

REGRAS E PARÂMETROS DE ATUAÇÃO NA ATIVIDADE DE NEGOCIAÇÃO E REGISTRO DE OPERAÇÕES BILATERAIS DE DERIVATIVOS.

O **BANCO CITIBANK S.A.**, instituição com sede no estado de São Paulo, na Avenida Paulista, nº 1.111, 2º andar-pare, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 33.479.023/0001-80, doravante simplesmente designado “**BANCO**” ou “**CITIBANK**”, objetivando, na melhor forma e no interesse de seus **CLIENTES**, primando pela capacitação no desenvolvimento de suas atividades e em linha com mais altos padrões, atuar na negociação de operações bilaterais de derivativos, com probidade, transparência com os **CLIENTES**, representado por sua área de Tesouraria, em atendimento ao disposto na Instrução nº 505, de 27 de setembro de 2011 e da Instrução nº 612 de 21 de agosto de 2019, da Comissão de Valores Mobiliários (“**CVM**”), estabelece, por meio deste documento, suas regras e parâmetros de atuação para o recebimento, registro, execução, liquidação e cancelamento das ordens de operações de derivativos recebidas de seus **CLIENTES** e os procedimentos relativos à compensação e à liquidação das respectivas operações.

1. CADASTRO E SUITABILITY

O **CLIENTE**, antes de iniciar suas operações, deverá fornecer todas as informações cadastrais solicitadas mediante o preenchimento, assinatura qualificada e entrega da documentação requerida para cadastro, bem como o preenchimento do questionário de Avaliação do Perfil do Investidor (API) e assinatura do Contrato Master ou Apêndice e o Contrato Global de Derivativos.

O **CLIENTE** deverá, ainda, informar imediatamente ao **BANCO** quaisquer alterações que vierem a ocorrer nos seus dados cadastrais, cumprindo ao **BANCO** promover a correspondente alteração no cadastro do **CLIENTE**, inclusive junto à **CLEARING**. Serão registrados em sistema próprio a data e o conteúdo de quaisquer alterações ou atualizações cadastrais realizadas. O **BANCO**, de acordo com as políticas internas e requerimentos regulatórios, não

aceita ou executa ordens de CLIENTES que não estejam previamente cadastrados ou que estejam com o cadastro desatualizado.

2. ORDENS

Para efeito destas regras e da Instrução CVM nº 505, entende-se por “Ordem” o ato pelo qual o CLIENTE determina a este BANCO que atue nos sistemas de registro da CLEARING para registrar operações com derivativos.

3. FORMA DE EMISSÃO DE ORDENS

O CLIENTE pode contratar operações de derivativos com o CITIBANK por meio das mesas de negociação da Tesouraria, acessando-as via telefone ou por meio de canal eletrônico de comunicação *online* com o CITIBANK (*Chat da Bloomberg*). Uma vez acordados os termos e parâmetros da operação (prazo, valor, notional, etc.), esta é incluída no sistema de boletagem que enviará as informações automaticamente para os sistemas de processamento que, por sua vez, registrarão as respectivas informações na clearing e no sistema que alimenta o plano contábil do CITIBANK.

4. PRAZO DE VALIDADE DAS ORDENS

Para fins de operação de derivativos na Tesouraria do CITIBANK, o CLIENTE efetua a cotação no mercado e se optar por negociar com o CITIBANK será realizada através das mesas de tesouraria durante o horário de funcionamento dos mercados.

5. “AFFIRMATION” E CONFIRMAÇÃO DAS ORDENS

Em tempo hábil, para permitir o adequado controle do CLIENTE, o BANCO enviará um e-mail ao CLIENTE com os dados das ordens e as condições em que foram negociadas o qual o CLIENTE deve responder afirmando a correção dos dados ou contestando caso haja divergência. A confirmação de operações

se dará também mediante a emissão de Nota de Negociação que será assinada pelo CLIENTE e devolvida ao BANCO.

6. REGISTRO DE ORDENS

O BANCO mantém sistema informatizado protegido contra adulterações e passível de auditorias e inspeções para registro de todas as ordens contendo as informações necessárias para os registros contábeis e de processamento, como por exemplo:

- Código ou nome de identificação do CLIENTE no BANCO;
- “Notional” da transação
- Prazo da transação
- Taxas e indexadores da transação
- Numeração sequencial e cronológica da transação;
- Identificação da pessoa de vendas que negociou o Derivativo;

Essas informações serão refletidas na CLEARING.

7. ESPECIFICAÇÃO DOS NEGÓCIOS

O BANCO é responsável por identificar o CLIENTE como comitente final dos negócios de derivativos junto à CLEARING nos termos da regulamentação em vigor.

8. LIQUIDAÇÃO DAS OPERAÇÕES

Os pagamentos referentes às liquidações das operações de derivativos são feitos por meio de movimentação em conta corrente (débito e crédito), transferência (TED) para outras instituições financeiras ou por meio da própria CLEARING, conforme aplicável. Adicionalmente, previamente à liquidação da operação, o CITIBANK envia ao CLIENTE, por e-mail, o aviso de liquidação.

9. CONDUTA

O BANCO exerce suas atividades com boa fé, diligência e lealdade em relação a seus CLIENTES. O CITIBANK está comprometido com os mais elevados padrões de governança corporativa e comportamento individual. Para tanto, possui Código de Conduta atualizado periodicamente e disponível a todos os públicos – Internet e Intranet.

O Código estabelece as normas de comportamento do negócio e a ética em toda empresa e se aplica a todos os funcionários do CITIBANK e a todas suas subsidiárias. Todos os funcionários, diretores e executivos devem ler e seguir este Código. Eventualmente, prestadores de serviços podem estar sujeitos ao Código, por contrato ou outro acordo. Adicionalmente, os funcionários ainda devem observar a Política de Investimentos Pessoais.

10. CONTROLE DE RISCO

O BANCO adota procedimentos internos para o estabelecimento de limites operacionais bem como mecanismos que visem limitar a exposição a risco para cada CLIENTE. O CITIBANK possui áreas independentes e dedicadas ao monitoramento dos riscos operacionais, de crédito e de mercado. O BANCO estabelece mecanismos próprios de gerenciamento de risco intradiário abrangendo as posições em aberto e as movimentações diárias dos seus CLIENTES. Os limites operacionais atribuídos aos CLIENTES são monitorados ao longo do dia.

11. DISPOSIÇÕES GERAIS

Todas as alterações que vierem a ocorrer na legislação e regulamentos relativos aos mercados nos quais o BANCO atua aplicar-se-ão imediatamente às operações realizadas pelo CLIENTE. O BANCO manterá todos os documentos relativos às ordens e às operações realizadas pelo prazo e nos termos estabelecidos pela CVM. O BANCO se compromete a zelar pela integridade e pelo regular funcionamento do mercado e a manter controles quanto ao registro, manutenção e liquidação das operações de derivativos dos CLIENTES,

conciliação diária das operações negociadas constantes na base de dados que gera os extratos de posição fornecidos a seus CLIENTES, bem como informar à CVM, a entidade administradora dos mercados organizados e à entidade autorreguladora a ocorrência ou indícios de violação da legislação no prazo máximo de 5 (cinco) dias úteis da ocorrência ou identificação.

Os termos do presente instrumento poderão ser alterados unilateralmente pelo CITIBANK, hipótese na qual será divulgada tal alteração no site do CITIBANK. O cliente tem ciência de que estará vinculado às Regras em Parâmetros em vigor independentemente da que estava em vigor à época da contratação dos serviços

Sao Paulo, 27 de agosto de 2020.

Pedro Paulo Giubbina Lorenzini

Maria Cecilia Semionato Carmona