

REGRAS E PARÂMETROS DE ATUAÇÃO NOS MERCADOS ORGANIZADOS

Janeiro de 2018

Sumário

1. Introdução	3
1.1. REGRAS E PROCEDIMENTOS	3
2.1. ESCOPO	3
2. Regras gerais	3
2.1. CADASTRO	3
2.2. DIRETORES RESPONSÁVEIS, SUPERVISÃO DOS PROCEDIMENTOS E CONTROLES INTERNOS.....	3
3. Ordens	4
3.1. REGRAS QUANTO AO RECEBIMENTO DE ORDENS	4
3.1.1. TIPOS DE ORDENS ACEITAS E PRAZO DE VALIDADE DAS ORDENS.....	4
3.1.2. HORÁRIO PARA RECEBIMENTO DAS ORDENS.....	4
3.1.3. FORMAS E CRITÉRIOS DE TRANSMISSÃO E ATENDIMENTO DE ORDENS.....	4
3.1.4. PROCEDIMENTOS DE RECEBIMENTO E RECUSA DE ORDENS	4
3.1.5. PESSOAS AUTORIZADAS A EMITIR / TRANSMITIR ORDENS	5
3.1.6. REGISTRO DAS ORDENS	5
3.1.7. CANCELAMENTO OU ALTERAÇÃO DE ORDENS.....	5
3.1.8. EXECUÇÃO DAS ORDENS.....	5
3.1.9. ARQUIVAMENTO DOS REGISTROS DE ORDENS	6
3.1.10. FORMA E CRITÉRIOS PARA DISTRIBUIÇÃO DOS NEGÓCIOS REALIZADOS	6
3.2. FATORES QUE DETERMINAM A ESCOLHA DO MERCADO E DO SISTEMA DE NEGOCIAÇÃO PARA A EXECUÇÃO DA ORDEM, QUANDO ELES NÃO FOREM INDICADOS PELO CLIENTE	6
4. Sistema de gravação	6
5. Conflito de interesses	6
6. Comunicação	6

1. Introdução

1.1. REGRAS E PROCEDIMENTOS

As regras, procedimentos e controles internos aqui previstos visam definir, em atendimento à instrução CVM nº 505, de 27 de setembro de 2011, conforme alterada (“Instrução CVM nº 505”) as diretrizes que deverão ser observadas nas operações realizadas com valores mobiliários em mercados regulamentados, especificamente as atividades atinentes à intermediação e negociação dos aludidos valores mobiliários, as quais envolvem as seguintes áreas internas do Banco ABC Brasil:

- Estruturação de Mercado de Capitais;
- Distribuição de Mercado de Capitais;
- Trading Proprietário; e
- *Back Office*.

2.1. ESCOPO

O Banco ABC Brasil no âmbito do mercado secundário, somente atua no mercado de títulos e valores mobiliários negociando posições adquiridas em seu próprio nome, não acatando, portanto, ordens de terceiros a serem executadas posteriormente.

Todavia, o Banco ABC Brasil, no âmbito do mercado primário, atua na distribuição e negociação de valores mobiliários ofertados publicamente a terceiros, acatando, portanto, ordens de terceiros a serem executadas posteriormente.

2. Regras gerais

2.1. CADASTRO

O cliente, antes de iniciar suas operações no respectivo mercado organizado em que o Banco ABC Brasil esteja autorizado a operar, deve:

- Fornecer ao Banco ABC Brasil todas as informações solicitadas, por meio de preenchimento e assinatura de ficha cadastral, bem como entregar cópias dos documentos comprobatórios pertinentes;
- Cumprir com as condições ora dispostas, inclusive no que se refere à sua documentação cadastral.

Cabe ao Banco manter atualizado o cadastro de todos os seus clientes.

2.2. DIRETORES RESPONSÁVEIS, SUPERVISÃO DOS PROCEDIMENTOS E CONTROLES INTERNOS

Dois diretores estatutários são responsáveis pelo atendimento à instrução em questão. O primeiro é responsável pela efetiva aplicação do conjunto de regras e controles e o outro pela

supervisão destes procedimentos, de acordo com os termos do art. 4º, incisos I e II, da Instrução CVM nº 505. Cabe a este último encaminhar à Administração, até o último dia útil dos meses de janeiro e julho, relatório relativo ao semestre encerrado contendo:

- As conclusões dos exames efetuados;
- As recomendações a respeito de eventuais deficiências, com o estabelecimento de cronogramas de saneamento, quando for o caso; e
- Manifestação do diretor responsável pela aplicação das regras e controles a respeito das deficiências encontradas em verificações anteriores e das medidas planejadas, de acordo com cronograma específico, ou efetivamente adotadas para saná-las.

Este relatório estará disponível na sede do Banco ABC Brasil para a CVM, para a(s) entidade(s) administradora(s) do mercado em que o Banco esteja autorizado a operar e para o

REGRAS E PARÂMETROS DE ATUAÇÃO NOS MERCADOS ORGANIZADOS

departamento de autorregulação, se for o caso.

3. Ordens

3.1. REGRAS QUANTO AO RECEBIMENTO DE ORDENS

3.1.1. TIPOS DE ORDENS ACEITAS E PRAZO DE VALIDADE DAS ORDENS

O Banco ABC Brasil aceita, para execução nos mercados organizados em que seja autorizado a operar, os tipos de Ordens abaixo identificados:

- a) No âmbito do Mercado Primário:
 - I. Escritas, conforme definidas no item 3.1.3. abaixo;
- b) No âmbito do Mercado Secundário, o Banco ABC Brasil somente atua no mercado de títulos e valores mobiliários negociando posições adquiridas no âmbito do mercado secundário em seu próprio nome, não acatando, portanto, ordens de terceiros a serem executadas a posteriori. Todavia, o Banco ABC Brasil, no âmbito do mercado primário, atua na distribuição e negociação de valores mobiliários ofertados publicamente a terceiros, acatando, portanto, ordens de terceiros a serem executadas posteriormente.

O Banco ABC Brasil observa as definições das Instruções CVM nº 400 e nº 476 e a legislação vigente quando atua como Intermediário na distribuição em oferta pública de valores mobiliários, no âmbito do mercado primário. Observa também o procedimento de coleta de intenções de investimento previsto na Instrução CVM nº 400, de 29 de dezembro de 2003, conforme alterada (“Instrução CVM nº 400”) com relação aos tipos de ordens aceitas.

3.1.2. HORÁRIO PARA RECEBIMENTO DAS ORDENS

As ordens são recebidas durante o horário de funcionamento dos mercados organizados administrados em que o Banco ABC Brasil seja autorizado a operar.

Especificamente no âmbito do mercado primário, observam-se as regras estabelecidas para a coleta de intenção de investimento constantes do procedimento de distribuição de

cada oferta pública em que o Banco ABC Brasil atua como Intermediário.

3.1.3. FORMAS E CRITÉRIOS DE TRANSMISSÃO E ATENDIMENTO DE ORDENS

Somente serão executadas ordens transmitidas ao Banco ABC Brasil nas formas estabelecidas no item 3.1.1 acima e conforme a opção informada pelo cliente à época do fechamento da operação.

São consideradas ordens:

- a) Verbais – transmitidas por telefone e outros sistemas de transmissão de voz; e
- b) Escritas – transmitidas por carta protocolada, fax, meio eletrônico, mensageria instantânea eletrônica e por quaisquer outros meios em que seja possível evidenciar seu recebimento, desde que assegurada a sua autenticidade e integridade, constando, conforme o caso, assinatura, número da linha ou do aparelho transmissor e a hora em que a mensagem foi enviada e recebida.
- c) Via sistemas eletrônicos de conexões automatizadas conectados com os sistemas eletrônicos de negociação dos mercados organizados em que o Banco ABC Brasil esteja autorizado a operar.

3.1.4. PROCEDIMENTOS DE RECEBIMENTO E RECUZA DE ORDENS

O Banco ABC Brasil, em regra, não fará restrições ao recebimento/execução de ordens que estejam de acordo com os parâmetros operacionais estabelecidos nas normas dos respectivos mercados organizados em que seja autorizado a operar que observem os termos e condições ora estabelecidas e a legislação em vigor.

Observa, entretanto, o seguinte:

- a) Considerando que o Banco ABC Brasil não executa, no âmbito do mercado secundário, ordens por conta de terceiros, não será necessário o estabelecimento de mecanismos que visem limitar riscos de seus clientes, em decorrência da variação de

preços e condições excepcionais de mercado.

- b) O Banco ABC Brasil pode, ainda, recusar-se a receber ou executar qualquer ordem a seu exclusivo critério, sempre que verificar a prática de atos ilícitos ou a existência de irregularidades.

3.1.5. PESSOAS AUTORIZADAS A EMITIR / TRANSMITIR ORDENS

O Banco ABC Brasil somente pode receber ordens transmitidas pelo cliente ou por terceiros, desde que devidamente autorizados e identificados. No caso de procurador, cabe ao cliente apresentar a respectiva cópia autenticada do instrumento de procuração ao Banco ABC Brasil, que deve ser arquivada juntamente com os documentos societários do respectivo cliente. Cabe, ainda, ao cliente informar imediatamente o Banco ABC Brasil sobre qualquer revogação do mandato.

3.1.6. REGISTRO DAS ORDENS

O Banco ABC Brasil efetua o lançamento das ordens recebidas em sistema informatizado, apresentando as seguintes informações:

- a) Código ou nome de identificação do cliente no Banco ABC Brasil;
- b) Data, horário e número sequencial que identifica a seriação cronológica de recepção da Ordem;
- c) Descrição do ativo-objeto da ordem (característica e quantidade dos valores mobiliários a serem negociados);
- d) Natureza da operação (compra ou venda; tipo de mercado, preço);
- e) Identificação do transmissor da ordem;
- f) Prazo de validade da ordem;
- g) Tipo de ordem (se aplicável).

3.1.7. CANCELAMENTO OU ALTERAÇÃO DE ORDENS

Toda e qualquer ordem, enquanto não executada, poderá ser cancelada:

- a) por iniciativa do próprio cliente ou pelo terceiro autorizado a transmitir ordens em seu nome:
 - I. caso sejam verificadas alterações

entre os documentos preliminares e definitivos das respectivas ofertas públicas, conforme estabelecido nos arts. 20 e 45, parágrafo quarto, da Instrução CVM nº 400;

- b) por iniciativa do Banco ABC Brasil no caso de:
 - I. a operação, as circunstâncias e os dados disponíveis no Banco ABC Brasil apontarem risco de inadimplência do cliente comprador dos títulos ofertados publicamente;
 - II. contrariar as normas legais ou regulamentares dos mercados organizados em que o Banco ABC Brasil seja autorizado a operar;
 - III. em qualquer outra hipótese prevista no item 3.1.4. acima.

Quando a Ordem tiver sido transmitida por escrito, o Banco ABC Brasil somente acatará pedido de cancelamento feito por escrito.

Os cancelamentos previstos neste item devem estar expressamente identificados no controle que formaliza o registro de ordens.

3.1.8. EXECUÇÃO DAS ORDENS

Execução de ordem é o ato em que o Banco ABC Brasil cumpre a ordem transmitida pelo Cliente, mediante: (i) a emissão de boleta em sistemas internos pela área de negócio do Banco ABC Brasil que fechou a operação junto ao cliente formalizando a operação; a (ii) realização ou o registro de operação e dos valores mobiliários nos mercados organizados em que o Banco ABC Brasil esteja autorizado a operar, procedimento este que ocorrerá na data de liquidação financeira da respectiva oferta pública de valores mobiliários ou na data da liquidação financeira da negociação, quando se tratar de mercado secundário.

O Banco ABC Brasil, para permitir o adequado controle do cliente, confirma tempestivamente a execução das ordens e as condições em que foram executadas.

O Banco ABC Brasil não cobra corretagem ou qualquer outra comissão referente ao recebimento, execução e negociação durante o período de distribuição pública de valores mobiliários objeto das ordens emitidas pelos

REGRAS E PARÂMETROS DE ATUAÇÃO NOS MERCADOS ORGANIZADOS

clientes. Excetua-se a intermediação com valores mobiliários já negociados em mercados organizados, desde que o cliente seja previamente informado sobre a distribuição pública em curso.

3.1.9. ARQUIVAMENTO DOS REGISTROS DE ORDENS

O Banco ABC Brasil arquiva os registros das ordens transmitidas pelos clientes e as condições em que estas foram executadas independentemente de sua forma de transmissão. O arquivamento dos registros de ordens é protegido contra adulterações e permite a realização de auditorias e inspeções.

3.1.10. FORMA E CRITÉRIOS PARA DISTRIBUIÇÃO DOS NEGÓCIOS REALIZADOS

O Banco ABC Brasil orienta a distribuição das operações realizadas nos mercados organizados em que seja autorizado a operar, obedecendo à legislação aplicável e aos normativos editados pela CVM.

3.2. FATORES QUE DETERMINAM A ESCOLHA DO MERCADO E DO SISTEMA DE NEGOCIAÇÃO PARA A EXECUÇÃO DA ORDEM, QUANDO ELES NÃO FOREM INDICADOS PELO CLIENTE

De acordo com as características de cada operação, bem como do público-alvo de cada negociação de valores mobiliários, deve ser definido qual o mercado e o sistema de negociação para a execução das ordens.

4. Sistema de gravação

O Banco ABC Brasil grava todas as ordens verbais recebidas por telefone ou dispositivo semelhante e arquiva todas as ordens escritas

recebidas por sistema de correio eletrônico, que são armazenadas, conforme rotina de *backup diário*.

5. Conflito de interesses

O Banco ABC Brasil e as Pessoas Vinculadas, seguem as normas de conduta previstas nos artigos nº 48 e 55 da Instrução CVM nº 400 no tocante a eventuais conflitos de interesses que possam surgir entre o Banco ABC Brasil, tais pessoas vinculadas e seus clientes nas ofertas públicas de valores mobiliários em que o Banco

ABC Brasil figurar como Intermediário.

O Banco ABC Brasil dispõe para tanto de normativos relacionados aos princípios éticos, regras de conduta e investimentos pessoais.

6. Comunicação

O Banco ABC Brasil comunicará a todos os públicos de interesse sobre quaisquer modificações nas regras descritas anteriormente em seu sítio na rede mundial de computadores. O Banco ABC Brasil disponibiliza

em suas dependências e no sítio supracitado, versão completa e atualizada das regras.

São Paulo, 31 de janeiro de 2018.

Banco ABC Brasil S/A.



REGRAS E PARÂMETROS DE ATUAÇÃO NOS MERCADOS ORGANIZADOS

Banco ABC Brasil S.A.

Av. Cidade Jardim, 803 – 2º andar

CEP 04543-000

Sao Paulo

Brasil

Fone: +55 (0)11 3170 2000

Janeiro 2018