

Manual de Compliance

GTI Administração de Recursos Ltda.

Versão:
Dezembro 2020

1. SUMÁRIO

- 1.1. Relatório de Controles Internos
 - a) Sumário Executivo
 - b) Objetivo
 - c) Estrutura de Controles Internos GTI
 - d) Escopo
 - e) Apresentação de resultados apurados

1. RELATÓRIO DE CONTROLES INTERNOS

1.1. Sumário Executivo

Este Manual de *Compliance* se aplica a todos os colaboradores da GTI Administração de Recursos Ltda. e tem como objetivo reportar as conclusões dos exames de *compliance* efetuados relativos ao ano de 2020, bem como notificar eventuais deficiências, com o estabelecimento de cronogramas de saneamento, quando for o caso.

Além disso, este relatório aborda a manifestação do diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários ou, quando for o caso, pelo diretor responsável pela gestão de risco a respeito das deficiências encontradas em verificações anteriores e das medidas planejadas, de acordo com cronograma específico, ou efetivamente adotadas para saná-las

O relatório presente resume o acompanhamento permanente do Diretor de Compliance quanto às regras, políticas, procedimentos e controles internos do administrador de carteira de valores mobiliários e da Instrução CVM 558, e a adoção de uma postura proativa e de rotinas e procedimentos periódicos e passíveis de verificação.

Desta forma, o presente relatório tem como objetivo atender aos requisitos estabelecidos no artigo 22 da Instrução CVM n.º 558, de 26 de março de 2015 e contribuir para o aprimoramento da estrutura de Controles Internos da GTI.

1.2. Objetivo

O Manual destaca que todos os integrantes devem agir com imparcialidade, boa fé, diligência, lealdade, profissionalismo e transparência.

O objetivo da GTI ao avaliar sua estrutura de controles internos é contribuir para a melhoria dos controles internos existentes, realizando análises periódicas no intuito de verificar a efetividade e conformidade com as melhores práticas de mercado.

A utilização de uma estrutura efetiva de controles internos certamente promove maior segurança sobre operações realizadas, bem como sobre a guarda, proteção e valor dos ativos e contribui para a eficiência operacional.

Esta estrutura efetiva também demanda testes periódicos de segurança no sistema de informações e também assegura o controle de informações de cunho confidencial.

Um programa de treinamento para os colaboradores também é implementado, mantido e executado periodicamente.

1.3 Estrutura de Controles Internos – GTI

A estrutura de Controles Internos se baseia no comprometimento e apoio dos sócios e colaboradores, visando estabelecer uma cultura adequada de controles e boas práticas de mercado que seja capaz de garantir um gerenciamento eficaz.

A GTI Administradora de Recursos Ltda. tem desenvolvido políticas, manuais e controles internos visando à mitigação de riscos e perdas potenciais e elevar a robustez de processos e procedimentos internos.

Dessa forma a GTI tem procurado enfatizar uma estrutura abrangente e sólida de monitoramento, avaliação e gestão dos riscos.

1.4 Escopo

As informações consideradas neste relatório são referentes ao ano de 2020 e abordam os seguintes assuntos:

- ✓ Conduta e Ética;
- ✓ Investimentos Pessoais;
- ✓ Prevenção à Lavagem de Dinheiro;
- ✓ Controles Internos;
- ✓ Segurança de Informação;
- ✓ Continuidade de Negócio;
- ✓ Rateio e Divisão de Ordens;
- ✓ Combate a Corrupção;
- ✓ Treinamento e reciclagem de colaboradores;
- ✓ Gestão de Riscos
- ✓ Seleção e alocação de ativos
- ✓ Seleção, contratação e monitoramento de terceiros;

1.5 Apresentação Detalhada dos Resultados

Neste item apresentamos as conclusões dos exames efetuados, contendo as deficiências encontradas, as recomendações de melhorias, cronograma de saneamento, e, quando for o caso, a manifestação do Diretor Responsável pela Administração de Carteiras de Valores Mobiliários ou do Diretor de Gestão de Risco.

Escopo detalhado dos exames efetuados:

Conduta e Ética;

Assinatura do Termo de Responsabilidade e Confidencialidade:

Todos os membros assinaram termo de responsabilidade e confidencialidade desde que ingressaram na GTI. Tivemos ao longo do ano de 2018 a entrada dos sócios Paolla Mello e Eduardo Sancovsky, assim como dos colaboradores Natalia Oliveira da Silva. Em 2019, houve a entrada do colaborador Rafael Levy. Já em 2020 tivemos a entrada dos analistas Maurício Horn, Marco Aurélio e Eduardo Lazzaretti e Andressa Alves na área de suporte. A empresa mantém os termos em seus arquivos físicos e digitais.

O Código de Conduta e Ética está presente no site da GTI (www.gtinvest.com.br) na seção de produtos em adequação a nova ICVM 558 desde sua entrada em vigor.

Nenhum membro da GTI recebeu presentes com valor superior ao estabelecido no Código de Conduta e Ética. Todos os colaboradores foram incentivados a respeitar todas as leis, normas e regulamentos aplicáveis a GTI, bem como evitar conflitos de interesse.

Todos novos ingressos receberam orientação e treinamento sobre nossas políticas internas.

Da mesma forma, estamos respeitando a confidencialidade de todas as nossas operações e não garantimos desempenho ou retorno de investimentos nenhum de nossos clientes, sempre nos preocupando em explicar as características de nossos veículos de investimento bem como riscos envolvidos.

Política de Investimentos Pessoais;

Certificamos que todos os colaboradores preencheram e assinaram a Declaração de Investimentos Pessoais anexa a esta política desde que ingressaram na GTI.

Em 2020, nenhum sócio ou colaborador efetuou investimentos ou desinvestimentos de ações.

A Política de Investimentos Pessoais está descrita dentro do Código de Ética e Conduta presente no site da GTI (www.gtinvest.com.br) na seção de produtos em adequação a nova ICVM 558 desde sua entrada em vigor.

É vedada a criação de carteiras administradas para colaboradores ou seus parentes até o terceiro grau, assim como a gestão de clubes de investimento ou fundos que não pertençam a GTI.

Prevenção à Lavagem de Dinheiro;

Pela Lei 9613/98 e pela Instrução CVM 301/99 e o Ofício CVM, a responsabilidade de prevenção de "lavagem de dinheiro", ocultação de bens e valores e combate ao terrorismo é de todos os Colaboradores da GTI Administradora de Recursos Ltda.

Nos casos em que a GTI Administração de Recursos Ltda atua como distribuidor, todo o processo de PLD é feito diligentemente pela empresa, conforme nosso Manual de Política e Proteção a Lavagem de Dinheiro. A BNY Mellon, administradora dos fundos, também tem responsabilidade no processo. Mesmo sendo distribuidor, ressalta-se que, por hora, a GTI não tem por política aumentar sua base de clientes distribuídos, preferindo optar pela distribuição por terceiros.

Os procedimentos serão sempre aprimorados mas deverão rodar "em velocidade" de cruzeiro em 2021.

Ao longo de 2020, não tivemos nenhum caso de lavagem de dinheiro entre nossos clientes.

Conheça seu cliente ("Know Your Client - KYC")

A GTI Administradora de Recursos adota política de análise e identificação de perfil do investidor, conforme Política de Suitability e Manual de Política de Prevenção a Lavagem de Dinheiro, para assim conhecer seus clientes definindo um conjunto de regras que possam identificar e conhecer a origem e constituição do patrimônio e dos recursos financeiros do cliente.

Ao final do processo de KYC é necessário conhecer o cliente, suas atividades e a origem de seus recursos, os representantes e beneficiários finais do cliente, caso existam e também verificar se não tem suspeitas ou evidências de que os recursos movimentados pelo cliente tenham origem ilícita. Caso alguma suspeita apareça no questionário KYC, a Área de compliance determinará se (i) será realizada uma visita aos investidores em sua residência, local de trabalho ou instalações comerciais para realização de uma Due Diligence mais apurada e (ii) se o investidor será aceito como cliente depois da análise.

Uma vez não aceito como cliente, pelos riscos envolvidos, o investidor será comunicado pela Equipe de Distribuição por telefone e/ou por e-mail que seu cadastro não foi aprovado pelo Compliance. Ressalta-se que, por hora, a GTI não tem por política aumentar sua base de clientes distribuídos, preferindo optar pela distribuição por terceiros.

Controles Internos;

Tópicos da Política de Controles Internos da GTI, encontram-se nos seguintes manuais:

- Código de Ética
- Política de Suitability
- Manual de Política e Proteção à Lavagem de Dinheiro
- Política de Segurança a Informação e Segurança Cibernética
- Manual de Compliance

Segurança de Informações;

Em 2018 contratamos um prestador de serviços na área de TI. A SLTech - Soluções em TI, CNPJ: 03.915.427/0001-08.

A SLTech define os acessos dos diferentes sócios e colaboradores, aos diretórios da rede, conforme orientação da área de Compliance.

A verificação de permissões e acessos são realizadas periodicamente, obedecendo as demandas da GTI.

A atual infra-estrutura de TI da empresa conta com acesso à internet através de dois provedores (redundância), além de nobreaks individuais, garantindo o acesso as informações e permitindo a operação em caso de falta de energia ou problema específico de conectividade com um provedor.

No caso de impossibilidade de acesso as instalações da empresa, são possíveis acessar os sistemas externos, correio eletrônico e sistemas de negociação eletrônica de ações através da internet em qualquer outro ponto de conexão. Adicionalmente, as informações da carteira estão seguramente disponíveis através do sistema do nosso administrador, acessível via web. Todo nosso sistema está hospedado na nuvem (Office 365), permitindo acesso a rede e ao servidor de qualquer ponto com conexão de internet, com as devidas senhas e validações. Nosso sistema de telefonia utiliza o VOIP com gravações das ligações, ficando disponível por 2 (dois) meses.

Importante ressaltar também que mantemos registros de qualquer acesso e modificação dos nossos arquivos e na rede, sendo possível identificar por qual computador, data e horário.

Em 2020 foram testados os sistemas de reserva de energia elétrica, os backups de arquivos, o sistema de Nuvem e os computadores de contingência.

A veiculação e divulgação de informações para a mídia formal ou redes sociais é feita predominantemente através de nosso site oficial.

Pode acontecer através de interações de determinados sócios da empresa com representantes da mídia. Estas interações se darão sempre de forma diligente e ponderada de modo a proteger e resguardar a imagem institucional da empresa.

Continuidade dos Negócios;

Os computadores de contingência estão aptos a funcionar em substituição aos computadores da empresa, possuindo todos os sistemas e arquivos essenciais as atividades cotidianas.

Todos os arquivos estão armazenados na nuvem (Office 365). Adicionalmente nos casos de contingência também nos utilizamos de chats virtuais, grupo de whatsapp e computadores adicionais nas residências de sócios em caso de impossibilidade de utilização na sede da empresa.

Fizemos um teste de contingência em 2020, com resultados satisfatórios.

Rateio e Divisão de Ordens;

Na GTI o gestor é responsável pela execução das ordens relativa aos veículos/ fundos das estratégias. Caso haja mais de um produto com a mesma estratégia, as ordens são distribuídas pelo preço médio e proporcionalmente ao total de ativos de cada veículo/fundo. A divisão de ordens é checada diariamente através da verificação das notas de corretagem.

A política de rateio e divisão de ordens atualizada se encontra no site da GTI (www.gtinvest.com.br) na seção de produtos em adequação a nova ICVM 558 desde sua entrada em vigor.

Combate a Corrupção;

Certificamos que nossos colaboradores não praticaram nenhum dos atos lesivos a administração pública elencados na política de combate a corrupção.

Treinamento e reciclagem de colaboradores;

Na GTI todo novo colaborador participa de um processo de integração e treinamento junto com um sócio ou colaborador visando sua adaptação a empresa. Neste processo, o colaborador é apresentado a todas as políticas e normas internas da empresa, bem como ao Código de Conduta e Acordo de Confidencialidade e demais documentos que façam parte dos controles da empresa. Todos os atuais sócios e colaboradores da empresa já passaram por este processo.

Gestão de Riscos;

Em 2020 verificamos a aderência da metodologia de gestão. Nossos fundos se enquadraram dentro dos parâmetros elencados na política de risco durante todo o ano. Não houve, portanto, necessidade de aplicação de medidas corretivas.

Realizamos uma revisão de nosso Manual de Risco e Monitoramento da Liquidez implementando uma metodologia de um cálculo do IL: índice de Liquidez.

Nossa política de gestão de riscos se encontra no site da GTI (www.gtinvest.com.br) em conformidade com a instrução ICVM 558.

Seleção e alocação de Ativos;

Realizamos periodicamente reuniões para discussão de alocação e seleção de ativos. Ao longo de todo o ano, nossos fundos estiveram dentro de parâmetros e limites informados na política. Lembrando que diversificação (limites máximos pré determinados de concentração por empresa e por sub setor) e liquidez são os principais parâmetros para o controle de risco.

Verificamos que a aderência a metodologia de seleção e alocação está sendo cumprida.

Seleção, Contratação e Monitoramento de Terceiros;

Anualmente, realizamos nosso comitê para avaliação e escolha de corretoras pelas quais executamos nossos as negociações dos ativos dos fundos sob nossa gestão.

Para a definição dos terceiros, foram avaliados custos de transação, qualidade operacional, acesso ao corpo diretivo das empresas e/ou a seus eventos corporativos e qualidade da área de pesquisa.

Comitê de Risco e Compliance

A GTI conta com um comitê de Risco e *Compliance*, o qual é composto pelo Diretor de Risco e *Compliance*, ao menos um dos sócios da gestora e pelos profissionais das área de Suporte.

O Comitê de Risco e *Compliance* reúne-se trimestralmente de forma ordinária e, extraordinariamente, quando necessário, mediante convocação do Diretor de Risco e *Compliance*. Este Comitê será instalado com a presença de seus 2 (dois) membros, sendo um deles necessariamente o Diretor de Risco e Compliance ou, na sua ausência, quem este indicar.

É de responsabilidade do Comitê de Risco e *Compliance*:

- Definir, divulgar e revisar os procedimentos das regras, procedimentos e descrição dos controles internos e demais Políticas da GTI;
- Acompanhar sistematicamente e garantir a adesão das Políticas e Procedimentos Internos da GTI à regulamentação vigente;
- Disseminar as práticas descritas nesse Manual de *Compliance* entre os colaboradores da GTI;
- Identificar eventuais condutas contrárias às diretrizes deste Manual;
- Avaliar todos os casos de descumprimento das Políticas e Código de Ética que cheguem ao seu conhecimento, bem como analisar situações de conflito não previstas neste Manual;

- Garantir o absoluto sigilo de eventuais denunciadores de delitos ou infrações, exceto nos casos de testemunho judicial;
- Definir e aplicar eventuais sanções aos Colaboradores; e
- Solicitar sempre que necessário, para a análise de suas questões, o auxílio de auditoria e/ou assessoria interna ou externa.

Atualização E Revisão

Este manual será objeto de avaliação periódica e de revisão a cada 1 (um) ano no máximo, podendo ocorrer revisões a qualquer momento devido a relevância dos assuntos.