

Política de PLD/FTP

ORYX CAPITAL LTDA.

Junho de 2023

Este material foi elaborado pela Gestora e não pode ser copiado, reproduzido ou distribuído sem prévia e expressa concordância da Gestora.

Sumário

Capítulo 1.	Introdução e Objetivo	3
Capítulo 2.	Execução e Responsabilidades	4
Capítulo 3.	Procedimentos de Know your Client – KYC e Know your Employee – KYE	6
Capítulo 4.	Investidores de Alto Risco	7
Capítulo 5.	Possibilidade de Veto em Razão do Risco	7
Capítulo 6.	Investimentos Realizados pelos Fundos de Investimento – Ativos	8
Capítulo 7.	Operações Diretas	9
Capítulo 8.	Reespecificação	9
Capítulo 9.	Monitoramento de Situações Atípicas	9
Capítulo 10.	Monitoramento de Preços	10
Capítulo 11.	Comunicação ao COAF	10
Capítulo 12.	Monitoramento da Área de Compliance	12
Capítulo 13.	Abordagem Baseada em Risco	13
Capítulo 14.	ABR de Serviço de Gestão	13
Capítulo 15.	Treinamento dos Colaboradores	14
Capítulo 16.	Retenção, Conservação e Acesso de Arquivos	15
Capítulo 17.	Cumprimento de Sanções Impostas por Resoluções do CSNU	15
Capítulo 18.	Aspectos do Relatório de <i>Compliance</i> , Riscos e PLD/FTP	16
Capítulo 19.	Atualizações e Análises de Novas Tecnologias	17
ANEXO I		18
ANEXO II		21

Capítulo 1. Introdução e Objetivo

Os Colaboradores devem evitar o envolvimento involuntário da Gestora em atividades criminosas, incluindo o uso inadvertido da Gestora como intermediária em qualquer tipo de processo que vise a ocultar a verdadeira fonte de recursos procedentes de atividades criminosas de lavagem de dinheiro, ao financiamento do terrorismo e ao financiamento da proliferação de armas de destruição em massa (respectivamente, “Lavagem de Dinheiro”, “Financiamento ao Terrorismo” e “Financiamento da Proliferação de Armas”), observado, especialmente, o disposto na Lei nº 9.613, de 3 de março de 1998, conforme alterada, inclusive, pela Lei nº 12.683, de 9 de julho de 2012 (“Lei nº 9.613/1998” e “Lei nº 12.683/2012”, respectivamente), e na Resolução da CVM nº 50, de 31 de agosto de 2021 (“Resolução CVM 50”).

O crime de lavagem de dinheiro caracteriza-se por práticas econômico-financeiras que têm por finalidade dissimular ou ocultar a origem ilícita de determinados ativos financeiros ou bens patrimoniais, de forma a que tais ativos aparentem uma origem lícita ou a que, pelo menos, a origem ilícita seja difícil de demonstrar ou provar. O processo envolve, teoricamente, 3 (três) fases ou etapas: colocação, ocultação e integração. Ainda, a Lei nº 9.613/1998 foi alterada pela Lei nº 12.683/2012, ocasião em que se modificou a lista taxativa dos crimes precedentes para o conceito mais amplo de “infração penal”. Assim, o crime se caracteriza sempre que os bens, direitos ou valores forem provenientes de qualquer infração penal.

Já o Financiamento ao Terrorismo (em conjunto com a Lavagem de Dinheiro e Financiamento da Proliferação de Armas, “LDFTP”) tem como fundamento a existência de indícios ou provas da prática de terrorismo, de seu financiamento ou de atos a ele correlacionados, por pessoas naturais, jurídicas ou entidades. O art. 2º da Lei 13.260, de 16 de março de 2016 (“Lei nº 13.260/2016”), define como terrorismo a prática de determinados atos pré-identificados legalmente por razões de xenofobia, discriminação ou preconceito de raça, cor, etnia e religião, quando cometidos com a finalidade de provocar terror social ou generalizado, expondo a perigo pessoa, patrimônio, a paz pública ou a incolumidade pública.

A prática de atos de Financiamento ao Terrorismo prescinde de identificação de montante relevante ou substancial para auxílio ou financiamento de tais práticas, bastando a identificação de qualquer volume financeiro utilizado para tal fim para que sejam tomadas as medidas de reporte e combate previstas nesta Política.

A Lei nº 9.613/1998 também institui medidas que conferem maior responsabilidade a intermediários econômicos e financeiros, inclusive administradores de recursos de terceiros, e cria, no âmbito do Ministério da Economia, o Conselho de Controle de Atividades Financeiras (“COAF”), que é uma “Unidade de Inteligência Financeira” (em inglês, “*FIU – Financial Intelligence Unit*”, órgão criado em diversos países para a luta contra a lavagem de dinheiro).

Capítulo 2. Execução e Responsabilidades

O COAF tem a finalidade de disciplinar, aplicar penas administrativas, receber examinar e identificar ocorrências suspeitas de atividades ilícitas relacionadas à Lavagem de Dinheiro.

Dentro da estrutura organizacional da Gestora, as diferentes áreas da Gestora possuem as seguintes responsabilidades no que tange ao programa de PLD/FTP:

Alta Administração: Para fins desta Política, considera-se “Alta Administração” o Comitê Executivo, cuja composição e atribuições gerais se encontram se descritas no Manual de Compliance da Gestora.

Para além das atribuições gerais previstas no Manual de Compliance da Gestora, compete ao Comitê Executivo:

- (i) definir anualmente as diretrizes e regras gerais consolidadas na presente política e na ABR (conforme definido abaixo), que nortearão os procedimentos e controles internos de PLD/FTP a serem adotados pela Gestora no exercício social corrente;
- (ii) avaliar, anualmente, a partir do Relatório de *Compliance*, Riscos e PLD/FTP elaborado pela Área de Compliance, a efetividade dos procedimentos e controles internos e de PLD/FTP adotados pela Gestora, a fim de definir eventuais ajustes de diretrizes, regras e procedimentos que se façam necessários.

Área de Compliance: Tem sua estrutura organizacional descrita no Manual de Compliance da Gestora. Para além das atribuições gerais previstas no Manual de Compliance, compete à Área de Compliance:

- (i) supervisionar a execução das diretrizes e regras gerais de ABR e monitoramento de operações ativas dos fundos geridos pela Gestora pelas demais áreas da instituição;
- (ii) executar os mecanismos de diligência de PLD/FTP em eventuais parceiros na atividade de distribuição de cotas de emissão dos Fundos ou na aquisição de cotas de emissão de fundos investidos pelos Fundos;
- (iii) adotar medidas de controle, de acordo com procedimentos prévia e expressamente estabelecidos, que procurem confirmar as informações cadastrais das contrapartes, verificando se possuem mecanismos mínimos para análise para fins de PLD/FTP de forma a evitar o uso da conta por terceiros e identificar beneficiários finais das operações, conforme a natureza da operação e a possibilidade desta identificação;

- (iv) reunir informações reportadas pelas demais áreas da Gestora e pela atividade de monitoramento de transações de clientes, bem como elaborar análise sobre decisões de reporte ou não reporte de situações suspeitas ao COAF;
- (v) realizar procedimentos de monitoramento de Colaboradores, conforme regras e procedimentos internos definidos pela Alta Administração;
- (vi) zelar pelo cumprimento da lei e de todas as normas e regulamentos (internos ou externos) que pautam a atividade da Gestora no que tange às atividades de PLD/FTP;
- (vii) assegurar a adequação das normas e regulamentos internos às alterações da legislação aplicável em vigor;
- (viii) apoiar e promover atividades e treinamentos dos Colaboradores quanto ao cumprimento da lei e de todas as normas e regulamentos (internos ou externos) que pautam a atividade de PLD/FTP da Gestora; e
- (ix) elaborar anualmente o Relatório de *Compliance*, Riscos e PLD/FTP e apresentá-lo à Alta Administração, em conjunto com os indicadores de efetividade do programa de PLD/FTP realizado no ano anterior; e
- (x) supervisionar de maneira mais rigorosa a relação de negócios mantida com pessoas expostas politicamente;

Área de Gestão: Significa a área da Gestora responsável pela atividade de gestão discricionária de carteiras de valores mobiliários. Compete à Área de Gestão:

- (i) monitorar os indícios de LDFTP nas suas atividades diárias de gestão discricionária de recursos de terceiros, devendo implementar os procedimentos específicos para os investimentos realizados pelos Fundos (prevenção à Lavagem de Dinheiro do ativo), a fim de verificar indícios em contrapartes ou ativos negociados pelos respectivos fundos de investimento;
- (ii) monitorar os indícios de LDFTP nas suas atividades diárias de relacionamento comercial com prestadores de serviço ou terceiros com os quais a Gestora mantenha relacionamento, a fim de verificar indícios de LDFTP;
- (iii) reportar sinais de alerta de LDFTP em suas rotinas diárias à Área de Compliance para início de eventuais análises aprofundadas e reunir outros sinais de alerta para fundamentar eventual decisão de comunicação ou não ao COAF.

Dentre os aspectos organizacionais e de segregação de funções fundamentais para o cumprimento desta Política, destaca-se:

- (i) total independência da Área de Compliance em relação à área de Gestão e demais áreas de negócios da Gestora;
- (ii) autonomia da Área de Compliance para conduzir os procedimentos necessários à implementação do programa de PLD/FTP; e
- (iii) adoção de controles internos definindo as exigências, atribuições e responsabilidades das áreas envolvidas.

As atribuições relacionadas à área de Gestão da Gestora são exercidas de forma segregada em relação às demais atividades da Gestora ou de empresas ligadas que possam gerar conflitos de interesse, nos termos dispostos na “Política de Segregação de Atividades” da Gestora, a qual se encontra formalizada em instrumento próprio e apartado deste Manual.

Capítulo 3. Procedimentos de Know your Client – KYC e Know your Employee – KYE

Tendo em vista a atividade desempenhada pela Gestora, o procedimento de “Conheça seu Cliente” (ou “*Know Your Client – “KYC”*”) é majoritariamente de responsabilidade do administrador ou distribuidor contratado dos Fundos. Contudo, periodicamente, a Área de Compliance realiza procedimentos de *due diligence* junto aos administradores e distribuidores desses Fundos, conforme questionário de diligência anexo (**Anexo I**).

Ademais, nos casos em que a Gestora tiver acesso às informações cadastrais de cotistas, poderá realizar procedimentos próprios de *KYC*, com o objetivo de viabilizar a correta identificação de seus clientes e buscando identificar quaisquer indícios de atividades ilícitas relacionadas à Lavagem de Dinheiro.

Quando do processo de contratação de novos Colaboradores por qualquer área da Gestora, a Área de Compliance deverá:

- (i) realizar processo de “Conheça seu Colaborador” (ou “*Know Your Employee – “KYE”*”) por meio de ferramenta de *background check* utilizada pela Gestora;
- (ii) verificar se o novo Colaborador foi aprovado em exame de certificação cuja metodologia e conteúdo tenham sido previamente aprovados pela CVM, se a função pleiteada assim exigir;
- (iii) a depender do cargo pleiteado, confirmar que o novo Colaborador: (a) não foi inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições

financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pela CVM, pelo Banco Central do Brasil (“BACEN”), pela Superintendência Nacional de Previdência Complementar (PREVIC) ou pela Superintendência de Seguros Privados (SUSEP); (b) não foi condenado por crime falimentar, prevaricação, suborno, concussão, peculato, “lavagem” de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores, contra a economia popular, a ordem econômica, as relações de consumo, a fé pública ou a propriedade pública, o Sistema Financeiro Nacional ou a pena criminal que vede, ainda que temporariamente, o acesso a cargos públicos, por decisão transitada em julgado, ressalvada a hipótese de reabilitação; (c) não está impedido de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial ou administrativa; (d) não está incluído no cadastro de serviços de proteção ao crédito; (e) não está incluído em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado; e (f) não tem contra si títulos levados a protesto.

Caso o procedimento de *background check* de Colaboradores aponte qualquer nova informação negativa sobre determinado Colaborador, que coloque em risco a sua reputação ou possa afetar a imagem da Gestora, a Área de Compliance entrará em contato com a pessoa responsável pela gestão do Colaborador para avaliar a manutenção do relacionamento com o Colaborador ou outras medidas de supervisão e monitoramento que entender aplicáveis.

Sem prejuízo do procedimento de *background check*, é obrigação dos sócios, diretores estatutários e gestores da Gestora, autorizados a desempenhar a atividade de administração de recursos de terceiros pela CVM, prontamente comunicar à Área de Compliance, por e-mail, acerca de processos judiciais ou administrativos instaurados contra si, bem como de questões midiáticas negativas que as envolva e que potencialmente afetem o seu atendimento aos requisitos indicados neste item 7.3.

Capítulo 4. Investidores de Alto Risco

Apesar de, em regra, não realizar procedimento próprio de *KYC* e, portanto, não classificar os cotistas dos Fundos por graus de risco, nos casos em que a Gestora tiver tido acesso às informações cadastrais dos cotistas e identificar aquela pessoa como de alto risco, a Área de Compliance deverá ser consultada previamente e realizar suas próprias verificações adicionais, conforme os procedimentos mínimos previstos no **Anexo II** deste Manual. Neste sentido, a Área de Compliance dispensará especial atenção aos “Investidores de Alto Risco”, assim considerados:

- (i) Investidores não residentes, em especial aqueles constituídos sob a forma de *trusts* e sociedades com títulos ao portador;
- (ii) Investidores residentes, constituídos, sediados ou, ainda, que utilizem em sua relação com os Fundos contas bancárias mantidas em países que não aplicam

ou aplicam insuficientemente as recomendações do Grupo de Ação Financeira contra Lavagem de Dinheiro e o Financiamento do Terrorismo (“GAFI”);

(iii) Pessoas consideradas expostas politicamente, nos termos da regulação em vigor; e

(iv) Organizações sem fins lucrativos.

Capítulo 5. Possibilidade de Veto em Razão do Risco

Caso quaisquer das informações fornecidas pelos investidores e fornecidas à Gestora, por qualquer razão, estejam incompletas ou inconsistentes em relação à documentação apresentada e às demais informações obtidas publicamente pela Gestora, a Área de Compliance deverá descrever as inconsistências identificadas e sugerir medidas a serem adotadas para o seu saneamento.

Se for o caso, o administrador dos Fundos deverá ser notificado a respeito de tais inconsistências para que estas possam ser sanadas pelo investidor. Caso tais inconsistências não possam ser sanadas ou se verifique restrição ou preocupação quanto a crimes financeiros, o investidor em questão poderá ser rejeitado, devendo ser realizada, ainda, uma comunicação imediata ao administrador do Fundo. Se o processo *KYC* for interrompido nessas circunstâncias, a Área de Compliance deverá ser necessariamente informada a respeito da ocorrência e será responsável por avaliar se há necessidade de reporte de atividade suspeita aos órgãos reguladores, nos termos do item 7.9 abaixo.

Nesse mesmo sentido, os Colaboradores não poderão aceitar transações ou realizar qualquer tipo de negócio ou atividade com investidores que não consigam atestar a origem dos recursos que pretendem entregar à administração da Gestora.

Capítulo 6. Investimentos Realizados pelos Fundos de Investimento – Ativos

Verificação de contrapartes:

Nas operações ativas (investimentos) realizadas pelos fundos de investimento, o cliente deve ser entendido como a contraparte da operação, sempre que possível sua identificação, e a Gestora será responsável pelo seu cadastro nos sistemas internos, bem como pelo seu monitoramento, observado o disposto na legislação e regulação vigentes e neste Manual.

Nos casos em que for possível a identificação da contraparte da operação, a área de Gestão deve realizar *background check* da pessoa física ou jurídica que negociar com o Fundo, seus sócios e administradores, por meio de procedimento a ser conduzido pelas áreas jurídica e de *Compliance*, Riscos e PLD/FTP.

No entanto, tendo em vista que o objetivo da Gestora não contempla a realização de gestão ativa dos Fundos, mas apenas acompanhamento das carteiras teóricas dos índices objeto de cada política de investimento, que são compostas substancialmente por ativos e valores mobiliários admitidos à negociação em bolsas de valores, de mercadorias e futuros ou registrados em sistema de registro, custódia ou de liquidação financeira, o processo de identificação de contrapartes será realizado de forma simplificada ou dispensado, tendo em vista que tais ativos, em função de sua contraparte e do mercado nos quais são negociados, já passaram por processo de verificação..

Tais ativos e valores mobiliários estão discriminados na lista a seguir:

- (i) ativos e valores mobiliários objeto de ofertas públicas iniciais e secundárias registradas de acordo com as normas emitidas pela CVM;
- (ii) ativos e valores mobiliários objeto de ofertas públicas com esforços restritos, dispensadas de registro de acordo com as normas emitidas pela CVM;
- (iii) ativos e valores mobiliários admitidos à negociação em bolsas de valores, de mercadorias e futuros, ou registrados em sistema de registro, custódia ou de liquidação financeira, devidamente autorizados em seus países de origem e supervisionados por autoridade local reconhecida;
- (iv) ativos e valores mobiliários cuja contraparte seja instituição financeira ou equiparada; e
- (v) ativos e valores mobiliários de mesma natureza econômica daqueles acima listados, quando negociados no exterior, desde que (a) sejam admitidos à negociação em bolsas de valores, de mercadorias e futuros, ou registrados em sistema de registro, custódia ou de liquidação financeira, devidamente autorizados em seus países de origem e supervisionados por autoridade local reconhecida pela CVM, ou (b) cuja existência tenha sido assegurada por terceiros devidamente autorizados para o exercício da atividade de custódia em países signatários do Tratado de Assunção ou em outras jurisdições, ou supervisionados por autoridade local reconhecida pela CVM.

Como exceção ao acima disposto, a Gestora dispensará especial atenção às operações suspeitas e passíveis de serem reportadas ao COAF nos casos de negociações realizadas em bolsa de valores em que seja possível, considerando circunstâncias próprias da negociação, determinar a contraparte dos negócios, como, por exemplo, quando da negociação de ativos de liquidez muito baixa ou quando se tratar de uma operação entre os Fundos geridos pela Gestora.

Capítulo 7. Operações Diretas

As operações “diretas” realizadas pelos Fundos deverão seguir as Políticas de Decisão de Investimentos e Alocação de Ativos e de Rateio e Divisão de Ordens, cujo propósito principal é uniformizar as carteiras dos Fundos, tendo como base a totalidade dos ativos sob gestão da Gestora. Qualquer operação “direta” efetuada pela Gestora que fuja deste propósito, seja entre os fundos, seja terceiros como contraparte final, constitui exceção e deverá ser aprovada por um Diretor da área de Gestão. A Área de Compliance deverá monitorar continuamente os procedimentos de exceções e todas as operações diretas.

Capítulo 8. Reespecificação

A solicitação de reespecificação de operação já especificada em nome de um Fundo para outro Fundo deverá ocorrer apenas em caráter excepcional, por motivos de erro operacional, falha humana ou tecnológica, sempre respeitando as alçadas internas de aprovação e contando com a aprovação da Área de Compliance, além da aprovação de um Diretor da área de Gestão.

Capítulo 9. Monitoramento de Situações Atípicas

Por meio dos mecanismos de controles estabelecidos acima, será realizado o monitoramento das operações e situações previstas no art. 20 da Resolução CVM 50, em especial de operações realizadas com finalidade de gerar perda ou ganho, para as quais falte, objetivamente, fundamento econômico.

Obrigações da equipe de Gestão. Na execução de operações em nome dos fundos, a equipe de Gestão deverá, além de dispensar esforços para identificação da contraparte, nos termos do item 7.4 acima, dispensar especial atenção e exercer todos os esforços para se certificar de que a operação:

- i. é legítima e ocorre de acordo com as características normais de mercado, especialmente no que se refere às partes envolvidas, forma de realização ou instrumentos utilizados; e
- ii. tem fundamento econômico determinável e não obscuro.

Qualquer operação que fuja aos preceitos acima não deverá ser realizada e a ocorrência deve ser imediatamente comunicada à Área de Compliance.

Capítulo 10. Monitoramento de Preços

A Gestora adotará procedimentos com vistas a controlar e monitorar a faixa de preços dos ativos e valores mobiliários negociados para os Fundos, de modo que eventuais operações efetuadas fora dos padrões praticados no mercado, de acordo com as características do negócio, sejam identificadas e, se for o caso, comunicadas aos órgãos competentes.

Capítulo 11. Comunicação ao COAF

As situações listadas abaixo podem configurar indícios da ocorrência dos crimes previstos na Lei nº 9.613/1998 ou podem com eles se relacionar, devendo ser analisadas com especial atenção e, se e quando consideradas suspeitas pela instituição, nos termos do art. 6º e 7º da Resolução CVM 50, comunicadas ao COAF:

- (i) operações realizadas entre as mesmas partes ou em benefício das mesmas partes, nas quais haja seguidos ganhos ou perdas no que se refere a algum dos envolvidos;
- (ii) que evidenciem oscilação significativa em relação ao volume ou frequência de negócios de qualquer das partes envolvidas;
- (iii) cujos desdobramentos contemplem características que possam constituir artifício para burla da identificação dos efetivos envolvidos e beneficiários respectivos;
- (iv) cujas características e desdobramentos evidenciem atuação, de forma contumaz, em nome de terceiros;
- (v) que evidenciem mudança repentina e objetivamente injustificada relativamente às modalidades operacionais usualmente utilizadas pelos envolvidos;
- (vi) cujo grau de complexidade e risco se afigurem incompatíveis com: (a) o perfil do cliente ou de seu representante, nos termos da regulamentação específica que dispõe sobre o dever de verificação da adequação dos produtos, serviços e operações ao perfil do cliente (*suitability*), e (b) com o porte e o objeto social do cliente;
- (vii) realizadas com a aparente finalidade de gerar perda ou ganho para as quais falte, objetivamente, fundamento econômico ou legal;
- (viii) transferências privadas de recursos e de valores mobiliários sem motivação aparente, tais como: (a) entre contas-correntes de investidores perante o intermediário, (b) de titularidade de valores mobiliários sem movimentação financeira; e (c) de valores mobiliários fora do ambiente de mercado organizado;
- (ix) depósitos ou transferências realizadas por terceiros para a liquidação de operações de cliente ou para prestação de garantia em operações nos mercados de liquidação futura;

- (x) pagamentos a terceiros, sob qualquer forma, por conta de liquidação de operações ou resgates de valores depositados em garantia, registrados em nome do cliente;
- (xi) operações realizadas fora de preço de mercado;
- (xii) ativos alcançados por sanções impostas pelas resoluções do Conselho de Segurança das Nações Unidas (“CSNU”) de que trata a Lei nº 13.810, de 8 de março de 2019 (“Lei nº 13.810/2019”);
- (xiii) ativos alcançados por requerimento de medida de indisponibilidade oriundo de autoridade central estrangeira de que se venha a ter conhecimento;
- (xiv) a realização de negócios, qualquer que seja o valor, por pessoas que tenham cometido ou intentado cometer atos terroristas, ou deles participado ou facilitado o seu cometimento, conforme o disposto na Lei nº 13.260/2016;
- (xv) valores mobiliários pertencentes ou controlados, direta ou indiretamente, por pessoas que tenham cometido ou intentado cometer atos terroristas, ou deles participado ou facilitado o seu cometimento, conforme o disposto na Lei nº 13.260/2016;
- (xvi) movimentação passível de ser associada ao financiamento do terrorismo, conforme o disposto na Lei nº 13.260/2016; e
- (xvii) operações com a participação de pessoas naturais, pessoas jurídicas ou outras entidades que residam, tenham sede ou sejam constituídas em países, jurisdições, dependências ou locais: a) que não aplicam ou aplicam insuficientemente as recomendações do GAFI, conforme listas emanadas por aquele organismo; e b) com tributação favorecida e submetidos a regimes fiscais privilegiados, conforme normas emanadas pela Receita Federal do Brasil.

Capítulo 12. Monitoramento da Área de Compliance

A implementação e a supervisão do cumprimento das normas contidas nesta Política serão de responsabilidade do Diretor responsável pela Área de Compliance, nos termos do art. 8º da Resolução CVM 50. A esse Diretor também incumbirá a responsabilidade pela recomendação das sanções aplicáveis ao descumprimento das normas previstas neste Capítulo.

Ao Diretor responsável caberá zelar para que a Gestora cumpra com as seguintes práticas:

- (i) adotar continuamente regras, procedimentos e controles internos, visando a confirmar as informações cadastrais de seus clientes, mantê-las atualizadas e monitorar as operações por eles realizadas, de forma a evitar o uso de conta por terceiros e identificar os beneficiários finais das operações;
- (ii) supervisionar de maneira mais rigorosa as relações de negócios mantidas com clientes que sejam Investidores de Alto Risco, mantendo procedimentos e controles internos adequados à identificação dessas pessoas e a origem dos recursos envolvidos nessas operações;
- (iii) manter registros de todas as transações envolvendo títulos e valores mobiliários realizadas pela Gestora, de forma a permitir a verificação da movimentação financeira de cada investidor;
- (iv) monitorar continuamente as operações que demonstrem um desvio no padrão de investimento dos clientes ou quaisquer outras operações que se enquadrem na descrição do art. 20 da Resolução CVM 50;
- (v) observar as demais obrigações que lhe forem impostas pela Resolução CVM 50 e suas alterações; e
- (vi) realizar, sempre que necessário, o informe de transações suspeitas junto ao COAF ou o reporte negativo anual, nos termos da legislação e regulação vigentes, caso seja aplicável.

Capítulo 13. Abordagem Baseada em Risco

A Gestora adota uma abordagem baseada em risco (“ABR”) com a finalidade de assegurar que as medidas de prevenção e mitigação de situações ou operações de LDFTP sejam proporcionais aos riscos identificados nas atividades desempenhadas pela Gestora.

Para tanto, a Alta Administração define, anualmente, a matriz e métricas para classificação de:

- (i) produtos oferecidos, analisando variáveis como a presença de contrapartes em listas restritivas de jurisdição, mídias negativas, nível de pulverização dos Fundos, dentre outros; e
- (ii) serviço de gestão, analisando variáveis de risco como ambientes de negociação e registro em que atua.

Os Fundos serão classificados considerando as réguas de pontuação aprovadas anualmente pela Alta Administração da Gestora.

A Área de Compliance poderá, a qualquer tempo, mediante decisão fundamentada e registrada por escrito, modificar a faixa de risco de qualquer dos produtos avaliados segundo os critérios aprovados pela Alta Administração ou em razão do conhecimento de novos fatos que substancialmente modifiquem o nível de risco de LDFTP daquele Fundo.

A Área de Compliance pode sugerir à Alta Administração, no Relatório de Compliance, Riscos e PLD/FTP do ano seguinte, eventuais mudanças ou inclusões de critérios para melhor calibragem da classificação dos produtos.

As faixas de ABR (baixo, médio e alto risco) têm como objetivo a adoção das seguintes medidas diferenciadas de monitoramento e prevenção de riscos de LDFTP:

Risco baixo: atualização da classificação realizada a cada 36 (trinta e seis) meses;

Risco médio: atualização da classificação realizada a cada 24 (vinte e quatro) meses;

Risco alto: atualização da classificação realizada a cada 12 (doze) meses;

Capítulo 14. ABR de Serviço de Gestão

Anualmente, a Área de Compliance determinará o nível de risco do serviço de Gestão desempenhado pela Gestora e deverá fazer constar tal informação do seu Relatório de *Compliance*, Riscos e PLD/FTP a ser apresentado à Alta Administração.

A métrica da ABR do Serviço de Gestão considerará o cruzamento anual entre os Fundos (classificados entre baixo, médio e alto Risco) e o percentual que aquele tipo de gestão representa sobre o total de *Assets Under Management (AuM)* da Gestora.

O cálculo do nível de risco indicado acima servirá para que a Alta Administração possa determinar medidas de reforço ou flexibilização ao programa de prevenção e combate à LDFTP nos anos em que a atividade de Gestão demonstrar níveis de exposição ao risco de LDFTP maiores ou menores em relação ao exercício dos anos anteriores.

Tais medidas poderão envolver, por exemplo, monitoramento mais rigoroso de transações e aquisições pelos Fundos, aprovação de novas contratações de Colaboradores para a área de *Compliance*, Riscos e e PLD/FTP ou aquisição de sistemas que auxiliem na atividade de monitoramento e prevenção a LDFTP, entre outras que a Alta Administração entenda convenientes e oportunas diante das circunstâncias verificadas em cada caso.

Todavia, considerando que a Gestora: (i) desenvolve, exclusivamente, atividades de gestão de Fundos, conforme descrito em seu formulário de referência; (ii) as atividades da Gestora são altamente reguladas e supervisionadas pelas CVM e pela ANBIMA; (iii) o objeto da Gestora é replicar um índice financeiro alvo, mediante a compra e venda das mesmas ações ou ativos que compõem o índice alvo, imediatamente após a

inclusão ou exclusão parcial ou total desse ativo na cesta teórica que compõe o índice; (iv) as cotas de emissão dos Fundos são negociadas na bolsa de valores e esses Fundos contam com administradores fiduciários e distribuidores devidamente registrados e supervisionados pela CVM, pela ANBIMA e pelo BACEN; e (v) os recursos colocados à disposição da Gestora já passaram pelo crivo de PLD/FTP de uma instituição financeira e são admitidos à negociação em bolsas de valores, de mercadorias e futuros, ou registrados em sistema de registro, custódia ou de liquidação financeira, a Gestora classifica, neste momento, como baixo o risco de LDFTP associado aos produtos, serviços, canais de distribuição, ambientes de negociação e principais prestadores de serviços.

Capítulo 15. Treinamento dos Colaboradores

A Área de Compliance mantém programa de treinamento anual de seus próprios Colaboradores e dos Colaboradores integrantes de outras áreas da Gestora envolvidas na prevenção de LDFTP, a fim de capacitá-los quanto ao reconhecimento e ao combate a LDFTP na prestação dos serviços da Gestora aos seus clientes (“Programa de Treinamento”). Trimestralmente, a Área de Compliance deverá realizar treinamento para novos Colaboradores.

Se, após o treinamento, ainda persistirem dúvidas, o Colaborador deverá entrar em contato com a Área de Compliance, que poderá esclarecê-las, indicando o modo de agir em cada situação.

Capítulo 16. Retenção, Conservação e Acesso de Arquivos

Todas as informações e documentos relacionados aos procedimentos de prevenção e combate a LDFTP descritos nesta Política e neste Manual devem ser mantidos e conservados, por meio físico ou eletrônico, por, no mínimo, 5 (cinco) anos.

Em se tratando de documentos e informações relacionadas ao processo de *background check*, monitoramento de transações, análises de reporte ou não reporte de operações suspeitas ao COAF e cumprimento de sanções impostas por resoluções do CSNU, o prazo de 5 (cinco) anos referido acima é contado a partir do cadastro ou da última atualização cadastral ou da detecção da situação atípica, podendo esse prazo ser sucessivamente estendido por determinação da CVM.

A Área de Compliance deve assegurar, por meio de métodos necessários e prudentes, que a Gestora previna danificação, falsificação, destruição ou alteração indevida dos livros e registros, devendo os Colaboradores cooperar, dentro de suas respectivas funções, para o seu cumprimento.

Respeitados os dispositivos constantes nas demais normas internas de segurança da informação da Gestora, a Área de Compliance poderá solicitar acesso a quaisquer informações e documentos dos Colaboradores ou de qualquer diretório da Gestora para fins do cumprimento das disposições do presente Manual.

Capítulo 17. Cumprimento de Sanções Impostas por Resoluções do CSNU

Considerando o escopo de atuação da Gestora – concentrado exclusivamente na atividade de gestão profissional de recursos de terceiros –, sua capacidade de praticar os atos necessários à implementação das medidas estabelecidas nas resoluções sancionatórias do CSNU ou as designações de seus comitês de sanções que determinem a indisponibilidade de ativos e/ou de quaisquer valores de titularidade, direta ou indireta, de pessoas naturais, de pessoas jurídicas ou de entidades, nos termos da Lei nº 13.810/2019, é limitada, cabendo a outros prestadores de serviço dos Fundos, como administradores fiduciários e custodiantes, implementar as medidas de indisponibilidade determinadas pelo CSNU.

Entretanto, considerando o monitoramento constante dos Fundos e contrapartes dos Fundos, em caso de identificação da inclusão de um cliente ou contraparte da Gestora nas resoluções sancionatórias do CSNU ou nas designações de seus comitês de sanções, a Gestora realizará comunicações imediatas:

- (i) ao administrador fiduciário e/ou ao custodiante do Fundo em questão, conforme aplicável, para implementação das medidas necessárias à execução do regime de indisponibilidade;
- (ii) à CVM;
- (iii) ao Ministério da Justiça e Segurança Pública; e
- (iv) ao COAF.

Capítulo 18. Aspectos do Relatório de *Compliance*, Riscos e PLD/FTP

O Relatório de *Compliance*, Riscos e PLD/FTP deverá conter, no mínimo, as seguintes informações relacionadas a PLD/FTP:

- (i) lista de todos os produtos oferecidos, serviços prestados e ambientes de negociação e registro em que a Gestora tenha atuado, com apresentação das classificações de ABR atualizadas utilizadas no ano civil anterior;
- (ii) identificação e análise das situações de risco de LDFTP identificadas no ano civil anterior, considerando as respectivas ameaças, vulnerabilidades e consequências;
- (iii) análise da atuação dos parceiros comerciais contratados para os Fundos;

- (iv) tabela relativa ao ano civil anterior, contendo: (a) o número consolidado das operações e situações atípicas detectadas, segregadas por cada hipótese; (b) o número de análises de eventual comunicação realizadas; (c) o número de comunicações de operações suspeitas reportadas para o COAF; ou (d) a data do reporte da declaração negativa de reporte, se for o caso;
- (v) medidas adotadas no procedimento de *KYC*, *KYE* e diligência sobre os administradores e distribuidores dos Fundos;
- (vi) a apresentação dos indicadores de efetividade do programa de PLD/FTP da Gestora, incluindo: (a) percentual de origem de detecção de situações ou operações atípicas, inclusive com discriminação entre as situações e operações detectadas nos procedimentos internos da Gestora e aquelas detectadas por meio de informações reportadas por terceiros; (b) a tempestividade das atividades de detecção, análise e comunicação de operações ou situações atípicas; e (c) percentual de produtos com situações atípicas identificadas que estivessem classificados como de baixo risco;
- (vii) a apresentação, se for o caso, de recomendações visando a mitigar os riscos identificados no ano civil anterior e que ainda não foram devidamente tratados, contendo: (a) possíveis alterações nas diretrizes previstas nesta Política; e (b) aprimoramento de demais políticas e manuais internos da Gestora, conforme aplicável, com o estabelecimento de cronogramas de saneamento; e
- (viii) a indicação da efetividade das recomendações adotadas referidas no inciso (vii) acima em relação ao Relatório de *Compliance*, Riscos e PLD/FTP respectivamente anterior, registrando de forma individualizada os resultados.

O Relatório de *Compliance*, Riscos e PLD/FTP deverá ficar disponível à consulta pela CVM na sede da Gestora, bem como no *website* da Gestora.

Capítulo 19. Atualizações e Análises de Novas Tecnologias

A presente Política será revisada pela Alta Administração, no mínimo, anualmente ou sempre que se fizer necessário, considerando os princípios e diretrizes aqui indicados, bem como a legislação aplicável.

Durante a revisão desta Política, a Área de Compliance deverá analisar a conveniência, oportunidade e oferta de novas tecnologias, serviços e produtos no mercado, visando ao constante aprimoramento dos procedimentos e controles internos de PLD/FTP.

ANEXO I

QUESTIONÁRIO DE *DUE DILIGENCE*

[NOME DO ADMINISTRADOR / DISTRIBUIDOR / CORRETORA]

Em nome da Oryx Capital Ltda. (“Gestora”), encaminho este documento com o fim de cadastrar as informações acerca dos controles internos de prevenção à lavagem de dinheiro e de combate ao financiamento ao terrorismo adotados pela Instituição.

Contamos com a colaboração de V.Sas. e solicitamos que as informações sejam verdadeiras, confiáveis e íntegras.

A Gestora assegura que todas as informações aqui prestadas serão mantidas internamente e não serão disponibilizadas externamente, salvo se solicitado por autoridades públicas competentes ou exigido por meio de medidas judiciais aplicáveis.

Periodicamente e a seu exclusivo critério, a Gestora poderá solicitar a revisão deste questionário e o seu preenchimento atualizado por parte de V. Sas.

Ao final do questionário, solicitamos, por gentileza, que seja expressamente indicado o responsável pelo preenchimento. Se houver mais do que um subscritor, todos devem ser expressamente identificados.

Atenciosamente,

Oryx Capital Ltda.

1. Informações Cadastrais

1.1. - Razão Social:

1.2. - CNPJ/ME:

1.3. - Endereço:

1.4. - Principais contatos:

E-mails:

Telefones:

Celulares:

1.5. – Registros em órgãos reguladores, autorreguladores e associações de classe:

1.6. – Pertence a algum grupo financeiro? Qual(is)?

2. Informações sobre os controles da Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento ao Terrorismo

2.1. A Instituição possui Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento ao Terrorismo?

() Sim. Favor anexar.

() Não.

2.2. A Instituição possui procedimento de identificação e registro dos investidores (“Conheça seu Cliente” ou “*know your client*”)?

() Sim. Favor anexar.

() Não.

2.3. Os controles e procedimentos de prevenção à lavagem de dinheiro são submetidos a auditoria externa? Qual a periodicidade?

() Sim. Periodicidade? _____

() Não.

2.4. A Instituição está submetida a quais normas de prevenção à lavagem de dinheiro (legais, regulatórias e autorregulatórias)?

2.5. A Instituição, seus sócios, diretores, empregados ou qualquer outro colaborador possuem algum relacionamento com pessoas consideradas politicamente expostas*?

() Sim. Detalhar:

() Não.

*** Consideram-se pessoas politicamente expostas os agentes públicos que desempenham ou tenham desempenhado, nos últimos 5 (cinco) anos, no Brasil ou em países, territórios e dependências estrangeiros, cargos, empregos ou funções públicas relevantes, assim como seus representantes, familiares e outras pessoas de seu relacionamento próximo.**

2.6. A Instituição, sócios ou diretores já foram acusados na esfera administrativa ou criminal ou condenados pela prática de crimes (i) de lavagem de dinheiro, (ii) contra o patrimônio, (iii) contra o Sistema Financeiro Nacional e/ou (iv) por qualquer outro crime previsto em lei?

2.7. Favor informar o nome do Diretor responsável pela Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento ao Terrorismo.

Data:

Nome:

Assinatura do responsável:

ANEXO II
PROCEDIMENTOS MÍNIMOS DE DILIGÊNCIA PARA FINS DE
KNOW YOUR CLIENT

Para auxiliar no processo de consulta de históricos de imprensa com informações relevantes, normativos e quaisquer recomendações sobre prevenção à Lavagem de Dinheiro, segue abaixo lista não exaustiva dos principais sites a serem consultados:

- ☐ ANBIMA - www.anbima.com.br
- ☐ Banco Central do Brasil – BACEN – www.bcb.gov.br
- ☐ B3 – <http://www.b3.com.br/>
- ☐ CVM – www.cvm.org.br
- ☐ Presidência da República – www.presidencia.gov.br
- ☐ COAF – www.coaf.fazenda.gov.br/ www.fazenda.gov.br
- ☐ Estratégia Nacional de Combate à Corrupção e à Lavagem de Dinheiro (ENCCLA) – <http://enccla.camara.leg.br/>
- ☐ GAFI – www.fatf-gafi.org
- ☐ UK Gov – www.direct.gov.uk
- ☐ OCC – www.occ.treasury.gov
- ☐ Press Complaints Commission – PCC – www.pcc.org.uk
- ☐ The Financial Conduct Authority (FCA UK) – www.fca.org.uk
- ☐ Prudential Regulation Authority – www.bankofengland.co.uk
- ☐ Justiça Federal – www.cjf.jus.br
- ☐ OFAC – www.treas.gov

A Área de Compliance da Gestora poderá consultar, ainda, bases de dados cadastrais privadas, tais como SERASA, SPC e sistemas como *World Check*, se entender necessário ou conveniente.