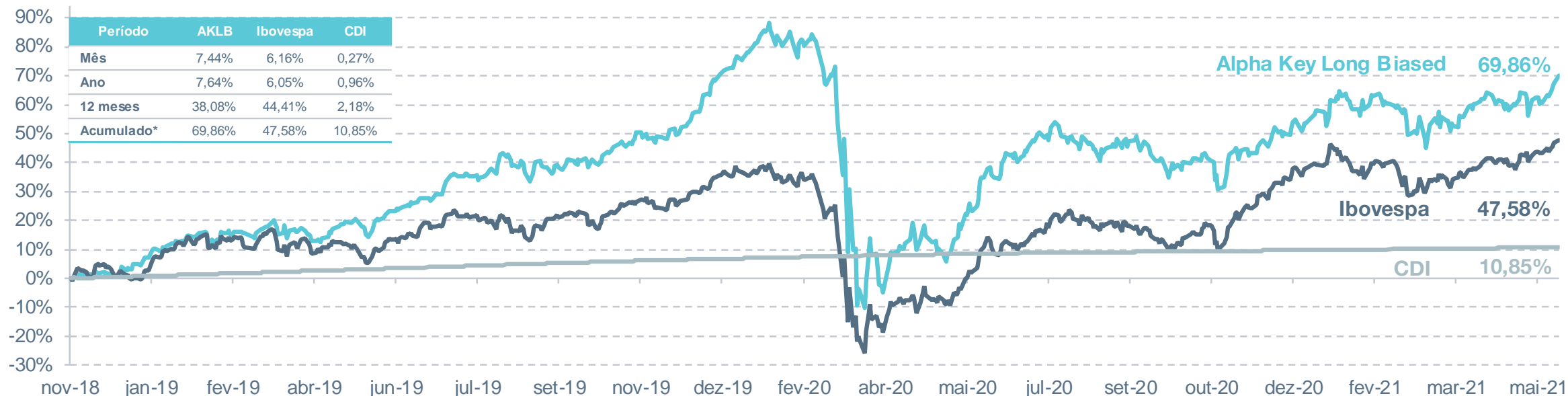




Performance

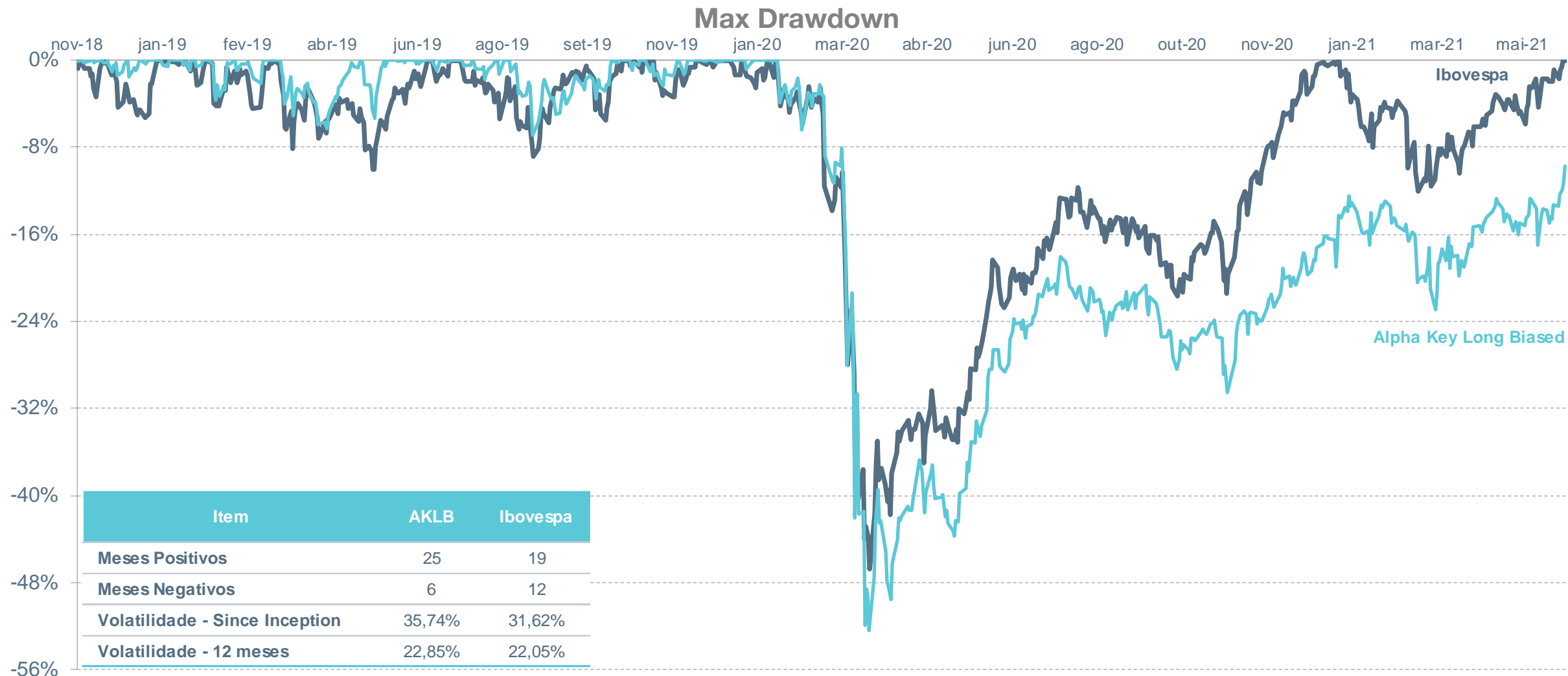
Alpha Key Long Biased FIM



| | | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Acumulado Ano | Acumulado Início |
|------|------------------|--------|--------|---------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------------|------------------|
| 2021 | Alpha Key LB FIM | 0,28% | -5,38% | 4,17% | 1,36% | 7,44% | - | - | - | - | - | - | - | 7,64% | 69,86% |
| | Ibovespa | -3,32% | -4,37% | 6,00% | 1,94% | 6,16% | - | - | - | - | - | - | - | 6,05% | 47,58% |
| | CDI | 0,15% | 0,13% | 0,20% | 0,21% | 0,27% | - | - | - | - | - | - | - | 0,96% | 10,85% |
| 2020 | Alpha Key LB FIM | 4,52% | -7,43% | -38,16% | 11,01% | 7,28% | 15,91% | 3,48% | -1,73% | -5,80% | -4,24% | 11,23% | 8,45% | -8,60% | 57,81% |
| | Ibovespa | -1,63% | -8,43% | -29,90% | 10,25% | 8,57% | 8,76% | 8,27% | -3,44% | -4,80% | -0,69% | 15,90% | 9,30% | 2,92% | 39,16% |
| | CDI | 0,38% | 0,29% | 0,34% | 0,28% | 0,24% | 0,22% | 0,19% | 0,16% | 0,16% | 0,16% | 0,15% | 0,16% | 2,77% | 9,79% |
| 2019 | Alpha Key LB FIM | 7,84% | 0,04% | 0,60% | 1,79% | 4,01% | 4,78% | 5,46% | 2,84% | 0,86% | 4,74% | 2,69% | 13,60% | 60,90% | 72,64% |
| | Ibovespa | 10,82% | -1,86% | -0,18% | 0,98% | 0,70% | 4,06% | 0,84% | -0,67% | 3,57% | 2,36% | 0,95% | 6,85% | 31,58% | 35,22% |
| | CDI | 0,54% | 0,49% | 0,47% | 0,52% | 0,54% | 0,47% | 0,57% | 0,50% | 0,47% | 0,48% | 0,38% | 0,38% | 5,97% | 6,83% |
| 2018 | Alpha Key LB FIM | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 1,82% | 5,38% | 7,30% | 7,30% |
| | Ibovespa | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 4,65% | -1,81% | 2,76% | 2,76% |
| | CDI | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,32% | 0,49% | 0,82% | 0,82% |

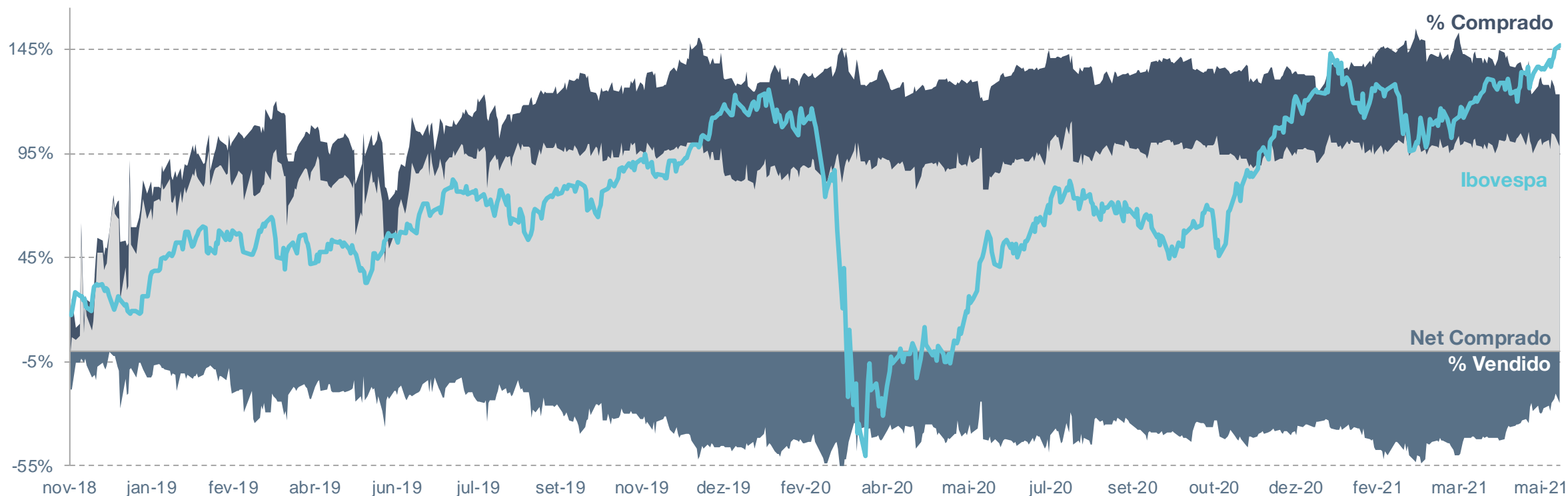
Data de início: 12 de novembro de 2018. O Alpha Key Long Biased FIC FIM é resultado da cisão do Alpha Key Long Biased CSHG FIC FIM em 28 de fevereiro de 2020. Os índices Ibovespa e CDI são utilizados apenas como referência para análise; a taxa de performance do Fundo é calculada com base no IPCA + Yield IMA-B

Histórico de rendimento



O índice Ibovespa é utilizado apenas como referência para análise; a taxa de performance do Fundo é calculada com base em 100% do CDI.

Exposição diária



Concentração por estratégia

| % Portf. Long | # de Ações | % Portf. Short | # de Ações |
|---------------|------------|----------------|------------|
| 25% | 3 | 25% | 1 |
| 50% | 8 | 50% | 2 |
| 75% | 14 | 75% | 2 |
| 100% | 27 | 100% | 6 |

Liquidez

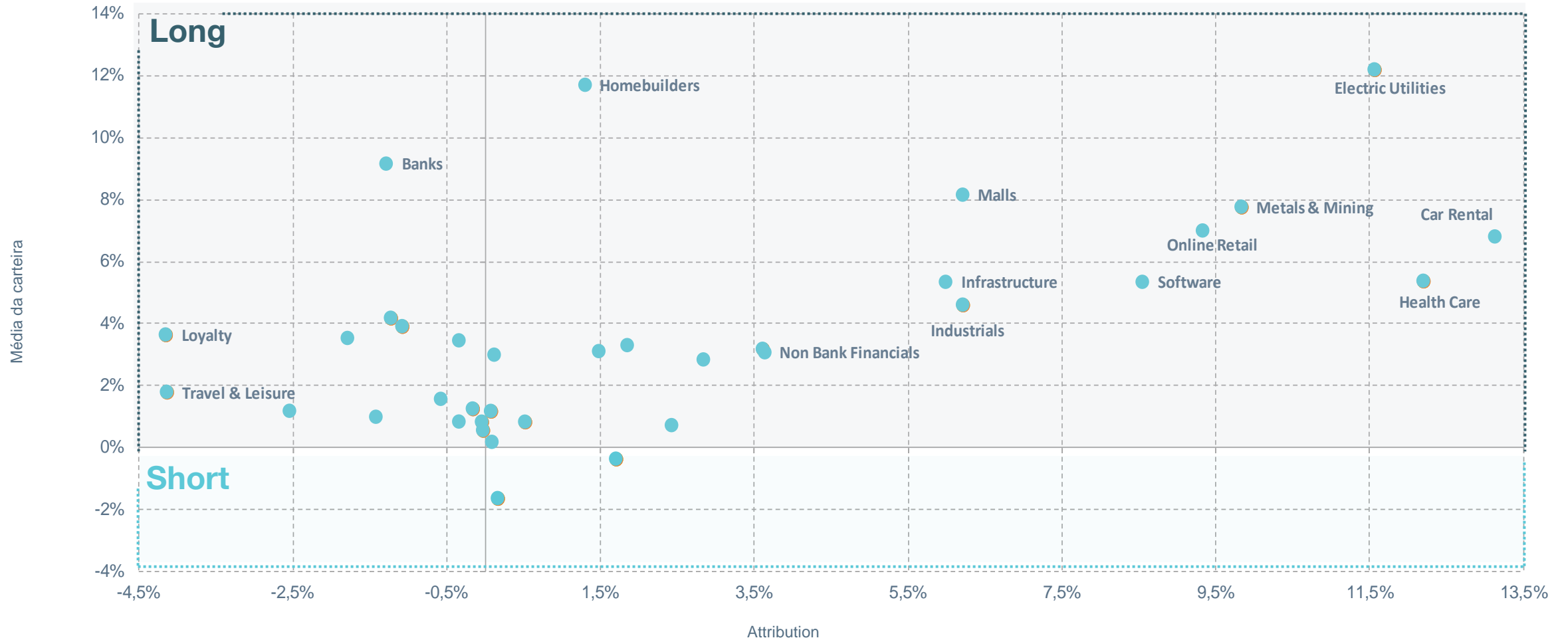
| Volume médio diário | % da exposição |
|---------------------|----------------|
| Até R\$ 1m | - |
| R\$ 1m a R\$ 5m | - |
| R\$ 5m a R\$ 15m | 6,3% |
| Acima de R\$ 15m | 93,7% |

Market Cap

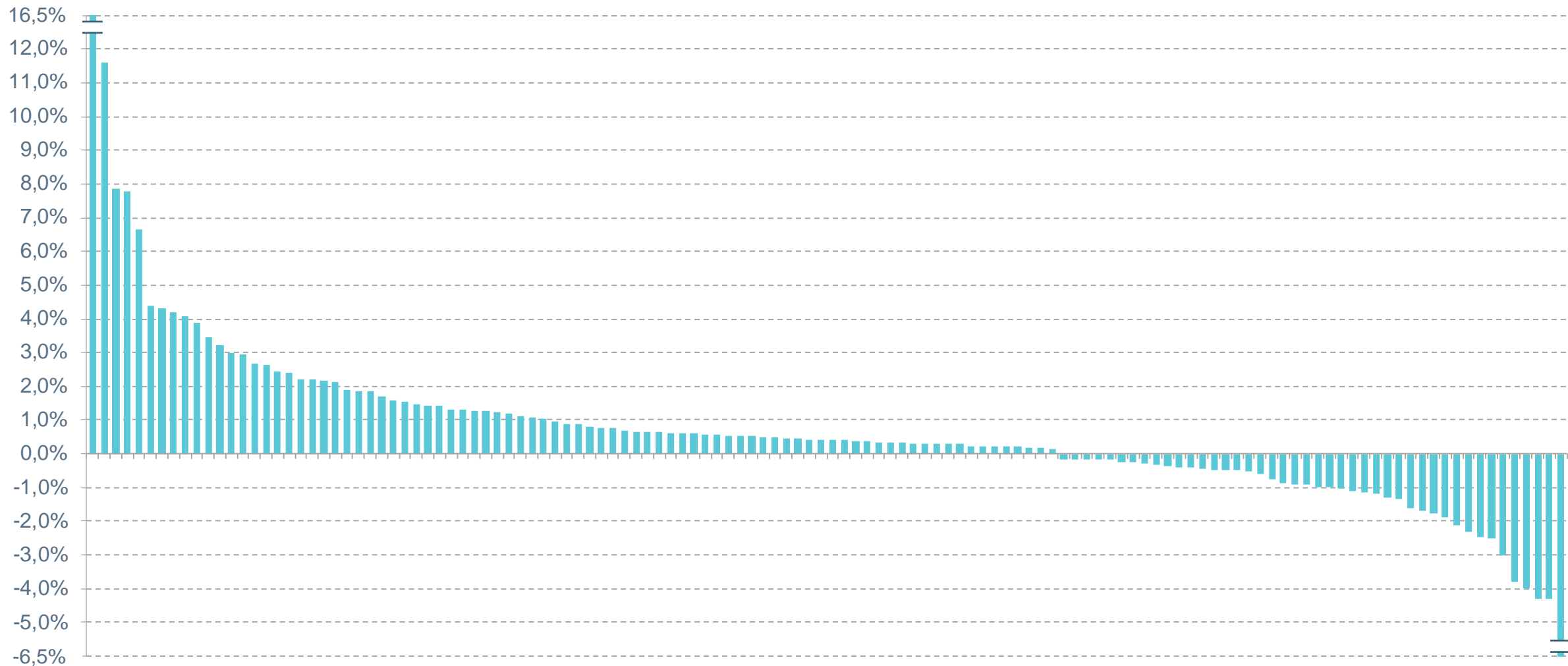
| Market Cap | % da exposição |
|----------------------------|----------------|
| Até R\$ 2 bi | 4,0% |
| Entre R\$ 2 bi e R\$ 5 bi | 14,1% |
| Entre R\$ 5 bi e R\$ 10 bi | 17,3% |
| Acima de R\$ 10 bi | 64,6% |

Histórico de retornos e exposição média

Attribution x Carteira

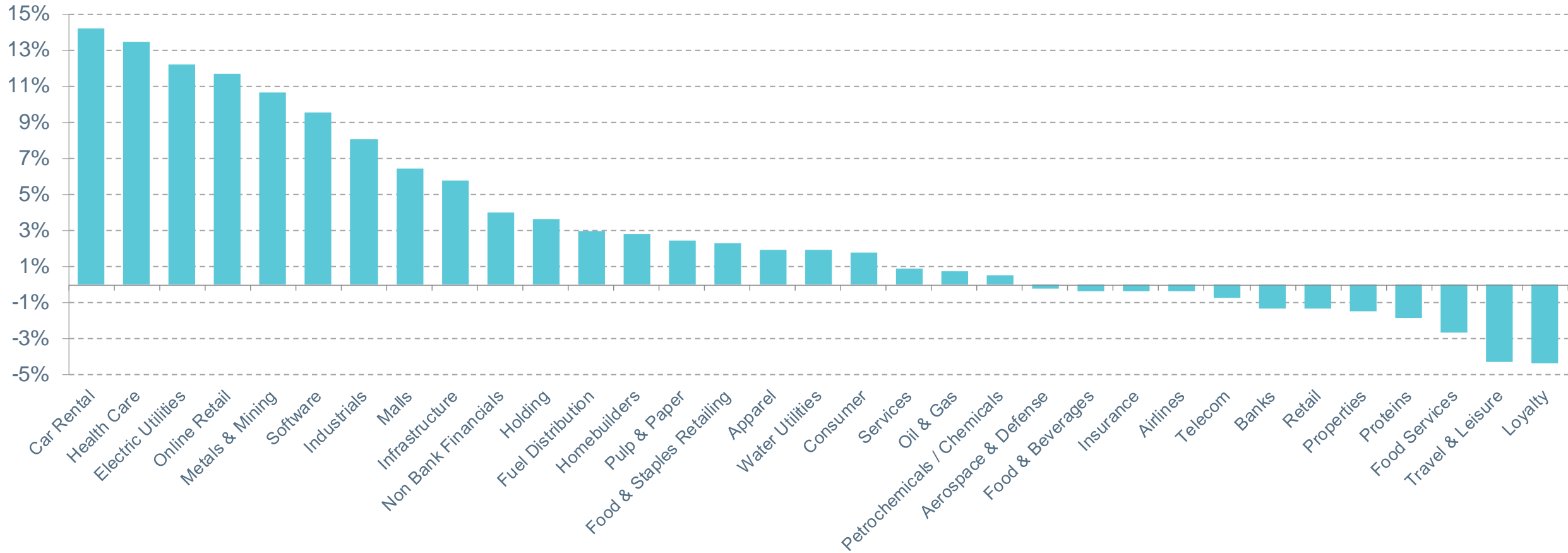


Attribution por estratégia



Data de início: 12 de novembro de 2018; excluídos caixa e despesas.

Attribution por setor



Data de início: 12 de novembro de 2018; excluídos Ibovespa, smal, caixa e despesas.

Alpha Key Long Biased



| | Alpha Key Long Biased FIC FIM |
|--|--------------------------------------|
| Patrimônio Líquido em 31/05/2021 | R\$ 218.297.103 |
| Patrimônio Médio - 12 meses | R\$ 84.034.550 |
| Data de Abertura | 12 de Novembro de 2018 |
| Aplicação Mínima | R\$ 5.000,00 |
| Cotização Resgate | D + 30 |
| Classificação Anbima | Multimercado Livre |
| Taxa de Administração | 2,0% a.a. |
| Taxa de Performance | 20% do que exceder IPCA + Yield IMAB |
| Custódia e Controladoria | BNY Mellon |
| Administração | BNY Mellon |
| Público Alvo | Investidores Qualificados |
| Tributação Aplicável | Renda Variável |
| Taxa de Performance entre 10/Mai/2019 e 31/Dez/2020 | 20% do que exceder 100% do CDI |

O Alpha Key Long Biased FIC FIM é resultado da cisão do Alpha Key Long Biased CSHG FIC FIM em 28 de fevereiro de 2020.

As informações contidas neste material são de caráter meramente informativo e não representam aconselhamento de investimento.

Leia o formulário de informações complementares, prospecto e/ou o regulamento antes de investir. Para investir em nossos fundos, contate um distribuidor autorizado; não realizamos distribuição de cotas.

Os investimentos em fundos não são garantidos pelo administrador nem por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo Fundo Garantidor de Crédito (FGC). A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros. Os fundos geridos pela Alpha Key Capital Management Investimentos Ltda. (“Alpha Key”) podem estar autorizados a realizar aplicações em ativos negociados no exterior. Os fundos geridos pela Alpha Key podem estar expostos a significativa concentração em ativos de poucos emissores, com riscos daí decorrentes. Os fundos geridos pela Alpha Key podem utilizar estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento; tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo dos fundos.

Para avaliação da performance do fundo de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Nos fundos geridos pela Alpha Key a data de conversão de cotas é diversa da data de aplicação e de resgate e a data de pagamento do resgate é diversa da data do pedido de resgate.

Este material é de propriedade da Alpha Key. É vedada a circulação e reprodução, no todo ou em parte, sem a devida autorização expressa prévia. A Alpha Key não se responsabiliza pela publicação acidental de informações incorretas.