**INSTITUTO DE GESTÃO PREVIDENCIARIA DO ESTADO DO PARÁ - IGEPREV**

**QUESTIONÁRIO DE AVALIÇÃO IGEPREV – INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - 2018**

Obs1: As informações prestadas devem seguir a ordem do questionário.

Obs2: As informações devem ser da Instituição Financeira dos fundos de investimento.

Obs3: Todos os campos devem ser preenchidos.

|  |  |
| --- | --- |
| **Instituição Financeira de Recursos de Terceiros:** |  |
| **Questionário Preenchido por:** |  |
| **Cargo:** |  |
| **Data:** |  |
| **Telefone e email de contato:** |  |

# 1) **INFORMAÇÕES SOBRE A EMPRESA**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **1 - INFORMAÇÕES CADASTRAIS** | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.1 | Razão Social: | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.2 | Nome de Fantasia: | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.3 | Endereço: | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.4 | CNPJ: | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.5 | Data de Constituição: | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.6 | Telefone : | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.7 | Website e E-mail: | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.8 | Quais são as autoridades regulatórias em que a empresa possui registro? Fornecer detalhes sobre os registros, tais como nome, data e nº de registro da atividade. | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.9 | Membro de associações de classe? Quais? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| **2 - INFORMAÇÕES INSTITUCIONAIS** | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.1 | Quadro societário: nomes dos principais sócios e respectivas participações (anexar Resumo Profissional). | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.2 | Principais alterações no quadro societário nos últimos cinco anos. | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.3 | Forneça o Organograma da Empresa. | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.4 | A empresa é signatária do Código de Regulação e Melhores Práticas da ANBIMA? Em caso afirmativo, citar o(s) Código(s). | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.5 | A empresa é signatária do Código de Ética da ANBIMA? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.6 | Os principais sócios ou os principais executivos detêm participação em outros negócios? Quais? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.7 | Os principais executivos exercem alguma atividade de representação ou governança (cargos em Conselhos, Diretorias, Comissões, Associações, Bolsas, etc.) em outras empresas ou entidades? Quais? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.8 | Responsável perante a CVM e tempo de experiência profissional como Gestor de Carteira e/ou Fundo de Investimento? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.10 | Descreva breve histórico da empresa, citando tempo de experiência de mercado com clientes do segmento Investidor Institucional. | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.11 A Instituição Financeira gerencia recursos de RPPS? Quanto tempo? | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.12 | A Empresa possui Manual de Compliance, Manual de Risco, Manual de marcação a mercado, Manual de Gestão de Liquidez, Política de *Suitability*. Em caso afirmativo, favor anexar. | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.13 | Cite os Comitês formais, a sua composição em termos de cargos, a frequência com que são realizadas as suas reuniões e a forma como são registradas suas decisões. | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2.14 | Se o grupo econômico da empresa presta serviços de administração, controladoria e custódia descreva a estrutura e o relacionamento com a empresa de gestão (anexar Resumo Profissional) | | | | | | | | | | | | | | |
| **3 - NÚMEROS DA EMPRESA** | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3.1 – Preencha a Tabela abaixo com os valores correspondentes aos números da Empresa. | | | | | | | | | | | | | | | |
| |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | | Ano | Patrimônio sob gestão (posição de final de período) | Número de pessoas que trabalham na empresa | Número de portfólios sob gestão | | 2013 |  |  |  | | 2014 |  |  |  | | 2015 |  |  |  | | 2016 |  |  |  | | 2017 |  |  |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3.2 | Tipologia dos portfólios sob gestão (\* sem dupla contagem) | | | | | | | | | | | | | | |
| * Fundos:   Domicílio local  Domicílio em outro país | | | | | | | N º | | % Carteira | | | | | | |
| * Clubes | | | | | | |  | |  | | | | | | |
| * Carteiras   Domicílio local   * Res. Nº 2.689 | | | | | | |  | |  | | | | | | |
| 3.3 | Como os ativos sob gestão estão divididos conforme as seguintes categorias de fundos de investimento? | | | | | | | | | | | | | | |
| Tipo | | | | | | | | Nº | | Exclusivos | | | | % total | |
| * Curto Prazo | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * Referenciado | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * Cambial | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * Renda Fixa | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * Multimercado | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * Dívida Externa | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * Ações | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * FIDC | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * FIP | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * FIEE | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * FII | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * Fundo de Índice (ETF) | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
| * Outras categorias | | | | | | | |  | |  | | | |  | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3.5 | Considerando o volume total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos cinco maiores distribuidores ou alocadores? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3.6 | Atualmente, qual é o percentual do volume sob gestão que são originados especificamente de aplicações da própria Empresa (incluindo controladores, coligadas, subsidiárias, seus sócios e principais executivos)? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3.7 | Qual a distribuição do passivo segundo tipologia de investidor? | | | | | | | | | | | | | | |
| Tipo | | | | | | | | | | | | | nº | | % passivo |
| * Pessoas Físicas | | | | | | | | | | | | |  | |  |
| * Empresas | | | | | | | | | | | | |  | |  |
| * Instituições Financeiras/ Seguradoras/ Soc. de Capitalização | | | | | | | | | | | | |  | |  |
| * Investidores Institucionais Previdenciários | | | | | | | | | | | | |  | |  |
| * Distribuidores, Alocadores (inclui fundos de fundos de terceiros e *family offices*) | | | | | | | | | | | | |  | |  |
| * Investidor Estrangeiro | | | | | | | | | | | | |  | |  |
| * Governo | | | | | | | | | | | | |  | |  |
| 3.8 | Considerando o volume total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos 10 maiores clientes? Fornecer o percentual detido por cada um deles. | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| **4 - RECEITAS DA EMPRESA** | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4.1 | Qual a estrutura de receitas da Empresa? (gestão, performance, comissões, rebates etc.) | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4.2 | Qual parcela do resultado da Empresa vem da atividade de gestão de carteiras? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4.3 | A receita de Taxa de Administração é suficiente para cobrir os custos da Empresa? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| **5 - RECURSOS HUMANOS** | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5.1 | Quais as regras de remuneração ou comissionamento dos funcionários e associados? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5.2 | Quais são os mecanismos de retenção de talentos usados pela Empresa? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5.3 | Existe uma política para treinamento e desenvolvimento profissional dos funcionários/associados? Qual? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5.4 Qual a titulação da equipe técnica da asset? Considerar a última titulação.   |  |  |  | | --- | --- | --- | | **TITULAÇÃO** | **QUANTIDADE** | **%** | | **Graduação / Especialização** |  |  | | **Mestrado / Doutorado** |  |  | | **PHD** |  |  | | **TOTAL** |  |  | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **6 - INFORMAÇÕES GERAIS** | | | | | | | | | | | | | | | |
| 6.1 | A empresa já recebeu alguma premiação por publicações ou entidades no que tange à qualidade e ao histórico da Instituição? Quais? | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| **7 - INFORMAÇÕES OPERACIONAIS** | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.1 - Análise Econômica e Pesquisa | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.1.1 | Descreva a estrutura de análise econômica e de pesquisa da empresa (anexar Resumo Profissional) | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.1.2 | | Principais mudanças na equipe de pesquisa nos últimos cinco anos | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.1.3 | | Utiliza *research* próprio ou de terceiros? Em que proporções? | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.2 – GESTÃO DE RECURSOS | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.2.1 | | Descreva a estrutura de gestão de recursos da empresa (anexar Resumo Profissional) | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.2.2 | | Principais mudanças na equipe da Instituição Financeira nos últimos cinco anos. | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.2.3 | | Que serviços ou sistemas são contratados para apoio da Instituição Financeira? | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.2.4 | | Qual o processo de seleção e acompanhamento das corretoras? Liste as corretoras aprovadas | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.2.5 | | Como a gestão controla o prazo médio dos títulos para fundos de longo prazo, para fins de sua classificação tributária? | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3 – RISCO | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.1 – ESTRUTURA | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.1.1 | | | | Descreva a estrutura de gerenciamento de riscos da empresa (anexar Resumo Profissional) | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.1.2 | | | | Quem é o responsável pela área e a quem se reporta? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.1.3 | | | | Principais mudanças na equipe de risco nos últimos cinco anos. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.1.4 | | | | Que serviços/sistemas são utilizados para apoio no controle de risco? São desenvolvidos internamente ou contratados junto a terceiros? Quem os fornece? Como foram escolhidos? Citar, especificamente, por tipo de risco (crédito, contraparte, preço, liquidez e operacional). | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.1.5 | | | | Quais são os relatórios de riscos, com que freqüência são gerados, o que contêm e quem recebe e analisa estes relatórios? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.2 - RISCO DE CRÉDITO | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.2.1 | | | | Descreva a metodologia de gestão do risco de crédito das carteiras. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.2.2 | | | | Como cada nova operação de crédito é analisada e aprovada? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.2.3 | | | | A empresa, independentemente do critério de precificação, possui algum procedimento ou estratégia no caso da iminência ou ocorrência de eventos de inadimplência? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.3 - RISCO DE CONTRAPARTE | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.3.1 | | | | Descreva a metodologia de gerenciamento do risco de contraparte. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.3.2 | | | | Como são selecionadas as contrapartes e aprovados seus limites? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.4 - RISCO DE PREÇO | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.4.1 | | | | Descreva a(s) metodologia(s) adotada(s) para a apuração do risco de preço (ex: VaR, *Stress Test*, *Stop loss*, etc). | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.4.2 | | | | Como são formalizados os controles de risco de preço? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.4.3 | | | | Como é realizado o controle e o monitoramento de limites das estratégias (ex.: *books* tais como volatilidades, direcionais, arbitragens etc)? Com que frequência de atualização? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.4.4 | | | | Nos casos de posições que ultrapassem seus limites, como é o processo de tomada de decisão para o reenquadramento? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.5 - RISCO DE LIQUIDEZ | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.5.1 | | | | Descreva a(s) metodologia(s) adotada(s) para a apuração do risco de liquidez, incluindo o tratamento de baixa liquidez e/ ou resgates excessivos. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.5.2 | | | | Como é realizado o controle e o monitoramento de limites das estratégias (ex.: *books* tais como volatilidades, direcionais, arbitragens etc)? Com que frequência de atualização? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.6 - RISCO OPERACIONAL | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.6.1 | | | | Descreva a metodologia de gestão do risco operacional. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.6.2 | | | | Descreva os procedimentos de confirmação de ordens executadas e de checagem das posições das carteiras e custódia. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.6.3 | | | | Descreva os principais pilares dos planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados pela sua empresa. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.6.4 | | | | Descreva a política de segurança da informação. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.6.5 | | | | Descreva a política de controle de acesso ao *Data Center* (físico e lógico). | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.6.6 | | | | Descreva o parque tecnológico atual da instituição. Citar *no-breaks*, capacidade dos servidores, *links* de internet e telefonia etc. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.6.7 | | | | | | A instituição possui filtro de e-mail, *firewall* e sistemas de antivírus? | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 7.3.6.8 | | | | | | São realizados testes periódicos para verificação de segurança e integridade de sistemas? Com que frequência? | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| **8 -** COMPLIANCE E AUDITORIA INTERNA | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.1 | | | | Quem são os responsáveis pelas áreas de *compliance* e auditoria interna e a quem se reportam? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.2 | | | | Descreva o processo para adesão ao Código de Ética e Conduta, bem como suas atualizações, pelas pessoas que trabalham na empresa. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.3 | | | | Descreva a política de investimentos pessoais e seu monitoramento. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.4 | | | | Existe fundo ou outro instrumento de investimento exclusivo para sócios e executivos da empresa? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.5 | | | | Como são verificados os procedimentos que visem ao combate à lavagem de dinheiro feitos pelos seus distribuidores. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.6 | | | | Caso a empresa desenvolva outras atividades, descreva sua política de chinese wall e de que forma é garantida a proteção de informação entre departamentos que não estejam envolvidos no mesmo projeto ou linha de negócio. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.7 | | | | No caso de a empresa utilizar serviços de administração, controladoria ou custódia prestados por empresa do mesmo grupo econômico, como se garante a segregação entre a área prestadora de serviço e a gestão de carteiras? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.8 | | | | Descreva as regras e os procedimentos para monitoramento da divisão de ordens, especificação de comitentes e operações entre carteiras. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.9 | | | | 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. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.10 | | | | Existe algum agente externo (ex.: consultoria), além do administrador, envolvido na verificação da adesão a limites de risco, limites legais ou regulamentares das posições dos fundos sob gestão da Empresa? | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 8.11 | | | | 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. | | | | | | | | | | | |
| **9 - QUESTÕES JURÍDICAS E LEGAIS** | | | | | | | | | | | | | | | |
| 9.1 | | | | Descreva como são tratadas as questões jurídicas e legais da empresa (departamento jurídico próprio ou consultoria de terceiros) | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 9.2 | | | | A empresa ou algum de seus dirigentes já foram punidos pela CVM, pelo Banco Central ou pelo Conselho de Recursos do Sistema Financeiro? Se positivo, informar o número do processo. | | | | | | | | | | | |
|  | | | | | | | | | | | | | | | |
| 9.3 | | | | | Existe algum processo contra a Empresa ou algum de seus dirigentes na CVM , no Banco Central ou no Conselho de Recursos do Sistema Financeiro? | | | | | | | | | | |
| **10 - ANEXOS** | | | | | | | | | | | **MARCAR ANEXOS ABAIXO** | | | | |
| 10.1 | | | Resumo Profissional | | | | | | | |  | | | | |
| 10.2 | | | Manual de Risco | | | | | | | |  | | | | |
| 10.3 | | | Manuais de Marcação a Mercado | | | | | | | |  | | | | |
| 10.4 | | | Manual de Compliance | | | | | | | |  | | | | |
| 10.5 | | | Código de Ética e Conduta | | | | | | | |  | | | | |
| 10.6 | | | Manual de Política de Exercício de Direito de Voto (*Proxy Voting*) | | | | | | | |  | | | | |
| 10.7 | | | Relatório de Rating | | | | | | | | |  | | | |
| 10.8 | | | Manual de Liquidez | | | | | | | | |  | | | |
| 10.9 | | | Política de *Suitability* | | | | | | | | |  | | | |

2) **DECLARAÇÃO**

Declaramos que este questionário foi preenchido, revisado e assinado por pessoas devidamente autorizadas a fazê-lo, respondendo esta instituição pela sua exatidão, veracidade e integridade da informação de todo o conteúdo prestado neste documento e de seus anexos.

Comprometemo-nos a manter todas as informações deste questionário devidamente atualizadas semestralmente, enviando nova versão do questionário aos distribuidores e alocadores nos meses de janeiro e julho, com data-base dezembro e junho, com exceção das informações contidas no Item 3 – Eventos Importantes, as quais serão atualizadas e comunicadas imediatamente após a sua ocorrência.

|  |  |
| --- | --- |
| Local: | Data: |
| Nome: | |
| Cargo: | |

Assinatura: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

# 3) **EVENTOS IMPORTANTES**

**1 - QUALQUER ALTERAÇÃO EM ALGUMA QUESTÃO DESSA SEÇÃO DEVE SER INFORMADA IMEDIATAMENTE APÓS SUA EFETIVAÇÃO, COM A INDICAÇÃO DA REFERIDA DATA.**

|  |  |
| --- | --- |
| 1.1 | Mudança societária que altere o controle acionário da empresa. |
|  | |
| 1.2 | Entrada e saída dos principais sócios. |
|  | |
| 1.3 | Alteração no quadro de profissionais responsáveis pelas atividades da empresa gestora, incluindo compliance e risco. |
|  | |
| **2 - ALTERAÇÕES DESDE A ÚLTIMA ATUALIZAÇÃO** | |
| 2.1 | Data da última atualização. |
|  | |
| 2.2 | Quais foram os fatos relevantes da empresa gestora desde a última atualização? |
|  | |
| 2.3 | Liste os itens alterados desde a última atualização do questionário. |
|  | |