS.**

As operações realizadas fora de plataforma eletrônica são relativas a negociações com títulos públicos, e são lançadas no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC). O acompanhamento é realizado via sistema interno – Front Office/ACF¹ que os informa das etapas de cada operação naquele sistema até a contabilização das mesmas.

Esse mercado é monitorado durante o dia pelos operadores, via telefone (mercado de balcão), plataforma BMF e plataforma CETIP, e informado, via sistema interno (Oferta), aos gestores como informação de mercado.

São monitorados relatórios, disponibilizados pelo Banco Central do Brasil, de operações realizadas no mercado e relatório da ANBIMA, referentes a preços indicativos para os diversos títulos.



¹Front Office/ACF - Administração de Carteiras de Fundos - Sistema desenvolvido pela Diretoria de Tecnologia do BB para servir de intermediário entre as operações fechadas pelos seus usuários e o SELIC - Sistema Especial de Liquidação e de Custódia, do Banco Central, através de troca de mensagens via STR - Sistema de Transferência de Reservas, também do Banco Central. Responsável também pelas contabilizações das operações fechadas e atualizadas no sistema SELIC, bem como os respectivos débitos e créditos devidos nas contas-correntes dos Fundos e Carteiras.

❖ COMO É VERIFICADA A ADEÇÃO DOS LIMITES DE RISCO, LIMITES LEGAIS OU REGULAMENTARES DAS POSIÇÕES DOS FUNDOS SOB GESTÃO DA GESTORA? A GESTORA UTILIZA ALGUM AGENTE EXTERNO? (EX.: CONSULTORIA)

O consumo dos limites é disponibilizado diariamente na intranet da BB DTVM para acompanhamento pelos gestores e pela área de risco, sendo o acesso restrito aos funcionários da gestora. Relatórios de Consumo também são encaminhados às divisões responsáveis pelos fundos, Gerentes Executivos e Diretoria, sendo as violações dos limites comunicadas tempestivamente às alçadas cabíveis, a fim de serem solucionadas.

Com relação à adesão dos fundos de investimento aos limites legais e regulamentares estabelecidos em sua política de investimento, a Divisão de *Compliance* e Controles Internos monitora diariamente as posições das carteiras, utilizando o sistema proprietário denominado Front Office, que inclui módulo de *Compliance*.

Caso haja algum fundo desenquadrado, a área de *Compliance* encaminha ao gestor um e-mail comunicando a ocorrência ao tempo em que solicita esclarecimentos para providências sobre o fato.

Mensalmente, a Diretoria recebe o Relatório Mensal de Conformidade no qual são reportadas todas as ocorrências.

❖ DESCREVA COMO SÃO TRATADOS OS CONFLITOS DE INTERESSE RESULTANTES DA PARTICIPAÇÃO OU ATUAÇÃO DOS SÓCIOS OU EXECUTIVOS EM OUTROS NEGÓCIOS, BEM COMO DE SUA EVENTUAL PARTICIPAÇÃO EM CONSELHOS FISCAIS E DE ADMINISTRAÇÃO.

A investidura em cargo da Diretoria Executiva requer dedicação integral, sendo vedado a qualquer de seus membros, sob pena de perda do cargo, o exercício de atividades em outras sociedades ou instituições com fim lucrativo, salvo:

I - Em sociedades subsidiárias ou controladas do Banco do Brasil S.A., ou em sociedades das quais este participe, direta ou indiretamente; ou

II - Em outras sociedades, por autorização prévia e expressa do Conselho de Administração. Os conselheiros, membros da Diretoria Executiva, empregados e colaboradores da BB DTVM são orientados e comprometem-se a abster-se da prática de qualquer ato (ação ou omissão) que possam provocar conflitos entre seus interesses pessoais e os da empresa ao tratar com



fornecedores, clientes, prestadores de serviços e qualquer pessoa física ou jurídica que realize ou venha a realizar negócios com a BB DTVM.

❖ A GESTORA RECEBE COMISSÕES/REMUNERAÇÃO (REBATE) PELA ALOCAÇÃO EM ATIVOS E VALORES FINANCEIROS? QUAIS AS REGRAS?

A BB DTVM não recebe comissões para alocação por investimentos em títulos e valores mobiliários distribuídos em balcão. Temos por política repassar ao fundo de investimento qualquer benefício obtido, em razão de nossa qualidade de Administrador.

No que se refere a pagamento de rebates a gestores externos pela alocação de recursos via Fundos de Fundos, as diretrizes e procedimentos estão consignados em contratos, e conformidade com os fundos previstos no §3º, artigo 92, da ICVM 555/14.

VIII – DECLARAÇÃO

Declaro para os devidos fins e efeitos legais, que as informações acima prestadas são a expressão da verdade, exatas e inequívocas, bem como, estar em conformidades com todas as obrigações legais no âmbito Municipal, Estadual e Federal, a que está sujeita a instituição. Declaro ainda estar ciente que, o presente cadastro não implica por parte do RPPS compromisso de aplicação de recursos. O Responsável se compromete, ainda, a atualizar as informações em caso de alterações que porventura venham ocorrer.

Rio de Janeiro, 30 de abril de 2021.

BB Gestão de Recursos
Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.





CERTIDÃO

Certifica-se que, nesta data, o (a) **BB GESTAO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.** (CNPJ 30.822.936/0001-69) encontra-se na situação **Autorizada em Atividade**, no segmento **Sociedade Distribuidora de TVM**, estando habilitada, nos termos da legislação em vigor, a praticar operações permitidas às instituições da espécie.

2. Certifica-se, ainda, que, quando da emissão desta certidão, constava em nossos cadastros que a instituição não se encontrava submetida a regime de administração especial temporária, de intervenção ou de liquidação extrajudicial por parte deste Banco Central.

3. Certidão emitida eletronicamente às 10:59:52 do dia 7/5/2021, com base na Lei nº 9.051, de 18 de maio de 1995. Para verificar a autenticidade deste documento acesse o endereço <https://www3.bcb.gov.br/certiaut/validar>.

Código de validação: aFJajWBkPsXGnpVCMZDk

Certidão emitida gratuitamente.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

CERTIDÃO

Certifico que **BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S/A** inscrita no CNPJ/MF sob o nº **30.822.936/0001-69**, figurou como acusada nos seguintes Processos Administrativos Sancionadores desta Comissão de Valores Mobiliários:

PAS CVM nº RJ1999/2024

Objeto: Infração ao § 5º, do artigo 1º, da Instrução CVM nº 215/94.

Decisão transitada em julgado: **Advertência**

PAS CVM nº RJ2001/12098

Objeto: Infringência ao disposto no artigo 71 e nos incisos I, III e IV do artigo 72 da Instrução CVM nº 302/99, quando do anúncio de rentabilidade dos Fundos de Renda Variável do Banco do Brasil veiculados no anexo à publicação "Carta Ouro" do mês de outubro de 2001.

Situação: **Arquivado por cumprimento de Termo de Compromisso**

PAS CVM nº 12/2003

Objeto: Inquérito instaurado no âmbito do Banco Central do Brasil, visando apurar eventuais irregularidades na condução dos interesses da BB DTVM S/A e de fundos sob sua administração. (A competência para a apuração desses fatos foi transferida para a CVM nos termos do art. 4º da Lei nº 10.303/01).

Situação: **Arquivado por cumprimento de Termo de Compromisso**

PAS CVM nº RJ2004/3648

Objeto: Por infringência ao disposto no artigo 32 da Instrução CVM Nº 215/94, legislação em vigor à época dos fatos, quando da não apresentação do comprovante de envio dos regulamentos dos Fundos acima mencionados ao investidor Carlitto Ernesto G. Petriglia, no período de maio a junho de 1997.

Situação: **Arquivado por prescrição.**

PAS CVM nº 15/2008

Objeto: Apurar eventual ocorrência de irregularidades em negócios realizados nos mercados futuros da BM&F em nome de fundos de investimento exclusivos do BB MILÊNIO& Fundo de Investimento em Cotas de Fundo de Investimento Multimercado Longo Prazo, bem como apurar as eventuais responsabilidades dos administradores e gestores dos fundos.

Decisão transitada em julgado: **Absolvição**

Adicionalmente, informamos que os processos que não têm natureza sancionadora estão disponíveis para consulta na página da CVM na internet, no link "Andamentos de Processos", em Destaques da página inicial.





A autenticidade do documento pode ser conferida no site https://sei.cvm.gov.br/conferir_autenticidade, informando o código verificador **0956638** e o código CRC **B17474D8**.

*This document's authenticity can be verified by accessing https://sei.cvm.gov.br/conferir_autenticidade, and typing the "Código Verificador" **0956638** and the "Código CRC" **B17474D8**.*
