

**ATA DA SESSÃO DE APRECIÇÃO DA PROPOSTA DE TERMO DE
COMPROMISSO APRESENTADA POR GENIAL INSTITUCIONAL CCTVM S.A.
(Relatório SAM Nº 128/2019)**

I – DATA, HORA e LOCAL: Reunião realizada no dia 11 de agosto de 2022, com início às 09h, por videoconferência

II – PARTICIPANTES:

Conselheiros: Aline de Menezes Santos, Henrique de Rezende Vergara, João Vicente Soutello Camarota, Marcus de Freitas Henriques, Murilo Robotton Filho, Rodrigo de Almeida Veiga e Sergio Odilon dos Anjos. André Eduardo Demarco, sem direito a voto.

Ausência Justificada: Conselheiros Carlos Cezar Menezes e José Flávio Ferreira Ramos. O Conselheiro Marcos José Rodrigues Torres declarou-se impedido para análise da proposta.

Convidados: Gabriel Staurengi Murer, Henrique Maciel Schutt do Nascimento, Jessica de Oliveira e Silva, Larissa Helena Freire da Silva, Leonardo Anthero Auriema, Mariana Arantes Fonseca, Maurício Jayme e Silva e Victor Scavone Bellen de Lima, todos da BSM; e Luiz Felipe Costa, Marcio Siqueira, Mariana Mallet e Silvia Bugelli, representantes da Genial Institucional CCTVM S.A.

III – MESA DOS TRABALHOS: Marcus de Freitas Henriques, Presidente; e Fernanda de Souza Soares, Secretária do Conselho de Supervisão.

IV – ORDEM DO DIA: Apreciação da proposta de Termo de Compromisso apresentada por Genial Institucional CCTVM S.A. (Relatório SAM nº 128/2019).

**ATA DA SESSÃO DE APRECIÇÃO DA PROPOSTA DE TERMO DE COMPROMISSO
APRESENTADA POR GENIAL INSTITUCIONAL CCTVM S.A. – Fl. 2 de 5**

**V – DELIBERAÇÕES TOMADAS COM BASE NOS DOCUMENTOS DE
SUPORTE ARQUIVADOS NA SEDE DA BSM:**

O Conselheiro Marcus Henriques foi escolhido como presidente da sessão, nos termos do artigo 8º do Regimento Interno do Conselho de Supervisão, na ausência dos Conselheiros Carlos Menezes e José Flavio Ramos, presidente e vice-presidente do Conselho de Supervisão, respectivamente.

Marcus Henriques abriu a sessão e explicou aos presentes o procedimento a ser adotado na análise da Proposta de Termo de Compromisso.

André Demarco informou que o caso tem origem no Relatório SAM nº 128/2019, que analisou negócios executados pelo [REDACTED] via DMA, por intermédio da Genial, no período de 30/07/2019 a 30/08/2019. A SAM apresentou à Genial a hipótese de que as operações caracterizariam manipulação de preço, com o objetivo de valorizar a posição em custódia do [REDACTED] em CARE11. A Genial não considerou as operações e a justificativa apresentadas pelo [REDACTED] para sua realização como irregulares. Após a primeira comunicação, a SAM identificou que o [REDACTED] realizou novas operações, intermediadas pela Genial, com a mesma dinâmica operacional.

André Demarco destacou que a Genial está melhorando os seus processos de monitoramento de operações, treinamento das equipes e não tem histórico de eventos de manipulação de preços.

Silvia Bugelli mencionou que, em 2019, a Genial recebeu uma comunicação da BSM solicitando informações sobre operações realizadas por um cliente, com um papel específico, em seis pregões, durante o leilão de fechamento. Após a apresentação dos esclarecimentos solicitados, somente em setembro 2021, a BSM



**ATA DA SESSÃO DE APRECIÇÃO DA PROPOSTA DE TERMO DE COMPROMISSO
APRESENTADA POR GENIAL INSTITUCIONAL CCTVM S.A. – Fl. 3 de 5**

enviou um relatório robusto sobre o caso, apresentando à Genial as seis operações inicialmente questionadas e outras seis operações posteriores, totalizando a análise de 12 pregões.

Silvia Bugelli informou que, desde 2019, a Genial implementou novos sistemas de monitoramento de operações e realizou treinamentos de compliance para toda a equipe. Silvia Bugelli destacou que nem a Genial nem seus prepostos tiveram qualquer vantagem com as operações consideradas irregulares. Além disso, não houve qualquer ingerência da Genial sobre as operações, já que as ordens foram inseridas via DMA.

Luiz Felipe Costa ressaltou que a última operação do cliente intermediada pela Genial ocorreu em janeiro de 2021.

Aline Menezes questionou quais dados faltavam na primeira comunicação da BSM para que a Genial analisasse as operações realizadas pelo cliente, realizadas via DMA, *a posteriori*. Quais elementos só foram apresentados na segunda comunicação da BSM.

Silvia Bugelli afirmou que o segundo relatório enviado apresentava todo o livro de ofertas do papel, informação que não estava disponível em 2019. Assim os elementos que configurariam as irregularidades não eram tão claros como no segundo relatório.

Mariana Mallet informou que hoje existe na Genial um grupo específico para cuidar de questões relacionadas a PLD e operações, segregado do grupo que cuida de compliance.



**ATA DA SESSÃO DE APRECIÇÃO DA PROPOSTA DE TERMO DE COMPROMISSO
APRESENTADA POR GENIAL INSTITUCIONAL CCTVM S.A. – Fl. 4 de 5**

Por fim, Silvia Bugelli informou que a Proposta de Termo de Compromisso consiste no pagamento do valor total de R\$ 70.000,00, sendo R\$ 50.000,00 a serem pagos pela Genial e R\$ 20.000,00 pagos pelo Diretor de Relações com o Mercado, Luiz Felipe Costa.

Após discutirem a proposta reservadamente, os Conselheiros deliberaram, por unanimidade condicionar a celebração de Termo de Compromisso ao pagamento do valor total de R\$ 130.000,00, sendo R\$ 100.000,00 a serem pagos pela Genial e R\$ 30.000,00 pagos pelo Diretor de Relações com o Mercado, Luiz Felipe Costa.

Marcus Henriques encerrou a sessão e informando que os Proponentes receberão uma comunicação informando o resultado da deliberação e o prazo para apresentação de resposta sobre o condicionamento da Proposta de Termo de Compromisso.

São Paulo, 11 de agosto de 2022.

Aline de Menezes Santos

Aline de Menezes Santos
Aug 30, 2022 4:53 PM BRT

**Aline de Menezes Santos
Conselheira**

João Vicente Soutello Camarota
João Vicente Soutello Camarota
Aug 31, 2022 12:43 PM BRT

**João Vicente Soutello Camarota
Conselheiro**

Henrique Vergara

Henrique Vergara
Aug 29, 2022 4:47 PM BRT

**Henrique de Rezende Vergara
Conselheiro**

Marcus de Freitas Henriques

Marcus de Freitas Henriques
Aug 26, 2022 8:06 AM BRT

**Marcus de Freitas Henriques
Conselheiro**



**ATA DA SESSÃO DE APRECIÇÃO DA PROPOSTA DE TERMO DE COMPROMISSO
APRESENTADA POR GENIAL INSTITUCIONAL CCTVM S.A. – Fl. 5 de 5**

Murilo Robotton Filho

Murilo Robotton Filho
Aug 30, 2022 17:56:16

**Murilo Robotton Filho
Conselheiro**

Rodrigo de Almeida Veiga

Rodrigo de Almeida Veiga
Aug 26, 2022 10:38 AM BRT

**Rodrigo de Almeida Veiga
Conselheiro**

Sérgio Odilon dos Anjos

Sérgio Odilon dos Anjos
Aug 29, 2022 12:12 PM BRT

**Sérgio Odilon dos Anjos
Conselheiro**