

# GRSAC

## 2022

RELATÓRIO DE RISCOS E  
OPORTUNIDADES SOCIAIS,  
AMBIENTAIS E CLIMÁTICAS





## **FÊNIX DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS (DTVM)**

Fundada em 21 de setembro de 2020 a Fênix DTVM – Instituição Financeira autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil desde 29 de outubro de 2020 – é uma instituição exclusivamente dedicada à aquisição de ouro físico oriundo de áreas de mineração que atua de forma pioneira na promoção da conformidade do setor minerário brasileiro e no fomento a práticas e discussões sobre o tema no país.

Citar como:

Fênix Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários. ***Relatório de riscos e oportunidades sociais, ambientais e climáticas.***

## **MEMBROS DO GRUPO DE ELABORAÇÃO DO RELATÓRIO**

Ketyleen de Roma Souza, Gestora de Riscos e Controles Internos / Talita da Silva Pereira Galvão, Gestora de Sustentabilidade.



# SUMÁRIO

APRESENTAÇÃO.....	4
CONTEXTO .....	5
1. GOVERNANÇA .....	6
ESTRUTURA DE GOVERNANÇA .....	6
2. PROCESSO E FREQUÊNCIA DE RECEBIMENTOS DE INFORMAÇÕES .....	11
3. METODOLOGIA DE AVALIAÇÃO.....	12
DESCRIÇÃO DE CRITÉRIOS UTILIZADOS .....	12
4. OBJETIVOS ESTRATÉGICOS.....	15

## **APRESENTAÇÃO**

A Fênix Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários, instituição financeira, devidamente habilitada pelo Banco Central do Brasil, apresentam o presente **RELATÓRIO DE RISCOS E OPORTUNIDADES SOCIAIS, AMBIENTAIS E CLIMÁTICAS - GRSAC**, que reúne as principais informações da Fênix DTVM, tendo divulgação em sítio na internet.

O relatório foi elaborado em atendimento ao art. 56 da Resolução CMN nº4557/2017, com a redação dada pela Resolução BCB Nº 139/2021 e com a Instrução Normativa BCB Nº 153/2021.

O conteúdo apresentado segue a estrutura definida na tabela GRV: Governança do gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático, disponibilizada no Anexo I da Instrução Normativa BCB nº 153 de 15 de setembro de 2021.

O presente relatório é documento público e tem como referência o período de 1º de janeiro a 31 de dezembro de 2022. O objetivo é dar transparência as ações e estratégias da Fênix DTVM no seu compromisso de gerenciamento dos riscos sociais, ambientais e climáticos dentro do seu negócio.

A consolidação das informações relacionadas à gestão de riscos é de responsabilidade da área de risco social, ambiental e climático.

## CONTEXTO

Para a Fênix DTVM, o gerenciamento dos riscos sociais, ambientais e climáticos é essencial para garantir uma gestão responsável e sustentável, visto que tais riscos podem afetar a estabilidade econômica, a credibilidade e a segurança transmitida no mercado. Além disso, gerir riscos sociais, ambientais e climáticos é uma oportunidade de atuar para reduzir as práticas de mão escrava e desigualdades social gerada nesses ambientes. em paralelo, consideramos que o gerenciamento de risco é crucial para proteger o meio ambiente frente a mudanças climáticas, escassez de recursos naturais e perda do nosso ecossistema, tema este, que representa grandes desafios para a sociedade e para a economia mundial.

ao incorporar processos para identificar, avaliar e mitigar riscos, a Fênix DTVM toma providências para proteção dos ativos, estando preparados para garantir a continuidade das operações, identificar potenciais oportunidades, evitar perdas financeiras e assegurar a sustentabilidade do negócio.

Para assegurar a eficácia, a Fênix DTVM evolui constantemente seus processos de gerenciamento de riscos sociais, ambientais e climáticos nos municípios e comunidades onde está presente, como parte das medidas, em 2022 foi criada a Política de Responsabilidade Social, Ambiental e Climática (PRSAC), atendendo à resolução CMN n° 4.945/2021

# 1. GOVERNANÇA

## **ESTRUTURA DE GOVERNANÇA**

### TABELA GVR: Governança do gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático

A Fênix DTVM dispõe de instâncias de governança que possuem atribuições de gerenciamento dos riscos social, ambiental e climático conforme detalhado a seguir. A estrutura de governança têm responsabilidade que visam identificar, classificar, avaliar, monitorar, mitigar e controlar os riscos social, ambiental e climáticos aplicáveis e relevantes nas operações da Fênix DTVM.

A)

- ✓ Diretoria Executiva
- ✓ Diretoria De Governança, Risco e Compliance
- ✓ Gerência De ESG, Risco E Controle Interno
- ✓ Gerência De Compliance Corporativo
- ✓ Gerência De Compliance De Ativos Sensíveis

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

COMPETE A DIRETORIA EXECUTIVA EM RELAÇÃO AO GERENCIAMENTO RSAC:

B)

- Disseminar, acompanhar e promover a cultura de gerenciamento de risco;
- Definir estratégias de negócio;
- Patrocinar a estrutura de gerenciamento de risco e da gerência de sustentabilidade;
- Promover estratégias de sustentabilidade e posicionamento da marca;
- Deliberar sobre a identificação, avaliação e tratamento dos riscos operacionais;
- Fixar níveis de apetite por risco da instituição na declaração de apetite ao risco (RAS);
- Autorizar quando necessário, exceções às políticas, aos limites fixados na RAS;
- Aprovar e revisar a PRSAC;
- Assegurar correção tempestiva de deficiências relacionadas à PRSAC;
- Promover a disseminação interna da PRSAC e das ações garantindo sua efetividade.

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

COMPETE AO DIRETOR RESPONSÁVEL PELA GOVERNANÇA, RISCOS E COMPLIANCE EM RELAÇÃO AO GERENCIAMENTO RSAC:

- ✓ Traçar estratégias para condução e mitigação dos riscos potenciais identificados;
- ✓ Dispor de procedimentos, medidas e orientações que assegurem a aderência dos riscos identificados;
- ✓ Avaliar o resultado das análises sociais, ambientais e climáticas realizadas pela gerência de riscos e sustentabilidade;
- ✓ Documentar na declaração de apetite por risco (RAS), os tipos e os níveis de riscos que são admitidos na realização de negócio e de objetivo estratégico;
- ✓ Implementar e executar os procedimentos descritos nas políticas e nos manuais relativos ao gerenciamento de risco;
- ✓ Implementar ações com vistas à efetividade da PRSAC;
- ✓ Aperfeiçoar as ações implementadas quando identificadas eventuais deficiências;
- ✓ Monitorar a execução do gerenciamento dos riscos social, ambiental e climático;
- ✓ Sugerir soluções de disseminação de conhecimento e de estímulo à conscientização sobre temas e práticas voltados à sustentabilidade, fomentando a criação de uma cultura em prol do tema;

B)



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

COMPETE A GERÊNCIA DE ESG, RISCOS E CONTROLES INTERNOS EM RELAÇÃO AO GERENCIAMENTO RSAC:

- ✓ Acompanhar a execução das iniciativas relacionadas às práticas de sustentabilidade;
- ✓ Manter a estrutura de gerenciamento dos riscos social, ambiental e climático em conformidade com as normas interna e as externa;
- ✓ Promover metodologia que garanta a implementação da PRSAC;
- ✓ Realizar análise prévia dos impactos sociais, ambientais e climáticos de novas modalidades de produtos e serviços;
- ✓ Garantir o monitoramento dos índices que versam as melhores práticas alinhadas aos padrões internacionais;
- ✓ Promover a disseminação interna da PRSAC e das ações garantindo sua efetividade;
- ✓ Participar, quando solicitado, de fóruns internos e externos sobre sustentabilidade, representando os interesses da instituição;
- ✓ Coordenar, acompanhar e participar dos processos de elaboração e de divulgação do relatório de sustentabilidade.

B)

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

COMPETE A GERÊNCIA DE COMPLIANCE CORPORATIVO EM RELAÇÃO AO GERENCIAMENTO RSAC:

- Proteger e garantir a perpetuidade da organização;
- Elaborar normas;
- Garantir a aderência de conformidade conforme regulações vigentes.

B)

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

COMPETE A GERÊNCIA DE COMPLIANCE DE ATIVOS SENSÍVEIS EM RELAÇÃO AO GERENCIAMENTO RSAC:

- Apoiar as áreas na identificação de fragilidades que possam implicar riscos de falta de conformidade
- Controles relacionados ao gerenciamento de RSAC;
- Garantir a aderência de conformidade conforme regulações vigentes.

## 2.PROCESSO E FREQUÊNCIA DE RECEBIMENTOS DE INFORMAÇÕES

---

### TABELA GVR: Governança do gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático

A diretoria executiva recebe tempestivamente informações relativas ao gerenciamento dos riscos sociais, ambientais e climáticos com o objetivo de conhecer os riscos significativos que possam impactar as partes interessadas, os produtos e os serviços da Fênix DTVM, adotando medidas para mitigação dos riscos identificados, além de auxiliar na tomada de decisão em relação à sustentabilidade dos negócios.

C)

## 3. METODOLOGIA DE AVALIAÇÃO

### DESCRIÇÃO DE CRITÉRIOS UTILIZADOS

---

#### TABELA GVR: Governança do gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático

A Fênix DTVM diante das atribuições do segmento da comercialização do ouro, considera os riscos social, ambiental e climático, quando relevantes, nos níveis de apetite por riscos, na política de gerenciamento de riscos e capital abordando o programa de testes de estresse, plano de capital, plano de contingência, e na política de remuneração dos administradores.

D)

Os riscos social, ambiental e climático são observados nas linhas de negócio da Fênix DTVM de acordo com os critérios de elegibilidade e de avaliação estabelecidos e divulgados nos manuais internos em conformidade as regulamentações vigentes.

A partir dos princípios estabelecidos pela PRSAC, é possível realizar análises que norteiam a exposição aos riscos social, ambiental e climático observando os conceitos a seguir.

#### **RISCO SOCIAL**

Processo de gerenciamento de risco tem por objetivo garantir a diversidade e a proteção de direitos nas relações de negócios e das pessoas visando o interesse comum e avaliando impactos negativos e perdas que possam afetar a reputação da Fênix.

#### **RISCO AMBIENTAL**

O processo de gerenciamento de risco ambiental tem por objetivo a realização de avaliações sistêmicas por meio da obtenção de informações ambientais disponibilizadas por órgãos

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

**RISCO CLIMÁTICA**

O processo de gerenciamento de risco climático tem por objetivo a realização de avaliação considerando a probabilidade da ocorrência de eventos com origem climática que possam ocasionar danos aos negócios da fênix. Para isso, são observados os riscos físicos e de transição conforme os conceitos a seguir.

• **RISCO CLIMÁTICO DE TRANSIÇÃO:**

Possibilidade de ocorrência de perdas ocasionadas por eventos associados ao processo de transição para uma economia de baixo carbono, em que a emissão de gases do efeito estufa é reduzida ou compensada e os mecanismos naturais de captura desses gases são preservados.

• **RISCO CLIMÁTICO FÍSICO:**

Possibilidade de ocorrência de perdas ocasionadas por eventos associados a intempéries frequentes e severas ou a alterações ambientais de longo prazo, que possam ser relacionadas a mudanças em padrões climáticos.

A Resolução CMN nº 4.943/2021, que altera a resolução CMN nº 4.557/2017, enfatiza que os riscos social, ambiental e climático devem ser analisados observando a integração aos demais riscos, o que possibilita a identificação, a mensuração, a avaliação, o monitoramento, o reporte, o controle e a mitigação dos efeitos adversos às interações entre os riscos.

A estrutura de gerenciamento integrado de riscos é compatível com a natureza das operações, a complexidade dos produtos e os serviços oferecidos, sendo proporcional à dimensão da exposição ao risco.

D)

## TABELA GVR: Governança do gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático

### **RISCOS OPERACIONAIS E GESTÃO DE CONTINUIDADE DOS NEGÓCIOS**

Dentre os riscos operacionais, destacam-se aqueles relativos a possíveis impactos sociais, ambientais e climáticos nos processos internos da instituição, os quais estão embasados na possibilidade de ocorrência de perdas a partir da avaliação de aspectos financeiros e legais.

- Mapeamento dos riscos operacionais das áreas da instituição, identificando, avaliando e tratando, quando aplicável, os riscos de caráter social, ambiental e climático (quando houver);
- Gestão de perdas operacionais de caráter social, ambiental e climático (quando houver); e
- Planos de continuidade de negócio (PCN) frente a condições ambientais extremas que afetam produtos/serviços críticos, estruturas prediais, o negócio da Fênix DTVM e a preservação de vidas, tais como:
  - PCN - INSTALAÇÕES;
  - PCN - PESSOAS;
  - PCN - EQUIPAMENTOS;
  - PCN - SERVIÇOS;
  - PCN - SISTEMAS.

### **RISCOS DE LIQUIDEZ**

Os riscos sociais, ambientais e climáticos das exposições de câmbio que podem refletir no risco de liquidez, decorrente de eventos de probabilidade de perda.

### **PROGRAMA DE TESTE DE ESTRESSE**

A Fênix DTVM possui sistemas informatizados contratados e fornecidos pela empresa Finaudtec, que auxilia nas projeções de cenários realizados dentro do programa de teste de estresse, adequando variáveis e versando cenários adversos que possam gerar impactos de liquidez e capital para a instituição.

### **RISCO DE CAPITAL**

O gerenciamento de capital da Fênix DTVM é um processo contínuo que tem por principal objetivo avaliar a necessidade de capital frente aos desafios enfrentados para cumprimento estratégico de crescimento. Trata-se de um conjunto de metodologias que permitem identificar, avaliar e controlar as exposições relevantes mantendo capital compatível aos riscos incorridos.

## 4.OBJETIVOS ESTRATÉGICOS

### TABELA GVR: Governança do gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático

Os aspectos sociais, ambientais e climáticos e de governança são relatados por meio **Do Relatório De Ações De Sustentabilidade**. Por conta da natureza do negócio, o interesse pela comunidade minerária, a transparência, a conformidade legal e o dever com o meio ambiente sempre estiveram presentes no esforço empregado pela fênix em nosso modelo de negócio.

#### AGENDA DE SUSTENTABILIDADE

E)

O banco central do brasil (BCB) - alinhado à agenda mundial de sustentabilidade e em consonância com as melhores práticas - inseriu o tema em sua agenda estratégica como uma das cinco dimensões da Agenda BC# e desenvolveu nos últimos anos uma série de medidas, com destaque para a resolução CMN nº 4.945/2021 e a resolução BCB nº 139/2021.

#### DAS METAS

Para a fênix cumprir o seu papel nas práticas sustentáveis, foi elaborado as estratégias de sustentabilidade pautado nos pilares que nos possibilita fazer os negócios de maneira ética e responsável, respeitando o meio ambiente e a sociedade:

- Inovação sustentável;
- Respeito às pessoas;
- Ação contra as mudanças climáticas;
- Governança corporativa responsável;
- Preservação ambiental.

## TABELA GVR: Governança do gerenciamento do risco social, do risco ambiental e do risco climático

Ainda em 2022, a Fênix DTVM reforçou seu compromisso com a sustentabilidade e o desenvolvimento social nos locais em que está presente ao integrar o Pacto Global da ONU, sendo a maior iniciativa de sustentabilidade corporativa do mundo. Por isso assumimos o compromisso de contribuir para o alcance da agenda 2030 do pacto global em prol do desenvolvimento sustentável.

Em 2023, a Fênix DTVM continuará realizando esforços para cumprimento de seus compromissos firmados:

E)

- A criação do comitê de PRSAC, visando o cumprimento da resolução BCB nº 4.945/2021;
- A manutenção e revisão da PRSAC junto aos objetivos estratégicos do negócio;
- Criação do compliance ambiental;
- Transição da energia limpa;
- Conhecer a pegada de carbono das nossas unidades.



A versão disponível para o público do relatório de AÇÕES DE sustentabilidade pode ser acessada em: <https://fenixdtvm.com.br/sustentabilidade/> OU PELO QR CODE.





## CRÉDITOS

Esta publicação é resultado de projeto desenvolvido e executado pelo grupo de trabalho da Diretoria de Governança, Riscos e Compliance do Grupo FNX Participações. Seu conteúdo não reflete as opiniões individuais daqueles que participaram de sua elaboração, e sim o entendimento atual da Fênix DTVM sobre o assunto.

***fenixdtvm.com.br***

