



► Questionário Padrão
Due Diligence para Fundos de
Investimento – Seção 2:

Informações sobre o Fundo de Investimento

Gestor de recursos de terceiros (Pessoa Jurídica):

BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA.

Questionário preenchido por:

Rodrigo Selles

Data:

31/12/2018

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

Versão: 2.0 - Atualizada em jul/2012

Sumário

Apresentação	3
1) Informações sobre o Fundo de Investimento	4
1 - Alterações desde a última atualização	4
2 - Informações Qualitativas	6
2.1 – Perfil	6
2.2 - Equipe de Gestão do Fundo.....	8
2.3 - Estratégias e Carteiras	8
3 - Informações Adicionais	9
4 - Gestão de Risco.....	10
5 – Comportamento do Fundo em Crises.....	11
6 - Três períodos de maior perda do Fundo (<i>peak to valley</i>).....	11
7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período).....	11
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores	11
9 – Atendimento aos Cotistas.....	12
10 - Investimento no Exterior.....	12
11 – Anexos	12
2) Declaração	13
3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento.....	14
Atualizar Sumário	

(Para atualizar o sumário, clique no texto acima com o botão direito, atualizar campo, atualizar apenas os números de página)

Apresentação

O objetivo deste Questionário Padrão ANBIMA Due Diligence para Fundos de Investimento (“Questionário Due Diligence”) é o de conferir maior racionalidade aos processos de diligência voltados para a seleção e a alocação de recursos em fundos de investimento, com o estabelecimento de um padrão único para o questionário a ser utilizado nesses processos. Geralmente aplicado por investidores institucionais ou alocadores de recursos ao gestor do fundo de investimento no qual se pretende investir, o Questionário Due Diligence foi elaborado e será periodicamente revisado por um Grupo de Trabalho formado por associados à ANBIMA. Sua utilização, contudo, não inibe a troca de informações adicionais acerca de questões eventualmente não contempladas no documento entre as partes envolvidas.

O Documento contém 3 Seções:

Seção 1 – Informações sobre a Empresa

Seção 2 – Informações sobre o Fundo de Investimento

Seção 3 – Resumos Profissionais

A adoção do documento é recomendada pelo Código de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

1) Informações sobre o Fundo de Investimento

1 - Alterações desde a última atualização	
1.1	Nome
GERAÇÃO DE ENERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES MULTISTRATÉGIA	
1.2	CNPJ
11.490.580/0001-69	
1.3	Data de início
01/03/2010	
1.4	Classificação CVM
Fundo de Investimento em Participações	
1.5	Classificação ANBIMA
Fundo de Investimento em Participações	
1.6	Código ANBIMA
269761	
1.7	O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo?
1.8	Classificação tributária (CP/LP/Ações)
1.9	Público-alvo
Investidores profissionais, pessoas físicas ou jurídicas, nos termos da regulamentação em vigor, incluindo: (i) companhias seguradoras e sociedades de capitalização; (ii) entidades abertas e fechadas de previdência complementar; e (iii) fundos de investimento em cotas de fundos de investimento classificados como "Exclusivo" e "Multimercado", desde que destinados exclusivamente a investidores profissionais.	
1.10	O Regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução nº 3.792, do CMN?
CVM 578	
1.11	Exclusivamente para Investidor qualificado?
Sim.	
1.12	Conta Corrente (banco, agência, nº)
Banco Bradesco (237)	
Agência 2856	
Conta: 614008-4	
1.13	Conta CETIP (nº)
11168003	
1.14	Administração (indique contato para informações).
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A., Daniel.Azevedo@bnymellon.com.br	
1.15	Custódia (indique contato para informações).
BANCO BRADESCO S.A	
1.16	Auditoria externa (indique contato para informações).

Ernst & Young

Tatiana Martins | Executive Director | Assurance - Financial Services EY

Direct: + 55 21 3263-7345 | tatiana.martins@br.ey.com

1.17 No caso dos FIDCs ou Fundos de Crédito, caso se aplique, informar:

Escriturador	-
Agente de depósito (Custódia Física)	-
Consultor Especializado	-
Assessor Jurídico	-
Seguradora	-

1.18 Cotização: abertura ou fechamento? fechamento

1.19	Regras para aplicação e resgate:	
	Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação)	Fundo fechado
	Carência/Tempo mínimo para permanência (<i>lock-up period</i>) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período.	
	Resgate (datas, horários, cotização e liquidação)	
	Aplicação inicial mínima	
	Aplicação máxima por cotista	
	Aplicação adicional mínima	
	Resgate Mínimo	
1.20	Taxa de Entrada (<i>upfront fee</i>)	
	N/A	
1.21	Taxa de Saída (<i>redemption fee</i>)	
	N/A	
1.22	Taxa de Administração	
	-> 0,15% PL até 100.000.000,00;	
	-> 0,125% PL entre 100.000.000,00 e 300.000.000,00;	
	-> 0,1% PL acima de 300.000.000,00;	
1.23	Taxa de Administração máxima	
	0,3% a.a. sobre o valor do PL do fundo	
1.24	Taxa de Performance	
	• %	N/A
	• <i>Benchmark</i>	N/A
	• Frequência	N/A
	• Linha-d'água	N/A
1.25	Qual o custo total estimado do Fundo (em percentual do PL), excluindo-se as taxas de Administração e de Performance?	
	Fundo sem caixa.	
1.26	Quais as regras de rebate de taxas para distribuidores/alocadores?	
	Não	
1.27	Há algum consultor ou prestador de serviço (exceto administração, custódia e auditoria externa) contratado diretamente pelo Fundo?	
2 - Informações Qualitativas		
2.1 – Perfil		
2.1.1	Descreva o Fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento.	
	O objetivo do FUNDO é proporcionar aos Cotistas a valorização de suas Cotas por meio de investimentos na aquisição direta de ações ou títulos e valores mobiliários conversíveis ou permutáveis em ações de emissão das Companhias Alvo de forma que o FUNDO venha a participar do processo decisório das Companhias Investidas, com efetiva influência na definição de sua política estratégica e na sua gestão.	
2.1.2	Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do Fundo.	
2.1.3	Processo de Decisão de Investimento.	

2.1.4	Descreva o processo decisório de investimento.

2.1.5	Cite as premiações, ratings e rankings.		
N/A			
2.2 - Equipe de Gestão do Fundo			
2.2.1	Cite os profissionais envolvidos na gestão (anexar Resumo Profissional conforme modelo constante na Seção 3).		
Conforme Seção III em anexo.			
2.2.2	Cite o histórico de alterações significativas na equipe.		
N/A			
2.3 - Estratégias e Carteiras			
2.3.1	Quanto aos mercados em que opera, o Fundo pode ser caracterizado como:		
	▪ Brasil (exclusivamente)	X	
	▪ Brasil (predominantemente)	especifique	
	▪ Global	especifique	
2.3.2	Caso o Fundo invista no exterior, descreva os principais ativos e instrumentos utilizados.		
N/A			
2.3.3	Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o Fundo (ex.: stop loss, stop gain, concentração de ativos, aluguel de ativos etc.).		
2.3.4	Qual a política do fundo em relação às operações de day trade?		
Não é mencionado no Regulamento			
2.3.5 – Uso de Derivativos			
2.3.5.1	Com que objetivo(s) são utilizados derivativos:		
	• Proteção de carteira ou de posição	Sim X	Não <input type="checkbox"/>
	• Mudança de remuneração/indexador	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
	• Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.)	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
	• Alavancagem	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
2.3.5.2	Mercados em que são utilizados derivativos:		
	Juros	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
	Câmbio	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
	Ações	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
	Commodities	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
	Em Bolsas:		
	• Com garantia	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
	• Sem garantia	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
	Em balcão:		
	• Com garantia	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
	• Sem garantia	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
2.3.6 - Compra de Cotas de Fundos de Investimento			
2.3.6.1	de fundos de terceiros?	Sim	Não x
2.3.6.2	de fundos do gestor?	Sim <input type="checkbox"/>	Não X

3 - Informações Adicionais	
3.1	PL atual
	R\$ 264.609.191,48
3.2	PL médio em 12 meses
	R\$ 264.896.466,06
3.3	PL atual total da mesma estratégia sob gestão da Empresa
	R\$ 2.268.037.705,37
3.4	Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do Fundo e de sua família? Quais são os critérios de definição?
	N/A
3.5	Número de cotistas
	33
3.6	Qual percentual do passivo do Fundo representa aplicações da Empresa, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos?
	0
3.7	Descreva as regras de concentração de passivo
	N/A
3.8	Percentuais detidos pelos cinco maiores e dez maiores cotistas
	Cotista 1 – 13,61%
	Cotista 2 – 13,61%
	Cotista 3 – 13,07%
	Cotista 4 – 5,93%
	Cotista 5 – 5,88%
	Cotista 6 – 5,44%
	Cotista 7 – 5,44%
	Cotista 8 – 4,20%
	Cotista 9 – 3,27%
	Cotista 10 – 3,14%
3.9	Houve alguma mudança de prestadores de serviços de Administração e/ou de Custódia desde o início da operação do Fundo? Quando? Por quê?
	26/02/2018: substituição da gestora ATICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA pela BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA.
3.10	Há quanto tempo o Auditor Externo realiza auditoria no Fundo?
	2011 a 2015 – KPMG
	2016 a 2018 – ERNST& YOUNG
3.11	Quais e quando foram os três últimos exercícios de direito de voto?
	N/A

4 - Gestão de Risco	
4.1	Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do Fundo.
As regras específicas de exposição a risco de crédito do fundo estão descritos no regulamento do fundo.	
4.2	Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do Fundo.
O fundo sob análise é uma carteira ilíquida e com política de investimento restrita e específica. Da mesma forma, o fundo foi transferido para a nossa gestão sem caixa para honrar suas obrigações. Na hipótese de geração de caixa do fundo que lhe permita efetuar o pagamento das despesas ordinárias, extraordinárias e dos encargos previstos no seu Regulamento, o Fundo manterá tais valores em títulos públicos de liquidez compatível com as necessidades do Fundo e operações compromissadas, sem necessidade específica de diversificação de investimentos.	
4.3	Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle.
Pelo regulamento, fica vedada a realização de operações com derivativos descobertas.	
4.4	Como é feita a precificação de ativos/derivativos ilíquidos/exóticos? Existem esferas na Instituição para tal?
N/A – utiliza-se o manual de precificação do administrador.	
4.5	Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, <i>Tracking Error</i> e <i>Expected Shortfall</i>)?
N/A – Trata-se de um fundo ilíquido, com propósito de investimento específico.	
4.6	Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 4.5
N/A	
4.7	Qual o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 (exceto <i>stress</i>)?
N/A	
4.8	Descreva as regras de Orçamento da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5.
N/A	
4.9	Quando atingiu o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5? Por quê?
N/A	
4.10	Historicamente, qual o máximo da(s) metodologia(s) citadas no item 4.5 registrado pelo Fundo? Comente.
N/A	
4.11	Qual o VaR médio do Fundo nos últimos
3 meses?	-
6 meses?	-
12 meses?	-
24 meses?	-
4.12	Historicamente, qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo Fundo e em qual(is) ativo(s)?
O fundo não realiza alavancagem.	
4.13	Qual o limite para perdas em cenário de <i>stress</i> ?
Pela composição da carteira não há necessidade de definição de limite para perdas em cenário de <i>stress</i> .	
4.14	Quando atingiu o limite? Por quê?
N/A	
4.15	Qual o <i>stress</i> médio do Fundo nos últimos
3 meses?	N/A
6 meses?	N/A
12 meses?	N/A
24 meses?	N/A
4.16	Comente o último <i>stop loss</i> relevante do Fundo.
N/A	

5 – Comportamento do Fundo em Crises					
	Período	Evento	Comportamento	Explicação	
	Jul- Out/97	Crise da Ásia	N/A		
	Ago/98	Crise da Rússia	N/A		
	Out/98	Quebra do LTCM	N/A		
	Jan/99	Desvalorização do Real	N/A		
	Mar/00	Crise do Nasdaq	N/A		
	Abr/01	Apagão	N/A		
	Set/01	Ataques terroristas nos EUA	N/A		
	Mar-Jul/02	Escândalos contábeis	N/A		
	Jun/02	Marcação a mercado	N/A		
	Jul-Out/02	Eleições no Brasil	N/A		
	Mai/06	Crise das Bolsas norte-americanas	N/A		
	Jul-Ago/07	Crise das hipotecas	N/A		
	Out/2008 - Mar/2009	Crise no Sistema Financeiro norte-americano	N/A		
	Jan/10 – Jun/10	Crise de endividamento dos PIGS	N/A		
6 - Três períodos de maior perda do Fundo (<i>peak to valley</i>)					
	Período	Evento	Perda	Explicação	Tempo para Recuperação
1.	-	-	-	-	-
2.	-	-	-	-	-
3.	-	-	-	-	-
7 - Atribuição de performance desde o início do fundo ou nos últimos cinco anos (informar o maior período)					
7.1	Atribuição		Contribuição (%)		
	N/A		N/A		
7.2	Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates).				
7.3	O Fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação do gestor? Quando? Por quê?				
8 – Relacionamento com Distribuidores/Alocadores					
8.1	Quais os relatórios disponíveis do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?				
	N/A				
8.2	Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores?				
	N/A				
8.3	Com que frequência é possível realizar <i>conference calls</i> com o gestor dos fundos?				

N/A			
9 – Atendimento aos Cotistas			
9.1	Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do Fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem?		
Extratos enviados mensalmente.			
9.2	Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado?		
9.3	Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento?		
10 - Investimento no Exterior			
Caso o Fundo tenha investimentos no exterior, preencher os dados abaixo			
10.1	Qual é a Estrutura desse Fundo?		
N/A			
10.2	Quais os riscos envolvidos?		
N/A			
10.3	Qual o produto?		
N/A			
10.4	Qual (is) a (s) estratégia (s) de alocação em ativos no exterior?		
N/A			
10.5	Qual (is) o (s) veículo (s) utilizado (s) para estas alocações?		
N/A			
10.6	Enumerar os prestadores de serviços dos investimentos no exterior (administrador, custodiante, RTA, <i>prime broker</i> , entre outros)		
N/A			
10.7	Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas.		
N/A			
10.8	O investimento no exterior foi constituído sob qual jurisdição? Quais são as entidades reguladoras pertinentes?		
N/A			
10.9	Caso o investimento no exterior seja feito através de fundos, descreva como foi constituída a diretoria do Fundo.		
N/A			
11 – Anexos			
11.1	Regulamento	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
11.2	Prospecto	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
11.3	Última lâmina	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
11.4	Último Informe de Perfil Mensal (Arquivo XML - Padrão CVM) da carteira	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
11.5	Último Informe de Extrato das Informações sobre o Fundo (Arquivo XML - Padrão CVM)	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>
11.6	Relatórios de Gestão	Sim <input type="checkbox"/>	Não <input type="checkbox"/>

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: São Paulo	Data: 31/12/2018
Nome: Rodrigo Selles	
Cargo: Diretor	

Assinatura: _____



3) Eventos Importantes do Fundo de Investimento

1 – Nome do Fundo	
1.1	Alteração de prestadores de serviço dos fundos geridos: Administrador, Custodiante e Auditor.
Gestor: BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	
1.2	Alteração de dados de contato OL-Distribution@brasilplural.com
1.3	Alteração nas condições de aplicação e resgate do Fundo
1.4	Alteração da classificação tributária
1.5	Alteração de limites de risco dos fundos