



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 08.896.477/0001-09

Nome do Administrador de Carteira: BNY MELLON ALOCAÇÃO DE PATRIMÔNIO LTDA

Ano de competência: 2021

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A BNY Mellon Alocção de Patrimônio Ltda. (doravante denominada "BNYM Alocção") é uma empresa especializada na gestão de fundos de fundos ("asset allocation"), sendo subsidiária da ARX Investimentos Ltda. ("ARX") desde 2008. O serviço de asset allocation é prestado desde 2003 pela empresa.

Em dezembro de 2021, a empresa tinha aproximadamente de R\$ 500 milhões sob gestão, distribuídos em 26 fundos.

A gestão realizada pela BNYM Alocção é focada no investimento em outros fundos. Para tanto, a BNYM Alocção desenvolveu um processo de análise da estrutura das demais gestoras e fundos do mercado, por meio de procedimento de due diligence, onde são avaliadas suas políticas internas, robustez, estratégias desenvolvidas, governança e o desempenho desses fundos. O processo de gestão da BNYM Alocção envolve o relacionamento com seus cotistas/clientes, cada fundo é estruturado para atender aos interesses de investimento específicos destes cotistas.

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

Sem que houvesse mudança no controle final da BNYM Alocção, em 14 de novembro de 2018 foi aprovada a cessão e transferência da totalidade das cotas detidas pelo então sócio minoritário (representativas de 0,01% do capital social da Sociedade) para a MBC Investments Corporation, passando a MBC Investments Corporation a ser a nova sócia minoritária direta da BNYM Alocção.

b. Escopo das atividades

Não houve alteração na atividade principal desenvolvida pela empresa nos últimos cinco anos.

c. Recursos humanos e computacionais

Seguem abaixo as movimentações dos principais funcionários nos últimos 5 anos:

Entradas

janeiro/17	Ulisses Marins Gorito	Diretor de Compliance e Risco
julho/17	Guilherme Caldas Da Cunha Neto	Chief Risk Officer
julho/17	Guilherme Nascimento Legey Abry	Diretor de Compliance e Risco
janeiro/18	Pedro Henrique Giovenco Von Adamovich	Analista
junho/18	Rodrigo Alves Martins	Analista
março/21	Thomás Borsotto Monteiro	Analista

Saídas

maio/17	Ulisses Marins Gorito	Diretor de Compliance e Risco
maio/17	José Alberto Tovar Barreto de Melo	CEO
dezembro/17	Raphael Nogueira Silva	Gestor
abril/18	Pedro Henrique Giovenco Von Adamovich	Analista
março/20	Pedro Valente	Analista
março/21	Rodrigo Alves Martins	Analista

Não houve alteração relevante nos recursos computacionais da empresa nos últimos 5 anos.

d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Os principais procedimentos que foram criados/atualizados nos últimos 5 anos são:

Manual de Regras de Investimentos, Procedimentos Operacionais e Controles Internos - manual cujos principais objetivos são: i) formalizar as regras de investimentos que norteiam as decisões da equipe de gestão; ii) descrever os processos operacionais envolvidos na atividade de gestão; e iii) listar os controles internos realizados.

Manual de Risco - manual cujo objetivo é definir a estrutura da área de risco da BNYM Alocação e as métricas de risco de mercado utilizadas para monitorar os fundos sob a sua gestão.

Manual de negociação de títulos e valores mobiliários de renda fixa - manual cujo objetivo é a aderência da BNYM Alocação às melhores práticas de negociação de títulos e valores mobiliários de renda fixa indicadas pela Anbima.

Manual Técnico de Controle de Liquidez - manual cujo objetivo é monitorar o nível de solvência dos fundos de investimento, verificando um percentual mínimo de ativos em relação ao patrimônio líquido, cuja liquidez seja inferior ao prazo de cotização/resgate do referido fundo.

Manual de Compliance - Atualização periódica realizada pelo departamento de Compliance e Risco Operacional.

Código de Ética - Atualização periódica do Código de Ética, que engloba a Política de Investimentos Pessoais e o Código de Conduta.

Procedimento de Suitability - elaborado em decorrência da adesão da BNYM Alocação ao Código Anbima de Gestão de Patrimônio Financeiro.

3. Recursos Humanos

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

a. Número de sócios:

2

b. Número de empregados:

4

c. Número de terceirizados:

3

CPF	Nome
087.617.737-27	GUSTAVO SANCHES CASTELLO BRANCO
034.776.197-65	GUILHERME NASCIMENTO LEGEY ABRY

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:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Nome empresarial	Data da contratação	Descrição
KPMG Auditores Independentes	01/01/2010	O serviço prestado pela KPMG inclui a elaboração de relatórios de auditoria da BNYM Alocação e da ARX (sua controladora), em português e em reais, de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria contemplando o balanço patrimonial e as correspondentes demonstrações do resultado, dos resultados abrangentes, das mutações do patrimônio líquido e dos fluxos de caixa para cada exercício, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil (BR GAAP) para as demonstrações financeiras individuais e consolidadas. Adicionalmente, a KPMG é responsável por expressar uma opinião sobre as demonstrações financeiras da BNYM Alocação e de sua controladora.

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)

Sim

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

Demonstração Financeira: Não se aplica

Relatório: Não se aplica

6. Escopo das Atividades

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

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

A BNYM Alocação presta o serviço de gestão discricionária de recursos para fundos de investimentos.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

b. 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 BNYM Alocação faz a gestão dos seguintes produtos: Fundos de Investimento Multimercado, Fundos de Investimento em Ações, Fundos de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado e Fundos de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento em Ações.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

Os principais valores mobiliários objeto de gestão são: cotas de fundos de investimento em geral, títulos públicos e títulos privados. A maior parte dos fundos pode investir no exterior através dos fundos investidos. Cabe ressaltar que não é foco da BNYM Alocação o investimento direto em ativos que apresentam risco de crédito privado, mas os fundos investidos podem deter crédito privado em suas carteiras. Quando aplicável, o investimento em crédito privado somente é feito mediante análise prévia do risco do emissor e do ativo e deve ser previamente aprovado pelo Comitê de Alocação de Ativos.

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

Não

6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários, destacando:

a. Os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades

A BNYM Alocação atua exclusivamente na gestão de fundos. Não há atualmente a prestação de outro serviço alheio à gestão, o que reduz a possibilidade de conflito de interesses. Ainda assim, a BNYM Alocação como integrante do BNYM Group, adota políticas que têm como objetivo evitar potenciais conflitos de interesse na condução de seus negócios e reforçar a reputação e a integridade da empresa. Tais políticas, a que todos os funcionários devem observar, definem o que é um conflito de interesse e sua aparência, alertam sobre problemas que podem ser causados, auxiliam os funcionários a identificar uma situação de conflito de interesse, definem as responsabilidades de cada funcionário, inclusive com relação ao sigilo das informações e notificam sobre os procedimentos que devem ser seguidos no tratamento de situações de conflitos.

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

O BNYM Group oferece uma série de produtos e serviços financeiros no Brasil e no exterior através de suas diversas sociedades. No Brasil, outras sociedades integrantes do BNYM Group oferecem serviços de administração de fundos, controladoria de fundos e carteiras e custódia. Apesar de existir um potencial conflito de interesse pelo fato da BNYM Alocação poder contratar tais serviços, o modelo de negócios prevê uma total transparência, obedecendo aos princípios de Chinese Wall, inclusive de segregação física, de recursos humanos, de recursos operacionais e computacionais. Em seu processo de seleção de fundos, a BNYM Alocação pode escolher para investimento os fundos geridos pela ARX, sua controladora, podendo gerar benefícios (ainda que indiretos) para a ARX. Entretanto, a ARX e seus fundos se sujeitam ao mesmo processo de avaliação e de due diligence dos demais gestores e fundos, selecionados para investimento pela BNYM Alocação. Existe, ainda, um controle para disclosure aos clientes caso o percentual de determinada carteira alocado em fundos geridos pela ARX ultrapasse um valor pré-determinado. Cabe ressaltar que o departamento de Compliance e Risco Operacional é compartilhado com outra sociedade que faz parte da linha de negócios de investment management do BNYM Group no Brasil (da qual a BNYM Alocação faz parte). Ademais, além de responder ao diretor de Compliance da BNYM Alocação, o departamento de Compliance e Risco Operacional tem reporte direto para o Head of Risk and Compliance for Investment Management EMEA and LatAM do BNYM Group. Além do departamento de Compliance e Risco Operacional, o diretor de Risco da BNYM Alocação também é compartilhado com outra sociedade que faz parte da linha de negócios de investment management do BNYM Group no Brasil.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
a. Número de investidores	50	0	50

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	45	0	45
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	2	0	2
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	1		1
xi. Investidores não Residentes	2		2

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	50	0	50

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 481.437.611,00	R\$ 0,00	R\$ 481.437.611,00

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

R\$ 0,00

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Valor	Nome
R\$ 62.243.270,78	
R\$ 53.983.950,88	
R\$ 52.490.720,14	
R\$ 25.858.942,71	
R\$ 22.843.455,24	
R\$ 22.500.191,65	
R\$ 18.885.616,83	
R\$ 17.977.635,29	
R\$ 14.937.874,79	
R\$ 13.090.911,51	

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\$ 385.823.361,00	R\$ 0,00	R\$ 385.823.361,00
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 81.128.888,00	R\$ 0,00	R\$ 81.128.888,00
iii. Instituições Financeiras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
vii. Seguradoras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	R\$ 0,00		R\$ 0,00
ix. Clubes de Investimento	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
x. Fundos de Investimento	R\$ 2.273.093,00		R\$ 2.273.093,00
xi. Investidores não Residentes	R\$ 12.212.269,00		R\$ 12.212.269,00

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\$ 481.437.611,00	R\$ 0,00	R\$ 481.437.611,00

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

a. Ações	R\$ 19.037.557,00
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\$ 185.988.446,00
e. Cotas de fundos de investimento em participações	R\$ 250.561,00
f. Cotas de fundos de investimento imobiliário	R\$ 0,00
g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R\$ 373.972,00
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 63.253.921,00
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 201.057.124,00
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ 0,00
k. Outros valores mobiliários	R\$ 0,00
l. Títulos públicos	R\$ 9.696.711,00
m. Outros ativos	R\$ 1.779.320,00
Total	R\$ 481.437.612,00

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

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não há.

7. Grupo Econômico

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

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
04.408.128/0001-40	ARX Investimentos Ltda
26.817.297/0001-76	MBC Investments Corporation

b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
13.395.186/0001-77	BNY Mellon Participações Ltda
02.201.501/0001-61	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.
05.236.848/0001-38	BNY Mellon Administração de Ativos Ltda
42.272.526/0001-70	BNY Mellon Banco SA

c. Participações da empresa em sociedade do grupo

CNPJ	Nome
-	Não Informado

d. Participações de sociedades do grupo na empresa



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

CNPJ	Nome
04.408.128/0001-40	ARX Investimentos Ltda

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

O departamento técnico da BNYM Alocação é composto por 2 membros (um diretor e um analista) e é responsável por fazer o acompanhamento da indústria de fundos e todas as análises necessárias para o processo de gestão das carteiras, adequando as possibilidades de investimento ao perfil de cada cliente.

A BNYM Alocação possui ainda um colaborador responsável pelas tarefas de suporte a esse processo, como a manutenção e operação do sistema proprietário de gestão da empresa, controle de caixa dos fundos sob gestão e verificação de conformidade das carteiras.

Os mesmos membros do departamento técnico compõem o Comitê de Alocação de Ativos, que é responsável por discutir cenários e a alocação ótima das carteiras. O Comitê é responsável também pelo processo de análise da estrutura de outras gestoras e fundos do mercado, por meio de procedimento de due diligence, em que são avaliadas suas políticas internas, robustez, estratégias desenvolvidas, governança e, naturalmente, o desempenho desses fundos.

Há também um Comitê de Governança e Compliance. Dentre as principais atribuições desse Comitê estão:

Acompanhar a adequação das práticas adotadas pela empresa à legislação e regulação aplicáveis, bem como às suas políticas internas, reportando eventuais apontamentos para a alta administração;

Reportar os controles de regulamento realizados no período;

Dar ciência sobre os resultados dos testes de compliance; e

Recomendar melhorias em qualquer processo do negócio.

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

O Comitê de Alocação de Ativos se reúne formalmente uma vez por mês, podendo haver convocação de reuniões extraordinárias a qualquer momento, caso seja necessário. O Comitê é atualmente formado pelo diretor e dois analistas. As decisões tomadas pelo comitê são registradas em ata, circulada aos membros do mesmo.

O Comitê de Governança e Compliance se reúne trimestralmente e é composto pela alta administração da BNYM Alocação (diretores), pela Head of Compliance and Operational Risk IM Brazil e pelos responsáveis pelos seguintes departamentos: Gestão; Operacional; Compliance; Jurídico; e Risco de Mercado. Os assuntos do Comitê são registrados em atas, registrando-se os membros participantes das reuniões, os ausentes, bem como a participação extraordinária de outros que não façam parte do Comitê.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

- Diretor responsável pela administração de carteiras: Gustavo Sanches Castello Branco - Responsável pela gestão das carteiras, com poder para tomar as decisões de investimento, adequando as possibilidades de investimentos ao perfil de cada cliente.

- Diretor de Risco/ Diretor de Compliance: Guilherme Nascimento Legey Abry - Responsável pela supervisão dos controles de risco feitos pelo Chief Risk Officer. Adicionalmente, é responsável por verificar o cumprimento do Código de Ética (que engloba a Política Pessoal de Negociação de Ativos e o Código de Conduta), do Manual de Compliance e demais políticas e procedimentos internos da BNYM Alocação, bem como o cumprimento das regras aplicáveis às suas atividades, determinando, caso identificados quaisquer descumprimentos, as necessárias medidas corretivas de modo a sanar tais violações, incluindo o aprimoramento de controles internos.

No exercício de suas atribuições, o diretor de Risco e Compliance age com independência e não atua em funções relacionadas à administração de carteiras de valores mobiliários, à intermediação e distribuição ou à consultoria de valores mobiliários, ou em qualquer atividade que limite a sua independência, na BNYM Alocação ou fora dela. Em relação à representação da BNYM Alocação, os diretores agem em conjunto entre si ou em conjunto com um procurador.

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
00.003.477/61 97-65	GUILHERM E NASCIMENT O LEGEY ABRY	48	Engenheiro	Diretor de Risco e Compliance	01/07/2017	Indeterminado	COO / Diretor de PLDFT
00.008.761/77 37-27	GUSTAVO SANCHES CASTELLO BRANCO	45	Engenheiro	Diretor de Administraçã o de Carteiras	01/12/2013	Indeterminado	Gestor
00.007.035/86 57-21	Tatiana	45	Engenheira	Head of Compliance and Operational Risk	01/08/2016	Indeterminado	N/A
123.487.847- 00	Fabiano Bitiato	33	Advogado	Legal Counsel	01/03/2017	Indeterminado	N/A

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	00.008.761/7737-27	GUSTAVO SANCHE S CASTELLO BRANCO	45	Engenheiro	Diretor de Administração de Carteiras	21/01/2014	indeterminado	Gestor	Graduação em Engenharia de Produção Elétrica - PUC RJ (conclusão em 1999) Mestrado em Engenharia de Produção - Área de Finanças e Análise de Investimentos - PUC RJ (conclusão em 2001)	CGA CPA-20
8.5 (COMPLIANCE)	00.003.477/6197-65	GUILHERME NASCIMENTO LEGEY ABRY	48	Engenheiro	Diretor de Risco e Compliance	12/07/2017	indeterminado	N/A	Graduação - UFES - 1996 Mestrado - UFRJ - 1999	FRM pela GARP (Global Association of Risk Professionals) - 2006
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	00.003.477/6197-65	GUILHERME NASCIMENTO LEGEY ABRY	48	Engenheiro	Diretor de Risco e Compliance	12/07/2017	Indeterminado	N/A	Graduação - UFES - 1996 Mestrado - UFRJ - 1999	FRM pela GARP (Global Association of Risk Professionals) - 2006

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída
00.003.477/6197-65	GUILHERME NASCIMENTO LEGEY ABRY	Credit Suisse Hedging Griffo	Risk Manager	Risk Manager	12/01/2016	07/01/2017
00.003.477/6197-65	GUILHERME NASCIMENTO LEGEY ABRY	ARX Investimentos LTDA	Diretor de Gestão de Risco	Diretor de Gestão de Risco	05/01/2011	12/01/2016
00.003.477/6197-65	GUILHERME NASCIMENTO LEGEY ABRY	BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	Superintendente de Risco de Mercado	Superintendente de Risco de Mercado	05/01/2011	12/01/2016
00.003.477/6197-65	GUILHERME NASCIMENTO LEGEY ABRY	HOPE CONSULTORIA	Consultor	Consultor	05/01/2004	12/01/2004
00.003.477/6197-65	GUILHERME NASCIMENTO LEGEY ABRY	TECHNIP COFLEXIP	Consultor	Consultor	09/01/2002	12/01/2004
00.003.477/6197-65	GUILHERME NASCIMENTO LEGEY ABRY	BNY Mellon Asset Management	Investment Manager	Investment Manager	10/01/2001	08/01/2002
00.008.761/7737-27	GUSTAVO SANCHES CASTELLO BRANCO	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM SA	Gerente de Pricing	Gerente de Pricing	03/01/2002	02/01/2003

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

A principal área de atuação da BNYM Alocação é a gestão de Fundos de Investimento em Cotas ("FICs") exclusivos ou restritos, para investidores Private ou Institucionais. Logo, o diferencial da empresa é a seleção dos melhores fundos disponíveis para investimento no mercado, o acompanhamento desses e de novos fundos e a elaboração de carteiras de investimentos diversificadas e adequadas ao perfil de cada cliente.

Conforme explicado anteriormente, o departamento técnico da BNYM Alocação é responsável por fazer o acompanhamento da indústria de fundos, indicando aos gestores as principais oportunidades para os recursos sob gestão. Os gestores se utilizam desses dados para compor a carteira dos fundos geridos, adequando as possibilidades de investimento ao perfil de cada cliente. A BNYM Alocação possui ainda um colaborador responsável pelas tarefas de suporte a esse processo, como a manutenção e desenvolvimento do sistema proprietário de gestão da empresa, controle de caixa dos fundos sob gestão e verificação de conformidade das carteiras.

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

CMA Series: sistema utilizado para coleta de informações;e

Economática: sistema utilizado para coleta de dados.

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

a. Quantidade de profissionais

3



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

O departamento de Compliance e Risco Operacional é compartilhado com outra sociedade que faz parte da linha de negócios de investment management do BNYM Group no Brasil (da qual a BNYM Alocação faz parte), sendo responsável por garantir que o funcionamento da empresa esteja em conformidade com a legislação e regulação em vigor, bem como com as políticas internas da BNYM Alocação e do BNYM Group como um todo.

Seguem abaixo os principais processos e rotinas de controle da área:

- Monitorar e informar alterações na regulamentação em vigor para todos os colaboradores da empresa;
- Desenvolver e atualizar as políticas e procedimentos de compliance e risco operacional, incluindo o respectivo monitoramento, bem como a divulgar as políticas e procedimentos globais do BNYM Group aplicáveis à BNYM Alocação;
- Monitorar o controle de enquadramento dos fundos geridos pela BNYM Alocação, acompanhando eventual reenquadramento que se faça necessário;
- Intermediar notificações/comunicações com os órgãos reguladores;
- Realizar os testes de compliance para monitorar o cumprimento da legislação, regulação e políticas e procedimentos internos;
- Acompanhar os testes referentes aos controles e procedimentos da equipe do BNYM Group responsável pelo combate à lavagem de dinheiro e demais crimes financeiros;
- Revisar e aprovar materiais de divulgação, respostas a DDQs e publicações em geral;
- Controlar os investimentos pessoais dos funcionários de acordo com a política corporativa aplicável; e
- Ministrar treinamentos.

Adicionalmente, o departamento de Compliance e Risco Operacional é responsável por estabelecer políticas e processos para a gestão do Risco Operacional e coordenar a disseminação de políticas de melhores práticas relacionadas à gestão de risco para todas as linhas de negócio da instituição. O gerenciamento do risco operacional tem como objetivo prevenir e minimizar erros e falhas na prestação dos serviços que possam gerar impacto financeiro ou reputacional, além de desenvolver e realizar um processo contínuo de monitoramento de riscos.

Algumas das principais ferramentas para gestão do risco operacional são:

- Acompanhamento dos indicadores chave de risco
- Registro e monitoramento dos eventos de risco operacional
- Relatórios do Risk Control Self-assessment

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

Anualmente o departamento de Compliance e Risco Operacional prepara um plano de atuação que programa e descreve todas as atividades de controle e monitoramento que serão realizadas durante o ano seguinte. O programa de monitoramento inclui testes sobre as políticas corporativas, regulação e legislação aplicáveis às atividades da BNYM Alocação.

Todos os novos funcionários participam do treinamento relativo aos procedimentos de compliance (Induction Training), além de assinarem um termo de compromisso com o Código de Ética (que engloba a Política de Investimentos Pessoais e o Código de Conduta). Os principais pontos abordados neste treinamento inicial são: ética e conduta, políticas de combate à lavagem de dinheiro e demais crimes financeiros e política de investimentos pessoais. Além disso, periodicamente, são ministrados treinamentos de compliance para todos os funcionários da BNYM Alocação.

Adicionalmente, são utilizados dois sistemas proprietários que auxiliam o monitoramento e controle de risco operacional e, ainda, um sistema proprietário para registro e acompanhamento de testes de compliance e eventuais planos de ação.

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

Além do reporte matricial ao diretor de Compliance da BNYM Alocação, o departamento de Compliance e Risco Operacional reporta-se diretamente ao BNYM Group no exterior, mais especificamente ao Head of Risk and Compliance for Investment Management EMEA and LatAM, de modo a assegurar duplamente sua independência. Note-se que, em que pese a existência do Comitê de Governança e Compliance mencionado no item 8.1, este órgão não é uma instância deliberativa para questões de compliance e risco, mas sim de reporte à alta administração da instituição, de modo que seu funcionamento não afeta a independência do departamento em questão.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Seguem abaixo as atividades desenvolvidas pelo Chief Risk Officer da BNYM Alocação:

Risco de Mercado: O controle de risco é feito mensalmente através do monitoramento de Stress Test dos fundos. Os fundos geridos pela BNYM Alocação são, em sua maioria, FICs e, por esse motivo, a metodologia utilizada para o cálculo do Stress dos fundos foi desenvolvida internamente e considera, quando aplicável, o limite de Stress dos fundos investidos.

Avaliação da Estrutura de Risco das Gestoras dos Fundos Investidos: Conforme explicado anteriormente, o Comitê de Alocação de Ativos é responsável também pelo processo de análise da estrutura de outras gestoras e fundos do mercado, por meio de procedimento de due diligence, em que são avaliadas suas políticas internas, robustez, estratégias desenvolvidas, governança e, naturalmente, o desempenho desses fundos. Nesse processo, apenas gestores e fundos que atendam a determinados requisitos são aprovados e elegíveis a investimentos. Dentre os requisitos avaliados, destacam-se: equipe e estrutura de gestão, organização societária, ativos normalmente utilizados no portfólio de cada fundo, histórico de desempenho, equipe e, em especial, a estrutura de controle de risco, autonomia da área de risco e histórico de utilização de risco. O Chief Risk Officer é responsável por avaliar a estrutura e controles de risco de cada gestora e aprová-la, se aplicável.

Controle de Liquidez: O controle de liquidez dos fundos condominiais geridos pela BNYM Alocação é executado semanalmente e considera a concentração do passivo, assim como o prazo de resgate dos fundos investidos. O Chief Risk Officer envia o Relatório de Liquidez de Fundos Abertos para a área de gestão, para o diretor de Risco e para o departamento de Compliance e Risco Operacional. Caso algum fundo condominial apresente um nível de liquidez menor do que o mínimo estabelecido (conforme metodologia definida internamente), o Chief Risk Officer informará a equipe de gestão, o diretor de Risco e o departamento de Compliance e Risco Operacional. A equipe de gestão deverá realizar operações que visem o reenquadramento do fundo, mesmo que esse não ocorra de forma imediata (no caso de haver prazos de resgates, lock-ups ou outros que posterguem o momento de tal enquadramento).

Em complemento à análise de liquidez de cada fundo sob gestão, a BNYM Alocação realiza um controle interno da participação total da empresa no Patrimônio Líquido de cada fundo investido. O objetivo desse controle é monitorar riscos inerentes a uma exposição excessiva a um ativo, que poderia gerar perdas no caso de necessidade de resgates. Caso o somatório das posições dos fundos geridos pela BNYM Alocação em determinado fundo for maior do que 33% de seu Patrimônio Líquido, essa posição deverá ser justificada no relatório.

Risco de Crédito: O controle do risco de crédito é realizado sempre que há a intenção de compra de um ativo de crédito privado. A exposição em determinado título privado deverá respeitar os limites estabelecidos internamente, que variam conforme o rating local de cada ativo. Se o título privado não possuir rating, o limite máximo considerado será de 5% do patrimônio líquido do fundo, porém o ativo também estará sujeito à análise prévia de crédito e aprovação de limite pelo Chief Risk Officer. Além da adequação aos limites de exposição em crédito privado, a aquisição de ativos de crédito privado deverá ser precedida de análise sujeita à aprovação do Chief Risk Officer. Os parâmetros considerados na análise variam conforme o tipo de ativo e suas características. No caso de aquisição de ativos de crédito bancário (tais como CDBs e LFs), por exemplo, os emissores são divididos em 3 faixas de risco de crédito. A aquisição de ativos de crédito bancário de alto risco de crédito é vedada e a de médio risco está condicionada à avaliação e aprovação do mesmo no Comitê de Alocação de Ativos. Ativos de baixo risco de crédito não necessitam de análise prévia.

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

Todos os sistemas utilizados para controles de risco foram desenvolvidos internamente.

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

O Chief Risk Officer da BNYM Alocação é independente da área de gestão de recursos e reporta-se diretamente ao diretor de Risco. Adicionalmente, todos os controles executados pela área de gestão de risco são monitorados pelo departamento de Compliance e Risco Operacional, uma área independente e que possui reporte direto ao Head of Risk and Compliance for Investment Management EMEA and LatAM do BNYM Group.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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

0

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

N/A

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

N/A

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

N/A

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

N/A

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

Não há.

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:

A remuneração da empresa provém das taxas de administração e de performance (quando aplicável) cobradas dos fundos geridos pela BNYM Alocação, bem como do rebate eventualmente pago pelos fundos investidos, exclusivamente nos casos previstos na regulamentação em vigor.

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 (%):



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

0,00

e. Outras taxas (%):

0,00

Total (%):

100,00

9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:

Não há.

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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

O BNYM Group possui procedimentos globais que devem ser observados na seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços ("prestador"). Dentre esses procedimentos, para a contratação de qualquer prestador deve ser feita avaliação de risco de segurança da informação do serviço escopo de tal contrato. Para isso a linha de negócio submete o serviço que deseja contratar para avaliação de risco de segurança da informação, que é realizada pela área de Vendor Information Risk Management, respondendo a perguntas para determinação do perfil de risco do prestador e do serviço. Com base neste perfil e nas informações e evidências fornecidas pelo prestador, é realizada a avaliação de seus controles relacionados à segurança da informação, continuidade de negócios, privacidade e controles de tecnologia da informação de um modo geral. Adicionalmente, visitas às dependências do prestador podem ser realizadas com base no risco relacionado ao serviço terceirizado.

Com relação às corretoras utilizadas, a BNYM Alocação somente está autorizada a operar por meio de corretoras previamente aprovadas pelo Departamento de Compliance e Risco Operacional e incluídas na "Lista de Corretoras Pré-Aprovadas", ad referendum da aprovação de 2 (dois) membros do Comitê de Governança e Compliance. Uma vez selecionada uma corretora, a mesma deverá ser submetida à aprovação do Departamento de Compliance e Risco Operacional. Para serem aprovadas e constar na "Lista de Corretoras Pré-Aprovadas", as corretoras são avaliadas quanto à sua liquidez, reputação e capacidade de oferecer a melhor execução de ordens para as carteiras geridas, além de se sujeitarem a verificações de PLD.

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

A principal área de atuação da BNYM Alocação é a gestão de FICs. Dessa forma, a maior parte dos investimentos é feita através de fundos, em operações que não possuem custos transacionais.

Os principais custos de transação incorridos pelos clientes são aqueles referentes às taxas (de administração e performance) cobradas pelos fundos investidos. Essas taxas são consideradas, em conjunto com outros fatores qualitativos e quantitativos, no processo de criação da carteira de cada cliente. Em linha geral, busca-se investir em fundos que cobrem taxas condizentes com: o tipo de investimento realizado, as taxas cobradas por fundos similares e o risco incorrido pelo fundo. A avaliação das taxas cobradas pelos fundos candidatos a investimento é feita no processo de due diligence do Comitê de Alocação de Ativos da BNYM Alocação.

Nas eventuais compras de ativos diferentes de cotas de fundos, a BNYM Alocação busca concentrar a colocação de ordens em corretoras, previamente aprovadas pelo departamento de Compliance conforme procedimento próprio, que são capazes de fornecer qualidade no atendimento aliada a custos competitivos. Dentre os fatores qualitativos considerados, estão: capacidade de execução, disponibilidade de atendimento à BNYM Alocação e empenho em adquirir ativos no melhor preço possível.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Regras para tratamento de soft dollar

A BNYM Alocação poderá se utilizar de "soft dollars" para obter produtos ou serviços adicionais junto às corretoras, além do serviço de execução simples de ordens, desde que entenda que tais produtos ou serviços representam um benefício para seus clientes. A BNYM Alocação somente receberá tais produtos e serviços quando estes estiverem diretamente relacionados ao processo de tomada de decisão de investimento, e não às atividades administrativas da empresa. Todos os acordos de soft dollars, quando existentes, devem ser aprovados e monitorados pelo departamento de Compliance e Risco Operacional, para garantir que estejam de acordo com as regras aplicáveis.

Política de presentes e entretenimento

O relacionamento com clientes, fornecedores, prestadores de serviço, e outras linhas de negócio do BNYM Group é vital e deve ser transparente, objetivo, justo, e livre de conflitos. Desta forma existe uma política de presentes e entretenimentos que estabelece procedimentos para prevenir que tais conflitos surjam ou ocorram, evitando os prejuízos regulatórios e reputacionais que tais conflitos podem gerar.

A política de presentes e entretenimento é aplicável a todos os funcionários do BNYM Group e, de acordo com as condições estabelecidas na política, são exigidos reporte ou a pré-aprovação do departamento de Compliance em determinadas situações.

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

O Plano de Contingência da BNYM Alocação define quais e quantos funcionários serão necessários durante a ocorrência de qualquer desastre, e quais outros recursos serão indispensáveis para recomeçar as atividades de uma maneira progressiva. Os procedimentos de contingência são pré-definidos, mas podem ser alterados, dependendo do tipo de incidente. São realizados testes de vulnerabilidades nas conexões Internet, duas vezes ao ano, por empresa especializada. O teste de contingência para a BNYM Alocação é realizado uma vez ao ano para os sistemas em seu ambiente backup. O escopo desse plano é cobrir um desastre e/ou uma situação de contingência.

O Plano de Contingência tem os seguintes objetivos:

- Identificar as responsabilidades e criar procedimentos de notificação
- Gerar uma lista de recursos e equipamentos relevantes, bem como do pessoal requerido
- Identificar os processos considerados críticos e seus responsáveis, para que o plano de retomada desses processos no intervalo de 24 a 48 horas do desastre possa ser posto em prática
- Identificar os processos considerados importantes e seus responsáveis, para que o plano de retomada desses processos no intervalo de 48 a 120 horas do desastre possa ser posto em prática
- Identificar os processos que podem ser retomados em um tempo mais longo e seus respectivos responsáveis
- Identificar quais as pessoas (funcionários ou não) que serão contatadas em caso de desastre, com o intuito de suprir os recursos necessários ou dar assistência na recuperação do cenário
- Prevenir mal-entendidos ou incertezas quanto ao documento, ou sobre os testes e/ou procedimentos de revisão relevantes nele incluso
- Arquivar, proteger e estabelecer, para os arquivos vitais, procedimentos de retirada da empresa

As premissas para o Plano de Contingência são:

- O Manual de Contingência, suas cópias ou qualquer outro material considerado importante deverão estar guardados fora da empresa, facilitando o acesso no caso de desastre
- As fontes internas ou externas devem estar aptas a fornecerem os recursos citados no manual de acordo com as premissas nele estabelecidas
- O manual é testado em períodos regulares de tempo ou quando da sua atualização
- As pessoas consideradas "chave" deverão estar acessíveis quando da ocorrência do desastre
- Um escritório alternativo deve estar imediatamente acessível

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

Os fundos sob gestão da BNYM Alocação são, em sua maioria, FICs exclusivos ou restritos, para investidores Private ou Institucionais. Em se tratando de FICs, o controle de liquidez leva em consideração tão somente o prazo de cotização para resgate dos fundos investidos em relação ao prazo para resgate dos fundos geridos pela BNYM Alocação. Seguem abaixo os critérios adotados, de acordo com o passivo do fundo:

Fundos com público alvo restrito ou exclusivo: esses controles são desenvolvidos em conjunto com os próprios cotistas, uma vez que os prazos de resgate dos fundos geridos pela BNYM Alocação e suas respectivas políticas de investimento são determinadas e discutidas com periodicidade frequente com os próprios cotistas, considerando-se as necessidades de liquidez específicas daquele cotista ou grupo de cotistas. O processo contínuo de interação existente entre os gestores da BNYM Alocação e esses cotistas faz com que eles tenham ciência da composição de seus portfólios e das restrições de liquidez dos ativos que os compõem.

Fundos condominiais: o controle de liquidez baseia-se na análise da concentração do passivo do fundo condominial em relação à carteira de investimento, sempre levando em consideração os prazos de resgate dos fundos investidos em relação ao prazo de resgate do fundo sob gestão (fundo investidor). Assim, analisam-se as informações relativas ao passivo do fundo, mediante aplicação de uma metodologia própria, e adequa-se a carteira do fundo, de forma a suportar um resgate relevante por parte desse passivo.

Em complemento à análise de liquidez de cada fundo sob gestão, a BNYM Alocação realiza um controle interno da participação total da empresa no Patrimônio Líquido de cada fundo investido. Todos os controles são detalhados no Manual de Risco da empresa.

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

N/A

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

<https://www.bnymellon.com/br/pt.html>

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 *

Processo: 1017589-12.2017.4.01.3400-1 (numeração antiga: 2016.01.1.009627-5)

Vara/Tribunal: 20ª Vara Federal de Brasília

Autor: Postalís Instituto de Previdência Complementar dos Correios

Descrição: Ação de responsabilidade civil por supostos prejuízos sofridos no âmbito de fundos de investimento.

Principais Fatos: Apresentada contestação pelo BNY Mellon Alocação de Patrimônio.

Processo: 0267006-71.2019.8.19.0001

Vara/Tribunal: 2ª Vara Cível da Comarca da Capital do Estado do Rio de Janeiro

Autor: Postalís Instituto de Previdência Complementar dos Correios

Descrição: Ação de responsabilidade civil por supostos prejuízos sofridos no âmbito de fundo de investimento.

Principais Fatos: Apresentada contestação pelo BNY Mellon Alocação de Patrimônio. Houve declínio de competência em favor de uma das Varas Empresariais, conforme arguido pelo BNY Mellon Alocação de Patrimônio.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Valores, Bens ou Direitos Envolvidos: Ilíquido, a ser apurado em liquidação de sentença.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

11.2. 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 companhia não tem conhecimento de nenhum processo envolvendo Gustavo Castello Branco, que afete a sua reputação profissional.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

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

Não há.

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

a. Principais fatos

Não foram identificadas condenações do BNY Mellon Alocação de Patrimônio, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos, em processos que não estejam sob sigilo.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

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 companhia não tem conhecimento de nenhuma condenação transitada em julgado, prolatada nos últimos 5 (cinco) anos, em processos que não estejam sob sigilo, envolvendo Gustavo Castello Branco, que afete os seus negócios ou a sua reputação profissional.

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

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

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

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: 17/03/2022 - 10:25:00

Data de impressão: 17/03/2022

Hora de impressão: 10:26:42