



Questionário ANBIMA de due diligence para contratação de Gestor de Recursos de Terceiros

Contratado:

Contratante:

Questionário preenchido por:

Mariana Pela Botelho Forte

Data:

16/03/2023

(Todos os campos devem ser preenchidos. Caso algum campo não seja aplicável à sua instituição, este deve ser preenchido com "N/A").

Versão: [-]



ANBIMA

Apresentação

Este questionário é baseado no Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para Administração de Recursos de Terceiros (“Código”). Ele tem o objetivo de auxiliar o administrador fiduciário no processo de contratação de gestores de recursos de terceiros para os fundos de investimento.

O questionário busca abordar, minimamente, a adoção de práticas consistentes, objetivas e passíveis de verificação que sejam suficientes não só para entender e mensurar os riscos associados à prestação de serviço como também para garantir um padrão aceitável da instituição a ser contratada.

O anexo ao questionário trata de informações específicas dos fundos de investimento.

O administrador fiduciário poderá adicionar outras questões julgadas relevantes na forma de anexo a esse questionário.

Este questionário deve ser respondido por profissional com poderes de representação, e qualquer alteração em relação às respostas enviadas e aos documentos encaminhados após o preenchimento deste questionário deve ser enviada à instituição que contratou a prestação de serviço em até cinco dias úteis da referida alteração.

Este questionário entrará em vigor em 11 de janeiro de 2019.

Sumário

Apresentação.....	1
1. Informações cadastrais.....	4
2. Informações institucionais.....	5
3. Receitas e dados financeiros.....	6
4. Recursos humanos.....	7
5. Informações gerais.....	8
6. Análise econômica, de pesquisa e de crédito.....	9
7. Gestão de recursos.....	9
8. Distribuição.....	10
9. Risco.....	11
10. Compliance e controles internos.....	12
11. Jurídico.....	13
12. Anexos ou endereço eletrônico.....	13
1. Alterações desde a última atualização.....	15
2. Perfil.....	17
3. Equipe de gestão do fundo.....	17
4. Estratégias e carteiras.....	18
5. Uso de derivativos.....	18
6. Compra de cotas de fundos de investimento.....	18
7. Informações adicionais.....	19
8. Gestão de risco.....	19
9. Comportamento do fundo em crises.....	21
10. Três períodos de maior perda do fundo.....	21
11. Atribuição de performance do fundo nos últimos 5 (cinco) anos.....	22
12. Relacionamento com distribuidores/alocadores.....	22
13. Atendimento aos cotistas.....	22
14. Investimento no exterior.....	23
15. Anexos (quando aplicável).....	24

1. Informações cadastrais

1.1	Razão social	
		Investport Gestão e Consultoria de Investimentos Ltda.
1.2	Nome fantasia	
		Investport
1.3	É instituição financeira ou instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil ("BCB")?	
		não
1.4	Quais são as autoridades regulatórias em que a gestora possui registro? Fornecer detalhe sobre os registros, tais como nome, data e nº de registro da atividade.	
		CVM OFÍCIO/CVM/SIN/GII-2/NÚMERO 835/2004
1.5	Membro de associações de classe e/ou autorreguladoras? Quais?	
		Conselho Regional de Economia
1.6	É instituição nacional ou estrangeira?	
		Nacional
1.7	Possui filial? Em caso positivo, quantas e onde estão localizadas?	
		Não
1.8	Endereço	
		Rua Oscar Freire, 379, cj. 141, São Paulo, SP
1.9	CNPJ	
		05.784.884/0001-36
1.10	Data de Constituição	
		05/04/2004
1.11	Telefones	
		11 3085-8262
1.12	Website	
		www.investport.com.br
1.13	Nome e cargo do responsável pelo preenchimento do questionário	
		Mariana Pela Botelho Forte – Sócia/Diretora de Risco e Compliance
1.14	Telefone para contato	

11 3085-8262

1.15 E-mail para contato

mpela@investport.com.br

2. Informações institucionais

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

Dany Rappaport – 38,5% Mirela Rappaport da Costa Santos – 38,5% Marcelo Frug – 14,5%

2.2 Qual a estrutura empresarial do conglomerado ou grupo econômico? (Quando aplicável).

Não Aplicável

2.3 Fornecer o organograma da gestora (anexar resumo profissional dos principais executivos).

Anexo

2.4 A gestora é signatária dos Códigos de Regulação e Melhores Práticas da ANBIMA? Em caso afirmativo, citar o(s) Código(s).

Sim. Ambos.

2.5 A gestora é signatária do Código de Ética da ANBIMA?

Sim.

2.6 A gestora é signatária do PRI – Principles for Responsible Investment?

Não

2.7 A gestora é signatária de outros Códigos ou assemelhados? Caso seja, citar as instituições.

Sim. Código de certificação continuada, melhores práticas e distribuição.

2.8 Os principais executivos, conforme o item 2.3, detêm participação em outros negócios no mercado financeiro e de capitais ou atividades relacionadas à gestora? (Exceto no caso de participação em empresas ligadas). Em caso positivo, informar:

- I. CNPJ da empresa;
- II. percentual detido pelo executivo na empresa; e
- III. qual a atividade por ele desempenhada.

Sim, Marcelo Frug é sócio da IVST Agentes Autônomos de Investimentos SS Ltda. (07.664.103/0001-03) com 15% e ele é sócio capitalista da Investport Gestão.

2.9 Informar se o conglomerado ou grupo econômico da gestora presta serviços de administração fiduciária, distribuição, consultoria, controladoria e custódia. Em caso positivo, descrever:

- I. a estrutura funcional de segregação e
- II. o relacionamento com a gestora.

A gestora exerce atividade de consultoria financeira.

2.10 Outras informações institucionais que a gestora julgue relevante (opcional).

3. Receitas e dados financeiros

Preencha a tabela abaixo com os valores correspondentes aos números da gestora. Informar os últimos 5(cinco) anos.				
3.1	Ano	Patrimônio sob gestão (posição em 31/Dez)	Número de pessoas que trabalham na gestora	Número de portfólios sob gestão
	2021	2.386MM	17	132
	2021	2.504MM	16	146
	2020	1.958MM	13	162
	2019	1.772MM	11	160
	2018	1.384 MM	8	228
3.2 Tipologia dos portfólios sob gestão (sem dupla contagem – excluir estrutura Master Feeder).				
	FUNDOS	Nº	% Carteira	
	Domicílio local	13	100	
	Domicílio em outro país			
	Clubes de Investimento	Nº	% Carteira	
	Clube	0	0	
	Carteiras	Nº	% Carteira	

	Domicílio Local	119	100
	Carteira de Investidor Não Residente		
	Como os ativos sob gestão estão divididos conforme as seguintes categorias de fundos de investimento:		
	Tipo	Nº	Exclusivos/Reservados
	Renda Fixa		41%
	Multimercado		8,9%
	Cambial		
	Ações		6,7%
	FIDC		
	FIP		1,8
	FIEE		
	FII		1,8
	Fundo de Índice (ETF)		
	Outras categorias		(investimentos offshore) 39,8%
3.3			
3.4	Atualmente, qual é o percentual do montante sob gestão que são originados especificamente de aplicações da própria gestora (incluindo controladores, coligadas, subsidiárias, seus sócios e principais executivos)?		

Cerca de 1%.

4. Recursos humanos

4.1 Quais são as regras de remuneração ou comissionamento dos profissionais e associados?

Existe salários e bônus semestrais para os sócios, funcionários e estagiários.

4.2 Quais são os mecanismos de retenção de talentos usados pela gestora?

A empresa foca em um ambiente de trabalho que gere valor para os colaboradores, remuneração competitiva e possibilidade de partnershin.

4.3 Existe programa para treinamento, desenvolvimento e certificação profissional dos profissionais/associados? Descreva, de forma sucinta, inclusive, com relação ao controle e monitoramento dos profissionais certificados.

Sim. Inclusive somos aderente ao código de certificação continuada da Anbima.

4.4 De que forma o desempenho dos gestores é avaliado?

Utilizamos como métrica o retorno das carteiras, volatilidade e aderência ao perfil.

4.5 A instituição adota treinamento dos colaboradores e empregados em Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Financiamento ao Terrorismo ("PLDFT")? Em caso positivo, descreva a metodologia e periodicidade aplicadas.

Sim. Manual Anexo

4.6 Descreva os treinamentos elaborados junto aos colaboradores para prevenção e detecção de práticas ilícitas de trading (ex: front running, insider trading, spoofing etc.).

Existem cursos e treinamentos que realizamos pelo menos uma vez por ano.

5. Informações gerais

5.1 Existem planos de expansão ou mudança de estratégia? Descreva.

Nosso crescimento é orgânico. Temos uma meta plausível de captação de recursos com base no nosso histórico.

5.2 Qual o limite para o crescimento dos ativos sob gestão suportado pela atual estrutura da gestora (instalações, profissionais hardware e software).

Conseguimos praticamente dobrar de tamanho com a estrutura atual.

5.3 A gestora é objeto de avaliação por agência de rating? Qual a nota atribuída? (Anexar relatório mais recente).

Não.

5.4 Com base nos últimos 05 (cinco) anos, a gestora já recebeu alguma premiação por publicações ou entidades no que tange à qualidade e ao histórico de gestão? Quais?

Não.

6. Análise econômica, de pesquisa e de crédito

6.1	Descreva a estrutura de análise econômica, de pesquisa e de crédito da gestora, conforme segmento, quando aplicável (anexar resumo profissional).
	Ver anexo (FR)
6.2	A estrutura de análise econômica e de pesquisa inclui pesquisa de temas ASG – ambientais, sociais e de governança corporativa? Como estas questões são consideradas durante o processo de decisão de investimento? Descreva.
	Não.
6.3	Descreva as principais mudanças na equipe de análise nos últimos 05 (cinco) anos.
	Tivemos a entrada de 5 novos sócios e saída de 3.
6.4	Utiliza research próprio ou de terceiros? Em que proporções?
	Ambos, meio a meio.
6.5	Caso utilize research próprio, quais ferramentas de análise são utilizadas no processo decisório? Esta equipe trabalha exclusivamente para o <i>buy side</i> ou também produz relatórios e informações para outros (<i>sell side</i>)?
	Fazemos fundamentalista de ativos. Exclusivamente para o <i>buy side</i> .
6.6	Que serviços ou sistemas são contratados para apoio na análise?
	Morningstar, Reuters e Quantum Axis

7. Gestão de recursos

7.1	Descreva as principais mudanças na equipe de gestão nos últimos 05 (cinco) anos.
	Foram efetivados 3 novos sócios
7.2	Descreva procedimentos e/ou políticas formais de seleção e acompanhamento de fornecedores e/ou prestadores de serviço relacionados à atividade de gestão de recursos/distribuição, incluindo as corretoras.
	Existe Manual específico para isso – vide anexo
7.3	Descreva o processo de investimento.
	Existe uma análise qualitativa e quantitativa de todos os investimentos, que após passarem por comitê, uma vez aprovados, são alocados nas carteiras.
7.4	Como é controlado o prazo médio dos títulos de fundos de longo prazo, para fins de sua classificação tributária?

Existe um monitoramento de liquidez das carteiras e fundos através de planilhas.

7.5 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.

Não se aplica.

7.6 Como são avaliados ativos no exterior, quando aplicável? Descrever como é realizado o controle e o processo de acompanhamento.

Não existe diferença de análise se o ativo é no exterior.

8. Distribuição

A gestora realiza distribuição dos fundos sob sua responsabilidade? Se sim, descreva os procedimentos adotados referentes aos processos de:

- 8.1
- I. verificação dos produtos ao perfil do cliente (Suitability);
 - II. conheça seu cliente (KYC);
 - III. PLDFT; e
 - IV. cadastro de cliente.

Não.

8.2 A gestora terceiriza alguma atividade relacionada à distribuição? Se sim, descreva as atividades, bem como o nome e o CNPJ do(s) terceiro(s) contratado(s).

Não.

8.3 Como é feita a prospecção de clientes/distribuição de fundos? Detalhar o processo de captação realizado pela instituição. Exemplos: Indicação de clientes, prospecção. Qual o perfil dos clientes? (segmento e categoria do investidor). Exemplo: Varejo, Corporate, PJ, Investidor profissional, Qualificado?

Existe a área comercial que atua em prospectar clientes. O foco atual são clientes acima de R\$ 10MM.

8.4 Descreva a estrutura operacional da gestora, voltada para a atividade de distribuição, incluindo sistemas de controle de movimentação (aplicação e resgate), critérios para execução das ordens e registro das solicitações, bem como o seu arquivamento e forma de proteção.

Existe 4 funcionários na área operacional que fazem os controles através de planilhas e sistemas de controle.

9. Risco

9.1	Descreva as principais mudanças na equipe de risco nos últimos 05 (cinco) anos.
	Adicionado 1 sócio
9.2	Quais são os relatórios de riscos, com que frequência são gerados e o que contêm estes relatórios?
	Nossa análise de risco é focada em fundos e no risco de cada ativo para o perfil do cliente como um todo. Esse controle ocorre diariamente e é tema de reunião mensal.
9.3	Descreva como cada operação de crédito é analisada, aprovada e monitorada? Descreva a segregação entre as atividades.
	Não fazemos operações de crédito ou estruturada.
9.4	Como são analisadas as garantias das operações e quais os critérios utilizados (análise de formalização, execução, etc)? Há reavaliação periódica da qualidade do crédito e de suas garantias? Qual sua periodicidade?
	Não fazemos análise de produtos de Crédito ou estruturados. As análises são focadas em perfil.
9.5	As questões e riscos ASG – ambientais, sociais e de governança corporativa – são considerados na análise de risco de crédito? (Exemplos: perda de licença ambiental, corrupção, envolvimento em casos de trabalho escravo ou infantil, etc.).
	Não
9.6	A gestora, independentemente do critério de apreçamento, possui algum procedimento ou estratégia no caso da iminência ou ocorrência de eventos de inadimplência? Descreva.
	Não
9.7	A instituição possui área de tecnologia da informação própria? Caso afirmativo, detalhar as atividades atuais, organograma e a qualificação dos profissionais.
	Não
9.8	Descreva os procedimentos de verificação de ordens executadas e de checagem das posições das carteiras.
	As ordens são feitas por e-mail ou por voz (telefone). Conhecemos de perto nossos clientes.
9.9	Existe sistema de gravação de ligações telefônicas? Em caso positivo, qual a política de escuta das gravações?
	Sim. Não existe política para esse fim.
9.10	Descreva os procedimentos de back-up e redundância de informações, desktops e servidores (para back-up, cite especificamente a periodicidade, local e prazo de armazenamento).
	Nosso servidor fica na nuvem (Office 365).
9.11	Descreva a política de controle de acesso ao Data Center (físico e lógico)

Não existe política específica para esse fim.

9.12 Descreva o parque tecnológico atual da instituição. Citar no-breaks, capacidade dos servidores, links de internet e telefonia etc.

Temos servidor na nuvem, laptops com no máximo 3 anos de uso, dois links de 600M de internet.

9.13 A gestora possui filtro de e-mail, firewall e sistemas de antivírus?

Sim, através do Panda antivírus.

9.14 São realizados testes periódicos para verificação de segurança e integridade de sistemas? Com que frequência?

O pessoal de TI monitora isso diariamente e nos entrega relatórios.

10. Compliance e controles internos

10.1 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.

Utilizamos a ferramenta Compliasset para monitoramento de novas regulamentações.

10.2 Descreva os procedimentos adotados pela gestora para controlar a faixa de preços dos ativos e valores mobiliários negociados para os fundos de investimento sob sua gestão.

Não existe política específica para esse fim. A precificação fica a cargo dos administradores e custodiantes.

10.3 Descreva o processo para adesão ao Código de Ética e Conduta, bem como suas atualizações, pelas profissionais que trabalham na gestora.

Todos os profissionais aderem ao código de ética na contratação e ocorrem reciclagens periódicas.

10.4 Descreva como é realizado o monitoramento da política de investimentos pessoais.

Manual Anexo.

10.5 Existe fundo ou outro instrumento de investimento exclusivo para sócios e executivos da gestora?

Não.

10.6 Descreva os procedimentos de monitoramento implementados para prevenção e detecção de práticas ilícitas de trading (ex: front running, insider trading, spoofing etc.).

Manual Anexo.

10.7 Descreva os procedimentos adotados para PLDFT no processo de seleção e alocação e monitoramento na negociação de ativos.

Manual Anexo.

10.8	Caso a gestora desenvolva outras atividades, descreva sua política de chinese wall, informando como se dá a proteção de informações entre departamentos e os potenciais conflitos de interesse advindos das diferentes atividades.
Existe segregação física e de comitês entra a área de gestão e de consultoria.	
10.9	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.
Não foram feitas nenhuma operação desse tipo.	
10.10	Como é verificado a adesão dos limites de risco, limites legais ou regulamentares das posições dos fundos sob gestão da gestora? A gestora utiliza algum agente externo? (Ex.: consultoria)
Existe um controle interno de enquadramento das posições, independente do controle feito pelo administrador dos fundos.	
10.11	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.
Não existe esse tipo de conflito na empresa.	
10.12	A gestora recebe comissões/remuneração (rebate) pela alocação em ativos e valores financeiros? Quais as regras?
Não. A remuneração vem do cliente.	

11. Jurídico

11.1	Descreva como são tratadas as questões jurídicas e legais da gestora (departamento jurídico próprio ou consultoria de terceiros).
Não temos setor próprio e quando necessário contratamos escritório parceiro.	

12. Anexos ou endereço eletrônico

		Anexo ou link
12.1	Resumo profissional dos responsáveis pelas áreas e equipe de gestão	anexo
12.2	Código de ética e conduta	link
12.3	Manual/Política de Exercício de Direito de Voto (Proxy Voting)	link
12.4	Relatório de Rating	nd

12.5	Manual/Política de Liquidez	link
12.6	Manual/Política de Suitability (caso a gestora realize distribuição de cotas dos fundos geridos)	link
12.7	Formulário de referência	link
12.8	Manual/Política de controles internos e compliance	link
12.9	Manual/Política de gestão de risco	link
12.10	Manual/Política de investimentos pessoais	Link
12.11	Manual/Política de rateio e divisão de ordens entre as carteiras de valores mobiliários	Link
12.12	Manual/Política de segurança de informação	Link
12.13	Manual/Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro	Link
12.14	Manual/Política de KYC	link
12.15	Manual/Política que tratem da troca de informações entre a atividade de distribuição realizada pela gestora e os administradores fiduciários	nd
12.16	Manual/Política de Responsabilidade Socioambiental	nd
12.17	Manual/Política de seleção e contratação de terceiros	nd
12.18	Lista das corretoras aprovadas (se houver)	nd

São Paulo, 16/03/2023

<i>Mariana Pelo B Forte</i>	<i>Mirela Rappaport</i>
Mariana Pelo Botelho Forte	Mirela Rappaport da Costa Santos
Sócia - Diretora de Risco e Compliance	Sócia – Diretora de Administração de Carteiras, Gestão de Recursos e Distribuição
11 3085-8262	11 3085-8262
mpela@investport.com.br	mrappaport@investport.com.br