Anexo I do Projeto Básico

FORMULÁRIO DE AVALIAÇÃO TÉCNICA

Edital de concorrência nº 3/2021 - Gestores de Recursos

ORGANIZAÇÃO E GESTÃO

**Dados Gerais**

1.1. Razão Social

[ ]

1.2. CNPJ

[ ]

1.3. Data de constituição

[ ]

1.4. Nome e cargo do responsável pelo preenchimento do formulário.

[ ]

1.5. Descrever as atividades desenvolvidas pela gestora:

• Produtos geridos

• Escopo das atividades desenvolvidas, além da gestão, pelo grupo econômico proprietário.

[ ]

***Rating* de Gestão**

1.6. A gestora é avaliada por agência classificadora de risco? Apresentar o *rating* mais atualizado e a agência classificadora.

[ ]

**Solidez**

1.7. Acerca do perfil dos clientes da gestora, apresentar o número de investidores e o prazo em que gere recursos de:

• EFPC

[ ]

• EAPC

[ ]

• RPPS

[ ]

• Qualificados

[ ]

• Profissionais

[ ]

• Total

[ ]

1.8. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob gestão, divididos entre:

• Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras

[ ]

• Títulos de renda fixa emitidos por companhia aberta não financeira

[ ]

• Cotas de fundos de investimento em crédito privado

[ ]

• Cotas de fundos de investimento imobiliário

[ ]

• Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios

[ ]

• Cotas de fundos de investimento em renda fixa

[ ]

• Outros valores mobiliários de obrigação ou coobrigação de pessoa jurídica de direito privado

[ ]

1.9. Informar o Patrimônio Líquido sob gestão em Fundos de Renda Fixa classificados como Crédito Privado no encerramento dos últimos 5 (cinco) exercícios.

[ ]

1.10. Informar o quadro societário da gestora, incluindo os nomes dos principais sócios e respectivas participações (informar os sócios que possuem, no mínimo, percentual de participação acima de 5%).

[ ]

1.11. Descrever o grupo econômico em que se insere a gestora, indicando:

• controladores diretos e indiretos

• controladas e coligadas

• participações da empresa em sociedades do grupo

• participações de sociedades do grupo na empresa

• sociedades sob controle comum

[ ]

1.12. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo os principais eventos societários, tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário.

[ ]

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

• Taxas com bases fixas

[ ]

• Taxas de performance

[ ]

• Taxas de ingresso

[ ]

• Taxas de saída

[ ]

• Outras taxas

[ ]

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

[ ]

1.15. O patrimônio líquido da empresa representa mais do que 0,02% dos recursos financeiros sob gestão e mais do que R$ 300.000,00 (trezentos mil reais)?

[ ]

**Governança**

1.16. Apresentar o modelo de negócio e a filosofia de administração da gestora.

[ ]

1.17. A gestora adere a códigos de autorregulação e códigos de ética e conduta que incentivam boas práticas de mercado, transparência e padrões éticos? Listar.

[ ]

1.18. Descreva os mecanismos de adesão dos funcionários ao código de ética e conduta.

[ ]

1.19. Descreva a política de investimentos pessoais e seu monitoramento.

[ ]

1.20. Descreva a política de alocação de capital dos sócios nos fundos da gestora.

[ ]

1.21. A gestora oferece instrumentos de investimentos ao funcionário e sócios? Detalhar.

[ ]

1.22. A gestora recebe comissões/remuneração (rebate) pela alocação em ativos? Qual o tratamento dado ao *soft dollar*? Há casos vigentes na gestora? Destacar o fluxo de aprovação.

[ ]

1.23. Em caso de exercer outras atividades além da gestão de recursos, descreva a política de *chinese wall*. Registrar as medidas de segregação e a utilização de dados comuns, bem como a autonomia e autoridade dos profissionais que desempenham funções relacionadas ao risco.

[ ]

1.24. A gestora atua, direta ou indiretamente na originação das emissões? Detalhar a relação com os emissores, como são mitigados os potenciais conflitos de interesses e indicar a existência de documentos internos que tratam do tema.

[ ]

1.25. Descrever a estrutura administrativa da empresa, conforme estabelecido no seu contrato ou estatuto social e regimento interno, identificando:

• atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico

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

• em relação aos membros da diretoria, suas atribuições e poderes individuais

• fornecer organograma

[ ]

1.26 Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços. Há procedimentos do tipo *know your partner* (KYP)?

[ ]

PROCESSO DE INVESTIMENTOS

**Fluxo**

2.1. Apresentar a filosofia de investimentos da empresa.

[ ]

2.2. Apresentar o fluxograma do processo de decisão do gestor.

[ ]

2.3. Há restrição a algum ativo na gestora? Apresentar a lista.

[ ]

**Análise**

2.4. Descrever como cada operação de crédito é analisada e aprovada. Detalhar a forma de análise das garantias das emissões e os critérios utilizados para análise do emissor.

[ ]

2.5. As questões e riscos ASG são considerados na análise de risco de crédito? Quais os critérios observados e o peso atribuído aos critérios ASG na análise?

[ ]

**Monitoramento**

2.6. Há reavaliação periódica da qualidade do crédito e de suas garantias? Informar os procedimentos e prazos de acompanhamento e monitoramento dos ativos de crédito privado contratados.

[ ]

RISCOS

**Conformidade**

3.1. 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. Indicar se há sistemas contratados para este fim.

[ ]

3.2. Descreva os procedimentos de adequação realizados pela gestora em função da edição da Resolução CMN 4.661/2018.

[ ]

**Controle**

3.3. Como é verificada a adesão dos limites de risco, limites legais ou regulamentares das posições dos fundos sob gestão da gestora? A gestora utiliza algum agente externo?

[ ]

3.4. Como é realizado o controle de:

• Leis e regulamentações

• Mandatos dos clientes

• Políticas e procedimentos

[ ]

3.5. Quais são os relatórios de riscos, com que frequência são gerados e o que contêm estes relatórios?

[ ]

3.6. Descrever as políticas, práticas e controles internos para a gestão do risco de liquidez das carteiras de valores mobiliários. Como é feita a classificação dos ativos de crédito privado?

[ ]

3.7. Descreva os procedimentos de verificação de ordens executadas e de checagem das posições das carteiras.

[ ]

3.8. Descreva os critérios adotados para distribuição do envio de ordens entre as corretoras aprovadas, incluindo o limite de concentração de volume de operações por corretora, se houver.

[ ]

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

[ ]

3.10. São realizados testes periódicos para verificação de segurança e integridade de sistemas? Com que frequência? Descreva-os.

[ ]

3.11. Quais os procedimentos adotados para a prevenção e detecção de práticas ilícitas de trading?

[ ]

3.12. Quais os procedimentos adotados de prevenção da lavagem de dinheiro e financiamento ao terrorismo?

[ ]

3.13. Informar, em relação aos últimos dois anos:

• por quantas ocorrências de desenquadramentos ativos os fundos de crédito privado do gestor passaram

• por quantas ocorrências de desenquadramentos passivos os fundos de crédito privado do gestor passaram

• se todas as ocorrências foram comunicadas à CVM

• se todas as ocorrências foram regularizadas e se provocaram perdas ao patrimônio do fundo

[ ]

3.14. A gestora possui um modelo proprietário de precificação de ativos? 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.

[ ]

3.15. Nos Fundos sob gestão da empresa, quem é o responsável pela precificação? Como são tratadas eventuais divergências com o modelo de precificação interna?

[ ]

**Contencioso**

3.16. Informar se a gestora possui algum tipo de default nos últimos 10 (dez) anos. A gestora contrata prestadores de serviços para auxiliar na recuperação desses créditos? Qual o tratamento dado estes casos?

[ ]

3.17. Qual o percentual de recuperação desses créditos?

[ ]

3.18. A gestora, independentemente do critério de apreçamento, possui algum procedimento ou estratégia no caso da iminência ou ocorrência de eventos de inadimplência? Descreva.

[ ]

3.19. Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados. Demonstrar sua aplicação em função da crise originada pelo COVID-19.

[ ]

3.20. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa ou seus gestores (ou ex-gestores em razão do exercício de suas atribuições na gestora) figurem no polo passivo, que sejam relevantes para os negócios da empresa, indicando:

• principais fatos

• valores, bens ou direitos envolvidos

[ ]

3.21. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que a empresa ou seus gestores (ou ex-gestores em razão do exercício de suas atribuições na gestora) tenha figurado no polo passivo.

• principais fatos

• valores, bens ou direitos envolvidos

[ ]

3.22. Informar, se houver, a existência de pessoas politicamente expostas que tenham sido envolvidas em escândalos de corrupção ou em investigações de qualquer natureza que possam representar potencial risco de imagem aos seus clientes na empresa.

[ ]

RECURSOS

**Equipe**

4.1. Em relação aos gestores de crédito privado, de riscos, responsável pelo compliance e diretores de investimento e administração, apresentar os currículos com histórico mínimo de 10 (dez) anos dos seguintes profissionais:

• Experiência profissional

• Certificações

• Formação acadêmica stricto sensu

• Cursos latu sensu concluídos

• Premiações

• Histórico / PL / Performance dos Fundos de Crédito Privado geridos (apenas para gestores de crédito privado)

[ ]

4.2. Descrever as principais mudanças nos últimos 5 (cinco) anos, nas equipes de risco, gestão e análise.

[ ]

4.3. O gestor incentiva a educação continuada de seus quadros? Descrever as políticas adotadas e os resultados obtidos.

[ ]

4.4. No que se refere as práticas de remuneração empregadas pela gestora, destacar:

• as regras de remuneração ou comissionamento dos profissionais e associados

• os mecanismos de retenção de talentos

[ ]

4.5. Há diferenciação na avaliação de analistas e gestores? Descreva.

[ ]

4.6. Há diferenciação na avaliação entre a área de risco e a área de gestão de recursos? Descreva.

[ ]

4.7. De que forma a gestora inibe a tomada de risco excessiva por parte dos gestores?

[ ]

4.8. Descreva os mecanismos utilizados afim de minimizar o risco de pessoas-chave no processo de gestão dos recursos.

[ ]

4.9. Informar o quantitativo de profissionais da gestora, divididos entre:

• sócios

[ ]

• colaboradores

[ ]

• equipe de crédito

[ ]

**Estrutura tecnológica**

4.10. Descreva a estrutura tecnológica, os protocolos de recursos de manutenção, backup e redundância de informações, desktops e servidores.

[ ]

4.11. A gestora utiliza *research* próprio ou de terceiros? Quais os sistemas utilizados.

[ ]

4.12. Qual o nível de automação na execução das atividades de gestão de riscos e no fluxo de trabalho do front office? Descreva os sistemas utilizados e o grau de integração entre eles.

[ ]

4.13. Existe sistema de gravação de ligações telefônicas? Em caso positivo, qual a política de escuta das gravações?

[ ]

PERFORMANCE

5.1. A gestora possui Fundos de Investimentos com perfil de baixo risco de crédito? Indicar a relação. A Funpresp se reserva a prerrogativa de alterar a lista após consulta em plataforma especializada.

[ ]

Anexos ou link

6.1. Estatuto Social, acompanhado dos atos constitutivos e/ou modificativos, oficialmente arquivados e publicados.

[ ]

6.2. Documentação gerada na análise de um emissor e de uma emissão.

[ ]

6.3. Plano de continuidade de negócios

[ ]

6.4. Manual/Política de controles internos e compliance

[ ]

6.5. Manual/Política de gestão de risco

[ ]

6.6 Relatório de rating de gestão mais atualizado.

[ ]