



## REGRAS E PARÂMETROS DE ATUAÇÃO

DO

### HSBC BRASIL S.A. – BANCO DE INVESTIMENTO

O **HSBC BRASIL S.A. – BANCO DE INVESTIMENTO**, com sede na Rua Funchal, 160, 19º andar, Cj 191-A, São Paulo, SP, inscrito no CNPJ/MF sob n.º 53.518.684/0001-84 (“**HSBC**”), em atenção ao disposto no art. 3º da Instrução da Comissão de Valores Mobiliários (“**CVM**”) nº 505, de 27 de setembro de 2011, e alterações posteriores (“**ICVM 505**”), e com o objetivo de atuar na qualidade de Intermediário nos mercados organizados de valores mobiliários administrados pela Cetip S.A. – Mercados Organizados, CNPJ no 09.358.105/0001-91 (doravante “**Cetip**”), define, nos termos do “Manual de Normas de Intermediário de Valores Mobiliários”, por meio deste documento, as regras que pautam a sua atuação nos referidos mercados (**Regras e Parâmetros**).

Indicação dos seguintes diretores, conforme o estabelecido no artigo 4º da Instrução CVM nº. 505:

1) Diretor estatutário responsável pelo cumprimento das normas estabelecidas por esta Instrução

Nome: **Alexandre Maciel Thorpe**

CPF nº.: **837.809.477-49**

2) Diretor estatutário responsável pela supervisão dos procedimentos e controles internos

Nome: **Caio Cezar Banti**

CPF nº.: **294.206.468-40**

As Regras e Parâmetros são parte integrante da Ficha Cadastral e/ou do contrato firmado com o Cliente, quando aplicável.

## 1. CADASTRO DE CLIENTE

O Cliente, antes de iniciar suas operações nos mercados organizados de valores mobiliários administrados pela CETIP deverá fornecer ao HSBC e manter atualizadas todas as informações cadastrais solicitadas, mediante o preenchimento e a assinatura da ficha cadastral com o HSBC, além de entregar cópias de documentos comprobatórios, conforme a legislação em vigor.

No processo de identificação dos clientes, o HSBC adotará os seguintes procedimentos:

- Identificação do Cliente e manutenção dos cadastros atualizados na extensão exigida pela regulamentação em vigor, em especial a Instrução CVM nº 301, de 16 de abril de 1999, e alterações posteriores, e nas regras editadas pela CETIP;
- No caso de cadastramento simplificado de Investidor Não Residente, atenderá os requisitos previstos nas regras editadas pela CVM, em especial a ICVM 505, e nas regras editadas pela CETIP;
- Atualização dos dados cadastrais dos Clientes ativos em intervalos não superiores a 24 (vinte e quatro) meses;
- Permissão de novas operações com Clientes inativos apenas mediante a atualização de seus respectivos cadastros;
- Adoção contínua de regras, procedimentos e controles internos visando à confirmação das informações cadastrais, à manutenção dos cadastros atualizados e à identificação dos beneficiários finais das operações, conforme legislação aplicável ao produto e ao mercado de atuação, de forma a evitar, por seu intermédio, o uso indevido do sistema da CETIP por terceiros, ou ainda, para lavagem de dinheiro, financiamento ao terrorismo e/ou fraude;
- Identificação das pessoas politicamente expostas (PPE) e adoção de procedimentos de supervisão mais rigorosos dos relacionamentos e operações envolvendo essas pessoas, com especial atenção a propostas de início de relacionamento, e à manutenção de regras, procedimentos e controles internos para identificar Clientes que se tornaram tais pessoas após o início do relacionamento como HSBC, sempre em conformidade com a legislação aplicável ao produto e ao mercado de atuação;
- Manutenção das informações contidas nos cadastros dos Clientes, com os respectivos documentos, inclusive daquelas que não sejam de inclusão obrigatória no sistema da Cetip, para eventual apresentação à Cetip, à CVM ou ao Poder Judiciário.

O Cliente deverá, ainda, informar ao HSBC quaisquer alterações que vierem a ocorrer em seus dados cadastrais no prazo de 10 (dez) dias, a contar da referida alteração.

## **2. ORDENS E OPERAÇÕES DE DERIVATIVOS**

A atividade do HSBC que se enquadra, atualmente, como intermediação de valores mobiliários é apenas o registro, em mercado de balcão organizado administrado pela CETIP, de operações de derivativos previamente acordadas e celebradas bilateralmente em balcão não organizado entre o HSBC e seus clientes (**“Operações de Derivativos”**).

Para as Operações de Derivativos, não é necessário que o HSBC observe o disposto nos artigos 19 e 20 da ICVM 505, nos termos do Processo CVM RJ2012/0139, julgado na reunião do Colegiado da Comissão de Valores Mobiliários realizada em 29.01.2013.

As formas de contratação e demais procedimentos operacionais relacionados às Operações de Derivativos encontram-se no contrato de derivativos assinado pelo Cliente.

O HSBC não realiza nenhuma outra atividade de intermediação de valores mobiliários nos mercados organizados administrados pela CETIP e, portanto, não aceitará, num primeiro momento, ordens que envolvam por exemplo, negociação em nome do Cliente de valores mobiliários no mercado organizado secundário de balcão de títulos de renda fixa administrado pela CETIP. Caso este cenário se altere, o HSBC alterará estas Regras e Parâmetros correspondentemente.

## **3. DAS CONFIRMAÇÕES**

Para as Operações de Derivativos, o HSBC, nos termos do contrato de derivativos assinado com o Cliente, manterá arquivadas as notas de negociação, confirmações e/ou documentos análogos relativos(os) aos negócios para efeito de suprir o registro e arquivamento de Ordens previsto no artigo 13 da ICVM 505, nos termos do Processo CVM RJ2012/0139, julgado na reunião do Colegiado da Comissão de Valores Mobiliários realizada em 29.01.2013, as(os) quais serão disponibilizadas(os) para a CETIP e/ou para a CVM sempre que solicitado.

## **4. PESSOAS AUTORIZADAS A CONTRATAR OPERAÇÕES DE DERIVATIVOS**

O HSBC somente poderá negociar termos e condições de Operações de Derivativos caso os mandatários, prepostos, funcionários e/ou representantes do Cliente sejam devidamente autorizados e identificados de antemão perante o HSBC e também perante a CETIP, conforme procedimento estipulado pelo HSBC a ser comunicado ao Cliente. No caso de negociação de termos e condições de Operações de Derivativos via preposto, funcionário ou procurador, caberá ao Cliente apresentar o respectivo instrumento de mandato ao HSBC, ou documento equivalente que oficialize a autorização dada à pessoa para transmitir Ordens em nome do Cliente, que será arquivado junto ao dossiê cadastral do Cliente, cabendo, ainda, ao Cliente, informar ao HSBC sobre a eventual revogação do mandato/autorização (inclusive pela saída da pessoa do quadro de funcionários do Cliente).

## **5. DA POSIÇÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

O HSBC, num primeiro momento, não prestará serviço de custódia de valores mobiliários para Clientes.

## **6. REGRAS QUANTO À LIQUIDAÇÃO DAS OPERAÇÕES**

O Cliente obriga-se a pagar com seus próprios recursos ao HSBC, pelos meios que forem colocados à sua disposição, os débitos decorrentes da execução de Operações de Derivativos, bem como as despesas relacionadas a elas, nos termos do contrato celebrado entre o Cliente e o HSBC.

Os recursos financeiros transferidos pelo Cliente ao HSBC pelo sistema bancário somente serão considerados disponíveis após a respectiva confirmação por parte do HSBC.

O pagamento de valores efetuado pelo HSBC ao Cliente deve ser feito por meio de transferência bancária, nos termos do contrato celebrado entre o Cliente e o HSBC. As transferências efetuadas pelo HSBC para Cliente investidor não residente podem ser feitas para a conta corrente do custodiante do investidor não residente, que também deve estar identificada no cadastro do Cliente no HSBC.

## **7. MONITORAMENTO DOS INVESTIMENTOS EM RELAÇÃO AOS COMITENTES**

O HSBC possui uma política de cumprimento das normas que tratam sobre a adequação dos produtos oferecidos ao perfil de seus Clientes, nos termos da Instrução da CVM 539, de 13 de novembro de 2013 (**"Instrução CVM 539"**).

Para os Clientes que sejam classificados pela Instrução CVM 539 como profissionais ou qualificados pela atividade que desempenham (como instituições financeiras e fundos de investimento, por exemplo), o cumprimento das regras da Instrução CVM 539 está automaticamente dispensada, sendo que o HSBC verifica o atendimento ao requisito da atividade por meio de checagem do Código Nacional de Atividade Empresarial do Cliente, o CNAE. Para os Clientes do HSBC que não forem considerados profissionais ou qualificados pela atividade que desempenham, mas, sim, pelo valor que possuem em investimento financeiros, o HSBC possui procedimentos para coletar a declaração do cliente neste sentido, na forma da Instrução CVM 539 – geralmente, tal ocorre em conjunto com o procedimento de cadastro inicial do Cliente.

## **8. PESSOAS VINCULADAS**

Nos termos do Processo CVM RJ2012/0139, julgado na reunião do Colegiado da Comissão de Valores Mobiliários realizada em 29.01.2013, o conceito de pessoas vinculadas, e portanto o artigo 25 da ICVM 505, não se aplica às Operações de Derivativos.

## 9. SOBRE O SISTEMA DE GRAVAÇÃO E RECUPERAÇÃO DE INFORMAÇÕES

Para as Operações de Derivativos, o HSBC realiza gravação, de forma inteligível, de todas os diálogos mantidos por telefone ou dispositivo semelhante, e todas as trocas de mensagens escritas recebidas por sistema de mensagem instantânea, nos termos do contrato de derivativos assinado com o Cliente. O conteúdo destas gravações poderá ser usado como prova no esclarecimento de questões relacionadas às Operações de Derivativos do Cliente, devendo ainda serem guardadas pelo HSBC pelo prazo de 5 (cinco) anos a contar da data da respectiva gravação.

## 10. PREVENÇÃO E COMBATE À LAVAGEM DE DINHEIRO

O HSBC informa que possui controles internos de prevenção e combate à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento ao Terrorismo sobre suas operações e de seus Clientes, cursadas no âmbito da CETIP, incluindo no mínimo a implantação dos seguintes controles:

- **Registro e Monitoramento de Operações envolvendo valores mobiliários, independentemente de seu valor** – o monitoramento das operações estabelecido com base em critérios próprios, para verificação da compatibilidade com a situação patrimonial e financeira do Cliente, informada em seu cadastro, análise das operações em conjunto com outras operações conexas e que possam fazer parte de um mesmo grupo de operações ou guardar qualquer tipo de relação entre si, para efeito de identificação de operações que possa configurar crime de lavagem de dinheiro e financiamento ao terrorismo, estabelecendo regras de monitoramento especiais para as seguintes categorias de Clientes investidores; e pessoas politicamente expostas, inclusive as oriundas de países com os quais o Brasil possua elevado número de transações financeiras e comerciais, fronteiras comuns ou proximidade étnica, lingüística ou política; e manutenção de regras, procedimentos e controles internos para identificar a origem dos recursos envolvidos nas transações dos Clientes e dos beneficiários identificados como pessoas politicamente expostas, conforme legislação aplicável ao produto e ao mercado de atuação, de modo a evitar o uso indevido do sistema da CETIP por terceiros para a prática de ilícitos.
- **Conservação dos cadastros dos Clientes e dos registros das operações por eles realizadas, mantendo-os à disposição da CETIP e da CVM**, bem como conservação da documentação que comprove a adoção dos procedimentos de monitoramento das operações e verificação de compatibilidade entre a capacidade econômico-financeira do Cliente com as operações por ele realizadas, e também dos registros das conclusões de suas análises acerca das operações ou propostas, pelo prazo mínimo de 5 (cinco) anos, contados a partir da data de encerramento do relacionamento do Cliente com o HSBC ou da conclusão da última transação realizada em nome do respectivo Cliente (o que ocorrer por último), podendo este prazo ser estendido indefinidamente na hipótese de existência de investigação comunicada formalmente pela CVM ao HSBC.

- **Comunicação, ao COAF, de operações envolvendo Clientes** que tenham a finalidade de gerar perda ou ganho para as quais falte, objetivamente, fundamento econômico; operações com a participação de pessoas naturais residentes ou entidades constituídas em países que não aplicam ou aplicam insuficientemente as recomendações do Grupo de Ação Financeira contra a Lavagem de Dinheiro e o Financiamento ao Terrorismo – GAFI; e territórios não cooperantes, nos termos definidos pelo Conselho de Controle de Atividades Financeiras – COAF; transferências privadas, sem motivação aparente, de recursos e de valores mobiliários; operações cujo grau de complexidade e risco se afigure incompatível com a qualificação técnica do Cliente ou de seu representante, ou para prestação de garantia em operações nos mercados de liquidação futura; depósitos ou transferências realizados por terceiros, para a liquidação de operações de Cliente; pagamentos a terceiros, sob qualquer forma, por conta de liquidação de operações ou resgates de valores depositados em garantia, registrados em nome do Cliente; situações e operações em que não seja possível manter atualizadas as informações cadastrais de seus Clientes, identificar o beneficiário final ou concluir as diligências necessárias; operações cujos valores se afigurem objetivamente incompatíveis com a ocupação profissional, os rendimentos e/ou a situação patrimonial ou financeira, tomando-se por base as informações cadastrais respectivas; operações que evidenciem oscilação significativa em relação ao volume e/ou frequência de operações de qualquer das partes envolvidas; operações cujos desdobramentos contemplem características que possam constituir artifício para burla da identificação dos efetivos envolvidos e/ou beneficiários respectivos; operações cujas características e/ou desdobramentos evidenciem atuação, de forma contumaz, em nome de terceiros; operações que evidenciem mudança repentina e objetivamente injustificada relativamente às modalidades operacionais usualmente utilizadas pelo(s) Cliente(s), conforme determinação e orientação de prazo e forma da legislação aplicável;
- **Manual de procedimentos de controles internos** que assegure a observância das obrigações referente ao cadastro, monitoramento, identificação preventiva dos riscos de prática dos crimes de lavagem de dinheiro incluindo, análise de novas tecnologias, serviços e produtos, identificação de Clientes que se tornaram após o início do relacionamento com o HSBC ou que foi constatado que já eram pessoas politicamente expostas no início do relacionamento, identificação da origem dos recursos envolvidos nas transações dos Clientes e dos beneficiários identificados como pessoas politicamente expostas, seleção de funcionários idôneos e de elevados padrões éticos para seus quadros, e a comunicação de operações suspeitas às autoridades, conforme legislação aplicável ao produto e ao mercado de atuação, visando à prevenção aos crimes de lavagem de dinheiro e financiamento ao terrorismo.

- **Manutenção de programa de treinamento contínuo** para funcionários, destinado a divulgar os procedimentos de controles internos de prevenção à lavagem de dinheiro e ao financiamento ao terrorismo.

## **11. SEGURANÇA DA INFORMAÇÃO E CONTINUIDADE DE NEGÓCIOS**

O HSBC informa que possui controles internos suficientes para a adequada segurança das informações e continuidade das operações, incluindo os seguintes controles:

- Controle de acesso lógico às informações e sistemas de suporte, de forma a prevenir o acesso não autorizado, roubo, alteração indevida ou vazamento de informações;
- Mecanismos formais para gerenciar acessos e senhas (redes, sistemas e bancos de dados, incluindo o canal de relacionamento eletrônico com Clientes);
- Solução de segurança de tecnologia para controle do acesso externo ao ambiente interno (firewall), que proteja as informações contra códigos maliciosos (antivírus);
- Testes periódicos dos sistemas de informação quanto à sua segurança, e correção tempestiva de vulnerabilidades identificadas;
- Medidas que mantenham as informações com o mesmo nível de proteção em todos os momentos de sua utilização com referência às atividades externas, incluindo trabalho remoto;
- Trilhas de auditoria para os sistemas críticos, as quais permitam identificar origem, data, hora, usuário responsável e tipificação de todas as consultas e manutenções efetuadas sobre informações críticas;
- Medidas preventivas contra a interrupção ou indisponibilidade não programada dos sistemas da informação, identificando processos e pessoas que possam afetar negativamente os processos mais críticos e estabelecendo controles alternativos e compensatórios adequados;
- Testes periódicos das medidas preventivas definidas e implantadas, de forma a garantir a eficiência e eficácia das mesmas;
- Registro das situações de indisponibilidade dos sistemas, das redes, dos canais de comunicação (inclusive gravação de voz e mensageria instantânea);
- Registro e acompanhamento de todas as interrupções ou falhas que gerem interrupção não programada dos sistemas desde sua ocorrência; e
- Aplicação de soluções de contorno e implementação de solução definitiva, para efeito do adequado gerenciamento de incidentes e problemas.

## **12. DISPOSIÇÕES GERAIS**

Qualquer exceção a estas Regras e Parâmetros que for admitida pelo HSBC, desde que esta exceção não represente violação aos padrões e regras de mercado estabelecidos pela CETIP e pela CVM, deverão ser consideradas como mera liberalidade do HSBC, não implicando em alteração das presentes Regras e Parâmetros e nem obrigando ou vinculando o HSBC.



O HSBC possui estrutura de controles internos que visa a assegurar a observância da legislação aplicável às suas atividades.

Todos os documentos e informações relacionados às operações realizadas nos mercados administrados pela CETIP, bem como toda a correspondência, interna e externa, todos os papéis de trabalho, relatórios e pareceres relacionados com o exercício das funções do HSBC, sejam eles físicos ou eletrônicos, assim como a íntegra das gravações referidas neste documento, serão arquivados pelo prazo mínimo de 5 (cinco) anos, ou por prazo superior por determinação expressa da CVM, Banco Central do Brasil ou CETIP.

As Regras e Parâmetros de Atuação do HSBC poderão ser modificadas ou atualizadas a qualquer momento pelo HSBC, estando seus Clientes automaticamente vinculados às disposições, termos e condições de operações que vierem a ser estabelecidas pelo HSBC.

São Paulo, 04 de julho de 2016.