

POLÍTICA DE PREVENÇÃO E COMBATE À LAVAGEM DE DINHEIRO E AO FINANCIAMENTO AO TERRORISMO, *KNOW YOUR CLIENT* E *KNOW YOUR SUPPLIER*

DA

ALPHA KEY CAPITAL MANAGEMENT INVESTIMENTOS LTDA.

A Política de Prevenção e Combate à Lavagem de Dinheiro, de *Know Your Client (KYC)* e *Know Your Supplier (KYS)* (“Política”), aprovada pela Administração da Alpha Key, estabelece princípios e regras aplicáveis a todos os Colaboradores Internos da **ALPHA KEY CAPITAL MANAGEMENT INVESTIMENTOS LTDA.** (“Alpha Key”).

Os Colaboradores devem cumprir as exigências desta Política e, além disso, assumem a responsabilidade profissional de agir de maneira ética em todos os atos que pratiquem.

Para fins da presente Política, serão aplicadas as definições listadas no Item I do Código de Ética e de Políticas Internas da Alpha Key, salvo se outro significado lhes for expressamente atribuído neste documento.

A responsabilidade pelo monitoramento, treinamento e aprimoramento desta política é compartilhada entre as Áreas de Risco e de *Compliance*, conforme o tema. Caberá à Administração aprovar eventuais alterações.

1.1. Abordagem baseada em risco

A classificação de riscos permite que, conforme os riscos de LD-FT aumentam, os controles fiquem proporcionalmente mais rigorosos. Ou seja, nos permite aplicar o grau de controle adequado ao risco identificado.

A Alpha Key classifica seus riscos em alto, médio e baixo. O maior grau de risco em um dos critérios da matriz dá à operação a respectiva classificação, ainda que seja nos demais critérios ela seja classificada com menor risco.

Sua matriz abrange essencialmente:

- a categoria da negociação ou do ente envolvido;
- em caso de operações com ativos, o mercado onde a negociação é realizada e a contraparte, quando possível identificar;
- se Cliente, o acesso aos seus dados cadastrais e seu histórico;

- se prestador de serviços, seu renome ou relação com entidades renomadas do mercado, porte, sua aderência às diretrizes Anbima e políticas internas alinhadas às políticas da Alpha Key.

Sua implementação é feita pela Diretoria de *Compliance*, juntamente com a Área de Relações Institucionais e a Administração, exceto no que tange a negociação de ativos, que é de responsabilidade da Diretoria de Risco, com suporte da área de gestão.

Uma vez classificado o risco, são adotadas como medidas de mitigação:

- alto risco: aprovação apenas com aval da Administração, a ser obtido em reunião de Comitê de *Compliance*;
- médio risco: aprovação pela Diretoria de *Compliance* ou Diretoria de Risco, de acordo com o tema;
- baixo risco: aprovação instantânea.

A classificação de riscos, bem como as medidas mitigadoras dela decorrentes, será realizada antes de qualquer operação e contratação, nos casos de negociações de ativos e contratação de prestadores de serviços ou Colaboradores e, anualmente, nos demais casos.

Os casos suspeitos serão reportados à Unidade de Inteligência Financeira (UIF), nos termos da legislação vigente.

1.2. Negociações de ativos

A Diretoria de Risco manterá os controles e o devido monitoramento das operações em bolsa ou nos mercados de balcão organizado que envolvam papéis de baixa liquidez e passível de identificação da contraparte e, por exemplo, determinar um direcionamento a ganhos e perdas. Para tanto, irá monitorar e avaliar a faixa de preço dos ativos e valores mobiliários a serem negociados pelos fundos de investimento sob sua gestão vis à vis os parâmetros de mercado. Eventuais ativos ofertados em condições fora da normalidade automaticamente deixarão de ser objeto de negociação pela Alpha Key.

Além da experiência das equipes de gestão e risco da Alpha Key na avaliação dos critérios de negociação e liquidez dos ativos listados em bolsa, as regras definidas pela B3 em relação às quantidades negociadas e oscilações relevantes de preço serão utilizadas como parâmetro.

Qualquer atuação suspeita em relação à contraparte nas operações realizadas pelos

fundos de investimentos e carteiras administradas geridos pela Alpha Key serão analisadas pela Diretoria de Risco, que conduzirá o caso à Administração e às autoridades competentes, se julgar pertinente, observadas a Abordagem Baseada em Risco adotada pela Alpha Key (ABR), as orientações do Ofício-Circular nº 5/2015/SIN/CVM e demais normas aplicáveis.

A análise do grau de risco será feita mediante a avaliação dos instrumentos utilizados, a forma de realização, o ambiente de negociação, as partes e valores envolvidos, a capacidade financeira e a atividade econômica do cliente, quando conhecidas.

1.3. Relacionamento com os Investidores

A distribuição de cotas dos fundos de investimento sob gestão da Alpha Key será realizada por instituições devidamente habilitadas e/ou agentes autônomos de investimentos, que serão responsáveis pela aplicação dos procedimentos de identificação e verificação dos investidores, conhecidos como *Know Your Client (KYC)*, que deverá atender, no mínimo, os requisitos abaixo.

Adicionalmente, sempre que solicitado pelos administradores fiduciários e/ou distribuidores dos fundos sob sua gestão, as Diretorias de Relações com Investidores e de *Compliance* auxiliarão na identificação de novos clientes previamente à efetiva realização dos investimentos e reportarão quaisquer operações suspeitas, dentro do limite que for possível dado que a atividade da Alpha Key é de Administração de Recursos, na categoria gestão de carteiras e não de Distribuição ou Administração Fiduciária.

Os Colaboradores devem assegurar que a instituição responsável pela distribuição adote métodos confiáveis de *KYC* e de identificação do serviço adequado ao perfil de cada cliente (*suitability*).

1.3.1. Know Your Client (KYC)

O *KYC* diz respeito à identificação do investidor que deve ser estabelecida antes da concretização da operação de investimento.

Para a distribuição de cotas dos fundos geridos pela Alpha Key, será necessário, no mínimo, apresentar os seguintes documentos:

Para pessoas físicas:

- Nome completo;
- RG;
- CPF;
- Comprovante de endereço;
- Informação se se trata de Pessoa Politicamente Exposta (PPE); e
- Referência comercial.

Para pessoas jurídicas:

- Denominação/Razão Social;
- CNPJ;
- Atos constitutivos e contrato ou estatuto social em vigor;
- Ato de eleição dos representantes legais; e
- Documentação dos representantes legais (conforme previsto para o cadastro de pessoas físicas).

O Distribuidor também deverá estabelecer critérios para identificar:

- os Beneficiários Finais, especialmente quando detiverem mais de 20% do capital social da PJ investidora;
- as Pessoas Físicas que exercem o controle da entidade sem fins lucrativos, independentemente do percentual de participação societária. Neste caso, deverão ser identificadas as pessoas naturais autorizadas a representá-las, bem como seus controladores, administradores e diretores;
- se o CNPJ ou o CPF analisado aparece em mídias negativas e/ou listas restritivas publicadas por órgãos oficiais.

1.3.2. Paraísos Fiscais

Para todos os efeitos previstos nos dispositivos legais, consideram-se países ou dependências que não tributam a renda ou que a tributam à alíquota inferior a 20% ou, ainda, cuja legislação interna oponha sigilo relativo à composição societária de pessoas jurídicas ou à sua titularidade, de acordo com o disposto na legislação tributária em vigor.

Tendo em vista que os paraísos fiscais são comumente utilizados para a prática de crimes.

1.4. Relacionamento com os Clientes

Os Clientes da Alpha Key são os fundos de investimentos por ela geridos. A abordagem baseada em risco adotada pela Alpha Key classifica os riscos de fundos exclusivos mediante a análise dos dados cadastrais do beneficiário final, a eventual condição de PPE ou de organização não governamental, bem como seu porte com base no faturamento anual.

A Diretoria de *Compliance* consultará *sites* de busca e listas restritivas a fim de checar a existência de informações desabonadoras.

A presença de informações negativas relevantes impactarão a classificação de risco do Cliente e, conseqüentemente, o critério para sua aprovação, conforme o grau de risco indicado na matriz.

1.5. Contratação de Prestadores de Serviços Relevantes e Outros Terceiros

Os prestadores de serviços estratégicos, assim considerados aqueles cuja atuação tenha relação direta com o objetivo social da Alpha Key ou esteja relacionada com alguma de suas políticas internas, deverão passar por *background checking* prévio à contratação, a ser realizado pela Diretoria de *Compliance*.

A área que desejar contratar um terceiro deverá contatar a Diretoria de *Compliance*, que avaliará a necessidade do procedimento, que, se aplicável, deverá atender aos requisitos fixados na matriz de risco.

Os prestadores de serviços serão avaliados segundo seu posicionamento no mercado, aderência ao Código Anbima pertinente e o conteúdo do questionário de *Due Diligence* modelo Anbima. Estarão isentos da avaliação prévia os que fizerem parte do *Ranking* Anbima de Mercado de Renda Variável do ano imediatamente anterior ou forem associados à ANCORD.

Eventuais indícios de lavagem de dinheiro/financiamento ao terrorismo elevarão o grau de risco, o que impactará nos critérios para sua aprovação, conforme a matriz de risco da Alpha Key.

Com base nos resultados obtidos, a Diretoria de *Compliance* informará a área interessada que pode seguir com a contratação ou adotará o procedimento previsto na matriz, de acordo com o grau de risco identificado.

As corretoras e os distribuidores para serem contratados para prestar serviço em nome do fundo devem obrigatoriamente possuir registro na CVM e na ANBIMA para exercer o serviço na categoria do contrato.

Adicionalmente, para os Fundos CVM 175 os distribuidores que desejarem prestar serviço “Conta e Ordem” devem ter registro de Escriturador ou contratar uma instituição terceira que preste o serviço de escrituração para ele.

Todos os contratos firmados para a prestação de serviço que envolvam os Fundos CVM 175, serão compartilhados com os Administradores, nos termos e prazos da regulamentação vigente.

1.6. Colaboradores Internos

Antes da contratação, serão adotados os mesmos critérios previstos para KYC e analisados o histórico e a conduta profissionais com foco nos princípios e valores disposto no Código de Ética. Na hipótese de envolvimento prévio em operações de lavagem de dinheiro, financiamento ao terrorismo ou outra que desanobe o candidato, a contratação não será efetivada.

Colaboradores já contratados, ainda que membros da Administração, que venham a se envolver nas referidas operações ou em situações que coloquem em dúvida sua integridade, ficarão sujeitos às sanções previstas no Código de Ética e, ainda, às consequências legais cabíveis.

Ata 18_11_22 – aprovado monitoramento usando tb:

1. <https://register.fca.org.uk/s/> - Autoridade de Conduta Financeira do Reino Unido (FCA)
2. <https://sanctionssearch.ofac.treas.gov/> - Escritório de Controle de Ativos Estrangeiros dos EUA (OFAC)
3. <https://www.fincen.gov/msb-state-selector> - Rede de Combate a Crimes Financeiros dos EUA (FINCEN)
4. <https://ec.europa.eu/transparencyregister/public/consultation/search.do?locale=pt&r>

eset= - Comitê contra a Lavagem de Dinheiro, Recursos Ilícitos e o Financiamento ao Terrorismos

(MONEYVAL)

5. <https://www.worldbank.org/> - Banco Mundial

6. <https://siscoaf.coaf.gov.br/siscoaf-internet/pages/cadastroPO/tipoPO.jsf> - Agências de

autoridade policial e regulatória de cada jurisdição local, das listas de trabalho escravo

7. <http://www.portaltransparencia.gov.br/download-de-dados/ceaf> - Expulsões da administração federal (CEAF)

8.

<http://www.portaltransparencia.gov.br/sancoes/ceis?ordenarPor=nome&direcao=asc>. - Empresas inidôneas e suspeitas (CEIS)

9. <https://servicos.ibama.gov.br/ctf/publico/areasembargadas/ConsultaPublicaAreasEmbargadas.php> - Embargos ambientais de origem de aquisição (IBAMA)

10.

<http://www.portaltransparencia.gov.br/sancoes/cepim?ordenarPor=nome&direcao=asc> -

Entidades sem fins lucrativos impedidas (CEPIM)

11. <http://www.portaltransparencia.gov.br/sancoes/cnep> - Empresas punidas (CNEP)

12. <https://www.interpol.int/How-we-work/Notices/View-Red-Notices> - INTERPOL78

13. <http://www.fazenda.gov.br/assuntos/atuacao-internacional/prevencao-e-combate-a-lavagemde-dinheiro-e-ao-financiamento-do-terrorismo>

14. <https://www.un.org/securitycouncil/content/un-sc-consolidated-list> - Conselho das Nações

Unidas

15. [https://www.fatf-gafi.org/publications/high-risk-and-other-monitoredjurisdictions/?hf=10&b=0&s=desc\(fatf_releasedate\)](https://www.fatf-gafi.org/publications/high-risk-and-other-monitoredjurisdictions/?hf=10&b=0&s=desc(fatf_releasedate)) - Lista do Gafi

16.

<http://normas.receita.fazenda.gov.br/sijut2consulta/link.action?visao=anotado&idAto=16002>

- Norma da Receita Federal contendo países, jurisdições, dependências ou locais com tributação

favorecida e submetidos a regimes fiscais privilegiados

| Alteração inserida | Ano | Responsável pela proposta | Aprovação |
|--|------------|----------------------------------|------------------|
| Aprovação de mudanças pela Administração | 2021 | Simone de Grandis | Comitê Executivo |
| Compartilhamento de deveres da Política com Diretoria de Risco e introdução da ABR | 2021 | Simone de Grandis | Comitê Executivo |
| Introdução de novas medidas de KYC para fundos exclusivos | 2021 | Simone de Grandis | Comitê Executivo |
| Atualização do nome da Política | 2022 | Simone de Grandis | Comitê Executivo |
| Atualização do termo COAF para UIF | 2022 | Simone de Grandis | Comitê Executivo |
| Modificação do procedimento KYSupplier | 2022 | Simone de Grandis | Comitê Executivo |
| Revisão Anual | 2024 | Daniela Sessa | Comitê Executivo |