



Relatório de Riscos e Oportunidades Sociais, Ambientais e Climáticas

(RELATÓRIO GRSAC)

Elaborado pelo Diretor Responsável
Referente ao ano de 2023

TULLETT PREBON BRASIL CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS E CÂMBIO LTDA.
ICAP DO BRASIL CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.

São Paulo, 28 de março de 2024.

À Diretoria

Em cumprimento à Resolução 139/2021 e à Instrução Normativa n.º 153/2021, ambas do Banco Central do Brasil ("BACEN"), servimo-nos do presente relatório para informar sobre a governança do gerenciamento do risco social, ambiental e climático, adotada no ano de 2022 pela Tullett Prebon Brasil Corretora de Valores e Câmbio Ltda. ("TP") e pela ICAP do Brasil Corretora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda ("MyCAP"), conjunto referidas como "TP ICAP", incluindo as atribuições e as responsabilidades das áreas envolvidas e os impactos potenciais quando tidos como relevantes.

A TP ICAP entende a relevância das questões sociais, ambientais e climáticas na tomada de suas decisões estratégicas e na gestão de seus riscos, uma vez que tais aspectos são fundamentais na mitigação de riscos financeiros e na promoção de investimentos sustentáveis.

Ainda, a TP ICAP incentiva seus colaboradores a adotar práticas responsáveis no que tange a aspectos sociais, ambientais e climáticos.

1 Introdução

Em dezembro de 2016, o BACEN aprovou a aquisição do controle indireto da MyCAP pela Tullett Prebon PLC, sociedade controladora do Grupo TP ICAP que oferece serviços de corretagem para clientes em diversos países ao redor do mundo, inclusive para clientes brasileiros, por meio da TP.

Como parte do processo de integração das duas empresas, a TP ICAP unificou suas áreas de suporte e de controle, incluindo aqui Políticas e Procedimentos, com o objetivo de otimizar a prestação de serviços para seus clientes.

Para melhor entendimento do ambiente de GRSAC, as Corretoras apresentam neste documento a sua governança do gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático referente à 2022, de forma a reforçar seu compromisso com a transparência e com as melhores práticas sobre o tema. As informações serão dispostas no formato de tabela GVR, nos termos do art. 5º, inciso I, e do art. 9º, caput, da Resolução n.º 139/2021 do BACEN.

Tabela GVR: Governança do gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático

Detalhamento das informações

(a)	Identificação das instâncias de governança da instituição com atribuições no gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático. Considerar as instâncias em seus diversos níveis (estratégico, tático, operacional, de controle e de conformidade, nos termos da Resolução nº 4.595, de 28 de agosto de 2017), com destaque para o CA, a diretoria, o CRO, o comitê de riscos, o comitê de auditoria, outros comitês existentes, e unidades de negócio e de gerenciamento de risco.	A governança de GRSAC é composta pela Diretoria da TP ICAP, pelo Diretor indicado como responsável pelo gerenciamento de tais riscos e pelo Comitê de Risco, Compliance e Operacional ("Comitê RCO").
(b)	Descrição das responsabilidades atribuídas às instâncias identificadas no item (a), e do relacionamento entre elas. Considerar, entre as atribuições, as formas de controle, a delegação de autoridade e a divisão de responsabilidades.	<u>Diretoria:</u> - Estabelecer as diretrizes de GRSAC; - Revisar a Política de GRSAC no mínimo anualmente; e - Fixar os níveis de apetite a riscos sociais, ambientais e climáticos na Declaração de Apetite de Riscos da TP ICAP (RAS). <u>Diretor Responsável pela GRSAC:</u> - Administrar o programa de GRSAC; - Divulgar a Política de GRSAC aos colaboradores; e - Avaliar as práticas de gerenciamento de riscos sociais, ambientais e climáticos, que devem ser conduzidas e implementadas de acordo com as normas e dispositivos legais. <u>Comitê RCO:</u> - Respalidar as instâncias superiores com informações relacionadas a GRSAC; - Revisar a Política de GRSAC no mínimo anualmente e submetê-la à Diretoria; e - Propor e implementar diretrizes para o gerenciamento de riscos sociais, ambientais e climáticos.
(c)	Processo e frequência de recebimento, pelo CA e, na ausência deste, pela diretoria, de informações relativas ao risco social, ao risco	No mínimo anualmente, a Diretoria da TP ICAP revisa e aprova a Política de GRSAC. Ainda, o Comitê de RCO ou qualquer de seus

Detalhamento das informações		
	ambiental e ao risco climático, tendo em vista o descrito no item (b).	membros, durante as reuniões do Comitê ou a qualquer momento pertinente, apresenta, para conhecimento e deliberação da Diretoria, os assuntos relevantes ligados à gestão dos riscos sociais, ambientais e climáticos, observando sempre os níveis de apetite de risco traçados da RAS da TP ICAP.
(d)	Descrição dos critérios utilizados pelo CA e, na ausência deste, pela diretoria para assegurar a consideração do risco social, do risco ambiental e do risco climático, quando relevantes, nos processos de aprovação e revisão: • dos níveis de apetite por riscos da instituição; • das políticas, estratégias e limites de gerenciamento de riscos e de gerenciamento de capital; • do programa de testes de estresse; • das políticas para a gestão de continuidade de negócios; • do plano de contingência de liquidez; • do plano de capital e do plano de contingência de capital; e • da política de remuneração.	A Diretoria da TP ICAP revisa e aprova os níveis de apetite de risco, os quais constam do RAS da companhia. O Diretor responsável pela GRSAC, por sua vez, deve garantir a adequação da RAS aos objetivos estratégicos da TP ICAP, bem como às demais políticas, processos e modelos utilizados pela TP ICAP no gerenciamento de riscos. No que tange ao gerenciamento de capital, a TP ICAP não passou por eventos relevantes relacionados com riscos sociais, ambientais e climáticos ao longo do ano de 2022, não havendo impactos no consumo de seu capital. O programa de testes de estresse é aprovado pelo Diretor de Risco, e considera a integração entre todos os riscos mapeados da TP ICAP, a fim de mitigar os efeitos adversos. A gestão da continuidade de negócios é feita pela área de Risco da TP ICAP, sob a administração do Diretor de Risco da companhia. Cabe ao Risco revisar e submeter à aprovação da Diretoria a Política de Continuidade de Negócios e avaliar os eventos negativos reportados nos monitoramentos. Já os planos de contingência de liquidez, de capital e de contingência de capital são realizados de acordo com os objetivos estratégicos e conforme a regulamentação emanada pelo BACEN. Por fim, os administradores da TP ICAP recebem pró-labore e bonificações fixas, e não estão sujeitos a remunerações variáveis. Conforme sua Política de Remuneração, a TP ICAP cuida para que a remuneração dos administradores seja compatível com a Política de Gestão de Riscos da companhia, a qual abrange os riscos sociais, ambientais e climáticos.
(e)	Formas de monitoramento pelo CA e, na ausência deste, pela diretoria dos objetivos estratégicos e, se aplicável, das metas da instituição relacionados a aspectos sociais, ambientais e climáticos.	O Comitê de RCO ou qualquer de seus membros, durante as reuniões do Comitê ou a qualquer momento pertinente, apresenta, para conhecimento e deliberação da Diretoria, os assuntos

Detalhamento das informações

		relevantes ligados à gestão dos riscos sociais, ambientais e climáticos, observando sempre os níveis de apetite de risco traçados da RAS da TP ICAP. Como forma de monitoramento desses riscos, a TP ICAP visa ao cumprimento da sua Política de GRSAC tanto por colaboradores internos como por terceiros, divulga comunicações que abordam a responsabilidade social, ambiental e climática de cada um, restringe os negócios com empresas e setores da economia onde há evidências de que tais riscos não são respeitados, fomenta os produtos que contribuem em aspectos de natureza social, ambiental ou climático. A TP ICAP ainda preza pela eficiência no uso de recursos naturais e pela economia de baixo carbono, pelo respeito à diversidade e à equidade de seus colaboradores, pelo bem-estar e pela saúde física e mental dos mesmos, pela privacidade e pela segurança dos dados trafegados pela companhia, pela ética e pela transparência.
--	--	---

Este documento entra em vigor a partir da data da sua publicação.

São Paulo, 28 de março de 2024.

TULLETT PREBON BRASIL CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS E CÂMBIO LTDA.
ICAP DO BRASIL CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.