



FORMULÁRIO DE REFERÊNCIA
ATALAYA GESTÃO DE RECURSOS LTDA.
37.537.640/0001-45

Data: 31/12/2021

ANEXO 15-II

Conteúdo do Formulário de Referência – Pessoa Jurídica

(informações prestadas com base nas posições de 31 de dezembro de 2021)

1. Identificação das pessoas responsáveis pelo conteúdo do formulário:

1.1. O Diretor responsável pela Administração da Carteira de Valores Mobiliários, LUCIANO DE PABLO PARDO BRANDÃO, e o Diretor Responsável pela implementação e cumprimento de regras, procedimentos e controles internos, Sr. PEDRO RODRIGUES GALVÃO DE MEDEIROS, declaram, por meio desta, que:

a) reviram o formulário de referência objeto do Anexo 15-II à Instrução CVM nº 558; e

b) o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela Sociedade.

Rio de Janeiro, 31 de Dezembro de 2021.

LUCIANO DE PABLO PARDO BRANDÃO

PEDRO RODRIGUES GALVÃO DE MEDEIROS

2. Histórico da Empresa:

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa:

A Atalaya Gestão de Recursos Ltda. (“Atalaya Capital”) foi constituída em junho de 2020 com objetivo de prestar os serviços de gestão profissional de recursos de terceiros independente e em conformidade com os normativos legais. O foco é exclusivo para uma única estratégica, visando o retorno de capital absoluto de longo prazo através da alocação primordial no mercado de renda variável. A equipe possui vasta experiência na gestão de carteiras de valores mobiliários e análise de ações, baseando-se principalmente nas metodologias de análise de empresas fundamentalista e quantitativa.

2.2. Descrever as mudanças relevantes pelas quais tenha passado a empresa nos últimos 5 (cinco) anos, incluindo:

a) os principais eventos societários, tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário:

Entrada na sociedade com 27.000 (vinte e sete mil) cotas do sr. Pedro Rodrigues Galvão De Medeiros

b) escopo das atividades:

Não houve mudança do escopo das atividades desde a constituição da Sociedade.

c) recursos humanos e computacionais:

Recursos Humanos:

O departamento de gestão é formado por cinco profissionais sendo um gestor, três analistas microeconômicos e um analista quantitativo.

O departamento de Risco, Compliance e PLD é formado por 2 (dois) integrantes sendo o Diretor de Risco, Compliance e PLD e um analista.

Recursos Computacionais:

A Sociedade conta com a seguinte infraestrutura:

- Backup diário em Cloud com OneDrive para armazenamento seguro em nuvem, sistema Microsoft Business Professional;
- Sistema de controle de acesso de pessoas autorizadas às dependências do escritório por senha e/ou biometria com acessos auditado;
- 2 (duas) impressoras multitarefa;
- Laptops para uso exclusivamente corporativo com processador Intel Core i7 8ª Geração com 16 GB RAM;
- 2 televisões de alta definição (Smart TV) e equipamentos de vídeo-conferência;
- Sistema de Firewall com sistema de detecção de intrusos e bloqueio automático com acesso;
- Sistema de correio eletrônico com AntiSpam e recursos de regras para controle de envio de e-mails;
- No-break para prevenção de surtos elétricos e estabilização elétrica dos equipamentos sensíveis da empresa, como os ativos de TI e mesa de operação;
- Sistema de Proxy com regras de conteúdo de acesso às páginas da internet.

d) regras, políticas, procedimentos e controles internos:

A Sociedade conta com os seguintes manuais e políticas internas:

- Código de Ética e Conduta;
- Manual de Compliance;
- Política de Gestão de Riscos;
- Manual de Gerenciamento de Risco de Liquidez;
- Política de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Financiamento ao Terrorismo;
- Política de Investimentos Pessoais;
- Política de Segurança da Informação e Segurança Cibernética;
- Plano de Continuidade de Negócios;
- Política de Seleção, Contratação e Monitoramento de Prestadores de Serviço;
- Política de Rateio e Divisão de Ordens.

3. Recursos Humanos:**3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:****a) número de sócios:**

04 (quatro) sócios.

b) número de empregados:

1 (um) analistas.

c) número de terceirizados:

2 (dois) terceirizados (consultoria em análise de empresas e assistência técnica).

d) lista das pessoas naturais que são registradas na CVM como administradores de carteiras de valores mobiliários e atuam exclusivamente como prepostos, empregados ou sócios da empresa:

Luciano de Pablo Pardo Brandão (CPF: 080.737.997-23)

4. Auditores:**4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:****a) nome empresarial:**

Não há auditores independentes contratados.
b) data de contratação dos serviços:
Não há auditores independentes contratados.
c) descrição dos serviços contratados:
Não há auditores independentes contratados.
5. Resiliência Financeira:
5.1. Com base nas demonstrações financeiras, ateste:
a) se a receita em decorrência de taxas com bases fixas a que se refere o item 9.2.a é suficiente para cobrir os custos e os investimentos da empresa com a atividade de administração de carteira de valores mobiliários:
Sim.
b) se o patrimônio líquido da empresa representa mais do que 0,02% dos recursos financeiros sob administração de que trata o item 6.3.c e mais do que R\$ 300.000,00 (trezentos mil reais):
Sim.
5.2. Demonstrações financeiras e relatório de que trata o § 5º do art. 1º desta Instrução:
N/A, posto que a Sociedade atuará unicamente na categoria de gestora de recursos de terceiros.
6. Escopo das Atividades:
6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo:
a) tipos e características dos serviços prestados (gestão discricionária, planejamento patrimonial, controladoria, tesouraria, etc.)
Gestão Discricionária.
b) tipos e características dos produtos administrados ou geridos (fundos de investimento, fundos de investimento em participação, fundos de investimento imobiliário, fundos de investimento em direitos creditórios, fundos de índice, clubes de investimento, carteiras administradas, etc.):
Fundo master da classe multimercado (FIM) e fundos de investimento em cotas de fundo multimercado (FIC FIM). Os fundos de investimento sob gestão da Atalaya capital tem o objetivo de proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital, a longo prazo, através de uma carteira diversificada em valores mobiliários, observadas as limitações previstas em seus regulamentos e na regulamentação em vigor, sendo classificado como Multimercado pelo conceito da CVM.
c) tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão:
Ações, derivativos, futuro, títulos públicos e cotas de fundos.
d) se atua na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor:
Não.
6.2. Descrever resumidamente outras atividades desenvolvidas pela empresa que não sejam de administração de carteiras de valores mobiliários, destacando:
a) os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades:
A Sociedade se dedicará exclusivamente à atividade de gestão profissional de recursos de terceiros. Desta maneira, não há que se falar em conflitos de interesses com outras atividades.
b) informações sobre as atividades exercidas por sociedades controladoras, controladas, coligadas e sob controle comum ao administrador e os potenciais conflitos de interesses existentes entre tais atividades:

Não há grupo econômico.

6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundos¹ e carteiras administradas geridos pela empresa, fornecendo as seguintes informações:

a) número de investidores (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados):

57

b) número de investidores, dividido por:

i. pessoas naturais: 50

ii. pessoas jurídicas (não financeiras ou institucionais): 0

iii. instituições financeiras: 0

iv. entidades abertas de previdência complementar: 0

v. entidades fechadas de previdência complementar: 0

vi. regimes próprios de previdência social: 0

vii. seguradoras: 0

viii. sociedades de capitalização e de arrendamento mercantil: 0

ix. clubes de investimento: 0

x. fundos de investimento: 7

xi. investidores não residentes: 0

xii. outros (especificar) : 0

c) recursos financeiros sob administração (total e dividido entre fundos e carteiras destinados a investidores qualificados e não qualificados):

R\$ 44.140,000,65, fundo investidores em geral

d) recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior:

R\$ 8,828,320

e) recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes):

R\$16.250.000,00

R\$10.000.000,00

R\$6.000.000,00

¹ Se for o caso, fornecer informações apenas dos investidores dos fundos **feeders**, e não do fundo **master**.

R\$4.950.000,00
R\$2.500.000,00
R\$1.220.235,00
R\$825.000,00
R\$500.000,00
R\$485.235,00
R\$443.525,00
f) recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:
R\$ 44.140.000,65, fundo investidores em geral
6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:
i. Ações: R\$ 37.277.052,00
ii. debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeiras R\$0,00
iii. títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras R\$0,00
iv. cotas de fundos de investimento em ações R\$0,00
v. cotas de fundos de investimento em participações R\$0,00
vi. cotas de fundos de investimento imobiliário R\$0,00
vii. cotas de fundos de investimento em direitos creditórios R\$0,00
viii. cotas de fundos de investimento em renda fixa: R\$ 4.611.683,58
ix. derivativos (valor de mercado): R\$ -1.814.620,00
x. outros valores mobiliários: R\$0,00
xi. títulos públicos: R\$ 4.065.886,00
xii. outros ativos R\$0,00
6.5. Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária:
N/A, posto que não exerce atividades de administração fiduciária.
6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:
Não há mais informações que a Sociedade julgue importante.
7. Grupo Econômico:
7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:
a) controladores diretos e indiretos:

Controlador Direto: Luciano de Pablo Pardo Brandão (CPF: 080.737.997-23). Controladores Indiretos: Não há.
b) controladas e coligadas:
Coligada: Não há. Controlada: Não há.
c) participações da empresa em sociedades do grupo:
Não há.
d) participações de sociedades do grupo na empresa:
Não há.
e) sociedades sob controle comum:
Não há.
7.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma do grupo econômico em que se insere a empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 7.1.:
A Sociedade entende não há necessidade de inclusão de organograma.
8. Estrutura operacional e administrativa:
8.1. Descrever a estrutura administrativa da empresa, conforme estabelecido no seu contrato ou estatuto social e regimento interno, identificando:
a) atribuições de cada órgão, comitê e departamento técnico:
Diretoria Administrativa: i) representação da Sociedade em juízo e fora dele, ativa ou passivamente; (ii) a administração, orientação e direção dos negócios sociais; e (iii) a assinatura de quaisquer documentos que importem em responsabilidade ou obrigação da Sociedade.
Departamento de Risco, Compliance e PLD: adoção, avaliação e monitoramento dos controles internos e das normas relativas ao combate e prevenção à lavagem de dinheiro e financiamento ao terrorismo, assim como análise de eventuais descumprimentos identificados. Formalização da metodologia de monitoramento dos riscos das carteiras sob gestão da Sociedade, bem como dos riscos operacionais relacionados às suas atividades.
Departamento de Gestão: responsável pela tomada de decisão de investimento pelas carteiras sob gestão da Sociedade.
b) em relação aos comitês, sua composição, frequência com que são realizadas suas reuniões e a forma como são registradas suas decisões:
A Sociedade não conta com comitês internos formais, pois entende que não há necessidade em virtude de seu porte de atuação e complexidade dos produtos a serem geridos.
O processo de seleção de ativos e tomada de decisão de investimento é realizado discricionariamente pelo Diretor de Gestão, sendo a documentação pertinente arquivada na Sociedade de forma eletrônica. Já no que tange ao gerenciamento dos riscos atinentes as carteiras sob gestão, compete ao Diretor de Risco a tomada de decisão e condução da fiscalização dos parâmetros de riscos, o qual possui autonomia e independência para promover todas as ações necessárias para o enquadramento dos riscos da carteira aos limites conforme o caso.
c) em relação aos membros da diretoria, suas atribuições e poderes individuais:

LUCIANO DE PABLO PARDO BRANDÃO: responsabilidade pela atividade de gestão de carteiras de títulos e valores mobiliários, na qualidade de **Diretor de Gestão**.

PEDRO RODRIGUES GALVÃO DE MEDEIROS: responsabilidade pela atividade de gestão de risco, pelas atividades atinentes à adoção, manutenção e cumprimento dos controles internos e das normas de combate e prevenção à lavagem de dinheiro, na qualidade de **Diretor de Compliance, Risco e PLD**.

8.2. Caso a empresa deseje, inserir organograma da estrutura administrativa da empresa, desde que compatível com as informações apresentadas no item 8.1.:

A Sociedade entende não há necessidade de inclusão de organograma da estrutura administrativa.

8.3. Em relação a cada um dos diretores de que tratam os itens 8.4, 8.5, 8.6 e 8.7 e dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar, em forma de tabela:

Nome: LUCIANO DE PABLO PARDO BRANDÃO

Idade: 43 anos

Profissão: Engenheiro

CPF: 080.737.997-23

Cargo Ocupado: Diretor de Gestão

Data da Posse: 02/06/2020

Prazo do Mandato: indeterminado

Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: Não há.

Nome: PEDRO RODRIGUES GALVÃO DE MEDEIROS

Idade: 38 anos

Profissão: Engenheiro

CPF: 097.211.587-04

Cargo Ocupado: Diretor de Compliance, Risco e PLD

Data da Posse: 15/09/2021

Prazo do Mandato: indeterminado

Outros Cargos ou Funções Exercidos na Empresa: Não há.

8.4. Em relação aos diretores responsáveis pela administração de carteiras de valores mobiliários, fornecer:

(i) cursos concluídos:

Engenharia de Produção pela Universidade Federal do Rio de Janeiro (UFRJ);

MBA em Finanças pela Fundação Getúlio Vargas;

Formação de Profissionais em Mercados Derivativos pela BM&F Bovespa; e

Behavioral Economics (Finanças Comportamentais) pela London School Of Economics.

(ii) aprovação em exame de certificação profissional:

CFA, Investment Manager Certificate Level IV: Gestor de Investimentos certificado, CFA UK Society;

CGA ANBIMA – Certificação de Gestor ANBIMA;

Administrador de Carteiras habilitado pela CVM desde 20/08/2018.

(iii) principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:

O Sr. Luciano possui mais de 20 anos de experiência em análise e gestão com ênfase nos mercados acionário, futuros e derivativos, tendo atuado em renomadas instituições financeiras locais e internacionais, conforme descritivo abaixo informado.

Nome da Empresa:

Blueline Asset Management

Cargo e funções inerentes ao cargo:

Sócio fundador responsável pela área de ações.

Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:

Gestão de recursos de terceiros

Datas de entrada e saída do cargo:

De outubro/2018 a maio/2020.

Nome da Empresa:

BRX Investimentos Ltda.

Cargo e funções inerentes ao cargo:

Sócio responsável pela condução das atividades sociais.

Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:

Empresa de participações e consultoria de investimentos proprietários de seus sócios.

Datas de entrada e saída do cargo:

De dezembro/2015 a outubro/2018.

Nome da Empresa:

Banco BTG Pactual

Cargo e funções inerentes ao cargo:

Gestor Sênior de Investimentos.

Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:

Banco múltiplo, gestão de recursos de terceiros, administração fiduciária.

Datas de entrada e saída do cargo:

De abril/2015 a dezembro/2015

Nome da Empresa:

Banco Santander Brasil S.A.

Cargo de funções inerentes ao cargo:

Gestor sênior de investimento responsável pelo departamento de ações da tesouraria da instituição.

Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:

Banco múltiplo, gestão de recursos de terceiros, administração fiduciária.

Datas de Entrada e saída do cargo:

De outubro/2013 a abril/2015.

Nome da Empresa:

Nomura Asset Management UK

Cargo de funções inerentes ao cargo:

Diretor de Investimentos para o mercado acionário da América Latina da instituição, que é considerado o maior banco de investimento e distribuidora de fundos do Japão com aproximadamente U\$\$ 450 bilhões de patrimônio sob gestão.

Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:

Gestão de recursos.
Datas de Entrada e saída do cargo:
De setembro/2010 a setembro/2013.
Nome da Empresa:
JGP Gestão de Recursos Ltda.
Cargo de funções inerentes ao cargo:
Analista de empresas e gestor de investimentos para Brasil, EUA e mercados emergentes.
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Gestão de recursos.
Datas de Entrada e saída do cargo:
De outubro/2001 a janeiro/2007.
Nome da Empresa:
Banco BBM S.A.
Cargo de funções inerentes ao cargo:
Analista de empresas.
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Banco múltiplo, gestão de recursos de terceiros, administração fiduciária.
Datas de Entrada e saída do cargo:
De agosto/1998 a outubro/2001.
8.5. Em relação ao diretor responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos, fornecer currículo, contendo as seguintes informações:
(i) cursos concluídos:
Engenharia de Produção pela Universidade Federal do Rio de Janeiro (UFRJ) e com dupla formação na Ohio State University (OSU);
(ii) aprovação em exame de certificação profissional (opcional):
Certificado CNPI da APIMEC; Certificado Risco ANBIMA;
(iii) principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
Nome da Empresa:
Citigroup Corretora de Valores CCTVM
Cargo e funções inerentes ao cargo:
Responsável por valorar empresas, operações em mercado de capitais Análise de risco de operações de mercado de capitais Monitoramento de políticas de compliance sobre equipe local da empresa
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Corretora de Títulos e Valores Imobiliários
Datas de entrada e saída do cargo:
Maio 2010 a Setembro 2020
Nome da Empresa:
Banco BTG Pactual S.A.
Cargo e funções inerentes ao cargo:
Analista de empresas

Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Corretora de Títulos e Valores Imobiliários
Datas de entrada e saída do cargo:
De Agosto/2006 a Abril /2010.
Nome da Empresa:
Banco UBS S.A.
Cargo e funções inerentes ao cargo:
Analista de empresas
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Corretora de Títulos e Valores Imobiliários
Datas de entrada e saída do cargo:
De Maio/2005 a Julho/2006.
8.6. Em relação ao diretor responsável pela gestão de risco, caso não seja a mesma pessoa indicada no item anterior, fornecer currículo, contendo as seguintes informações:
(i) cursos concluídos:
Idem ao item 8.5.
(ii) aprovação em exame de certificação profissional:
Idem ao item 8.5.
(iii) principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
Nome da Empresa:
Idem ao item 8.5.
Cargo e funções inerentes ao cargo:
Idem ao item 8.5.
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
Idem ao item 8.5.
Datas de entrada e saída do cargo:
Idem ao item 8.5.
8.7. Em relação ao diretor responsável pela atividade de distribuição de cotas de fundos de investimento, caso não seja a mesma pessoa indicada no item 8.4, fornecer currículo, contendo as seguintes informações:
(i) cursos concluídos:
N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.
(ii) aprovação em exame de certificação profissional:
N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.
(iii) principais experiências profissionais durante os últimos 5 anos, indicando:
Nome da Empresa:
N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.
Cargo e funções inerentes ao cargo:
N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.
Atividade principal da empresa na qual tais experiências ocorreram:
N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.
Datas de entrada e saída do cargo:

N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.

8.8. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de recursos, incluindo:

a) quantidade de profissionais:

05 (cinco), sendo o Diretor responsável, dois analistas de investimento internos e dois consultores.

b) natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:

Análise de títulos e valores mobiliários, seleção de oportunidades de investimentos e tomada de decisão de alocação.

Ao Diretor de Gestão compete a tomada de decisão na construção do portfólio dos fundos a serem geridos, selecionando ativos e definindo o tamanho de cada posição. Ademais, ao Analista de Investimentos compete a análise detalhada das companhias e seu setor, com o objetivo de subsidiar o gestor na tomada de decisão.

c) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:

Além do trabalho produzido internamente de construção dos cenários de alocações para os portfólios, por meio de ferramentas proprietárias (planilhas) e apresentações internas, é utilizado o Bloomberg para pesquisa de dados e séries históricas. O processo de investimento faz uso intensivo da metodologia *bottom-up*, através de acompanhamentos e análise dos principais indicadores de tendências de indústrias, comunicação regular com as companhias, participação em seminários, entre outros. Será realizada uma profunda análise abrangendo todas as demonstrações financeiras, incluindo a investigação de todas as informações divulgadas e os passivos contingenciais, além de minuciosa análise da estrutura acionária da companhia selecionada. A análise da indústria inclui conversas com players da cadeia de valor incluindo fornecedores, clientes, ex-funcionários, atuais e antigos acionistas, etc.

De forma resumida, o processo de seleção de ativos, construção, rebalanceamento de portfólio e tomada de decisão de investimento é assim realizado: a Sociedade combinará estratégias de *stock picking* e *market timing* na escolha de ações para a carteira sob gestão. A geração de alfa baseia-se em análise microeconômica e quantitativa, utilizando métodos proprietários, podendo ser obtida tanto na carteira *long* quanto na *short* (“Double Alpha”). O dimensionamento das posições é feito de forma dinâmica, sem correlação com o racional *bottom-up*, fazendo com que a calibragem da exposição líquida resulte em ganhos direcionais (Beta).

Em paralelo a análise discricionária, no processo de investimento será feito uso intensivo de ferramentas e modelos proprietários de análise quantitativa que auxiliará principalmente no rebalanceamento dinâmico de posições e uso de hedges, além da identificação de “fatores” não capturados pela análise microeconômica. O uso de metodologia quantitativa e a sistematização de processos pela Sociedade tem como objetivo reduzir o risco e a influência de erros cognitivos e vieses emocionais na tomada de decisão.

Apesar do portfólio sob gestão ter como objetivo proporcionar aos seus cotistas, a médio e longo prazo, ganhos de capital por meio do investimento de seus recursos primordialmente no mercado acionário, é possível operar em outros mercados de forma tática (tais como câmbio), buscando geração de valor para o total da estratégia.

O processo de tomada de decisão é coordenado pelo Diretor de Gestão e consiste na análise das oportunidades identificadas através do processo de análise supracitado, competindo-lhe a responsabilidade pela tomada de decisão de investimentos e desinvestimentos. Já a equipe de gestão monitora continuamente o portfólio a fim de verificar o enquadramento das posições adotadas.

8.9. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a verificação do permanente atendimento às normas legais e regulamentares aplicáveis à atividade e para a fiscalização dos serviços prestados pelos terceiros contratados, incluindo:

a) quantidade de profissionais:

02 (dois), sendo o Diretor responsável e um analista interno.

b) natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:

Elaboração, implementação e monitoramento do efetivo cumprimento das rotinas e procedimentos internos visando a mitigação dos riscos inerentes à atividade desenvolvida pela Sociedade, bem como o integral atendimento às normas regulamentares desta atividade.

Nesse sentido, as rotinas adotadas pelo Departamento de Compliance e PLD são respaldadas pelo Manual de Compliance adotado pela Sociedade, competindo ao Diretor de Risco, Compliance e PLD apresentar os manuais e políticas internas aos colaboradores; adequar as diretrizes internas às normas e instruções dos órgãos reguladores e autorreguladores; monitorar o cumprimento da política de segurança da informação; elaborar, implementar e garantir a manutenção anual do plano de treinamento aos colaboradores; conduzir os casos de descumprimento dos controles internos, dentre outras rotinas.

c) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:

São utilizadas planilhas proprietárias para o controle e registro do resultado das 4 rotinas de fiscalização e monitoramento mantidos pelo Departamento de Risco, Compliance e PLD. Desse modo, uma vez verificado a inobservância das normas de conduta e políticas estabelecidas pela Sociedade, o Diretor de Risco, Compliance e PLD irá analisar o caso, podendo aplicar a título de *enforcement*, as sanções previstas nos manuais internos.

Ademais, para acompanhamento das contrapartes das operações, sempre for possível o seu conhecimento, o Departamento de Compliance e PLD realiza constantes pesquisas independentes em sites e listras restritivas para fins de prevenção à lavagem de dinheiro.

d) a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor:

O Diretor de Compliance, Risco e PLD dedica-se com exclusividade a estas atividades e, por isso, possui total independência e autonomia para o exercício das suas funções.

8.10. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para a gestão de riscos, incluindo:

a) quantidade de profissionais:

02 (dois), sendo o Diretor responsável e um analista interno.

b) natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:

Monitoramento do enquadramento das operações efetuadas nos limites definidos na Política de Gestão de Riscos adotada internamente, análise dos riscos inerentes às operações pretendidas.

c) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:

As rotinas e procedimentos envolvidos encontram-se descritos de forma detalhada na Política de Gestão de Riscos adotada pela Sociedade, assim como no Manual de Gerenciamento do Risco de Liquidez, sendo utilizadas planilhas de monitoramento de risco, relatórios de risco desenvolvidos internamente e monitoramento constante por meio de uma análise qualitativa dos riscos, assim como através do cálculo do VaR, Teste de Estresse e Max Drawdown.

As diretrizes estabelecidas na Política Gestão de Riscos, a decisão das métricas e ferramentas de controle a serem utilizadas, bem como os procedimentos no caso de verificação de qualquer inobservância, ficam a cargo do Diretor de Risco, o qual responde ainda pela definição e revisão dos limites de riscos e das regras e parâmetros utilizados para gerenciamento de riscos. Por sua vez, a Equipe de Risco atua e interage de forma proativa com a Equipe de Gestão no intuito de prover informações que mitiguem os riscos das carteiras preventivamente.

d) a forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor:

O Diretor de Compliance, Risco e PLD dedica-se com exclusividade a estas atividades e, por isso, possui total independência e autonomia para o exercício das suas funções.

8.11. Fornecer informações sobre a estrutura mantida para as atividades de tesouraria, de controle e processamento de ativos e da escrituração de cotas, incluindo:

a) quantidade de profissionais:

N/A, posto que a Sociedade não desempenha atividade de tesouraria, controle e processamento de ativos e escrituração de cotas.

b) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:

N/A, posto que a Sociedade não desempenha atividade de tesouraria, controle e processamento de ativos e escrituração de cotas.

c) a indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividade:

N/A, posto que a Sociedade atua exclusivamente como gestora profissional de recursos de terceiros.

8.12. Fornecer informações sobre a área responsável pela distribuição de cotas de fundos de investimento, incluindo:

a) quantidade de profissionais:

N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.

b) natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes:

N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.

c) programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas:

N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.

d) infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos e serviços utilizados na distribuição:

N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.

e) os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos:

N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não há outras informações relevantes.

9. Remuneração da Empresa

9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 6.1, indicar as principais formas de remuneração que pratica:

Taxa de administração: mínima: 2,00% a.a. e máxima: 2,50% a.a.

Taxa de Performance: cobrada semestralmente na base de 20% da valorização das cotas dos fundos que exceder a 100% da variação do benchmark, conforme permitido pela regulação.

9.2. Indicar, exclusivamente em termos percentuais sobre a receita total auferida nos 36 (trinta e seis) meses anteriores à data base deste formulário, a receita proveniente, durante o mesmo período, dos clientes em decorrência de:

N/A, posto que os fundos geridos pela Sociedade tiveram o primeiro aporte em 31/12/2020.

9.3. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

Não há.

10. Regras, Procedimentos e Controles Internos

10.1. Descrever a política de seleção, contratação e supervisão de prestadores de serviços:

A Sociedade adota um processo de diligência perante todo prestador de serviço que venha a ser contratado com o objetivo de avaliar a relação custo x qualidade da contratação. Tal processo de seleção conta com três principais parâmetros que dizem respeito ao preço cobrado pelo serviço, que deve ter um custo-benefício atraente em comparação ao praticado pelo mercado; à qualidade e comprovação da qualificação do prestador para a atividade e idoneidade.

Após a contratação, o Departamento de Compliance, Risco e PLD é responsável pelo monitoramento da prestação dos serviços contratados, indicando eventuais não-conformidades e ressalvas no processo de contratação e durante a prestação do serviço contratado.

10.2. Descrever como os custos de transação com valores mobiliários são monitorados e minimizados:

A Sociedade procura obter eficiência na seleção de prestadores de serviço com melhor relação risco x retorno, monitorando tais custos através da realização de avaliações periódicas, permitindo, assim, minimizar os custos de transação sem comprometer a qualidade do serviço. A Sociedade adota Política de Seleção e Contratação de Prestadores de Serviços, sendo a relação custo x benefício um dos critérios utilizados para a seleção.

10.3. Descrever as regras para o tratamento de soft dollar, tais como recebimento de presentes, cursos, viagens etc.:

A Sociedade adota uma postura conservadora no tratamento de Soft Dollar, somente permitindo a sua aceitação caso não haja influência na independência da tomada de decisão de investimento, escolha de parceiros, tratamento desigual entre os investidores e/ou qualquer tipo de compromisso do Colaborador em contrapartida.

O objetivo da troca de presentes em um ambiente comercial visa criar cordialidade e boas relações profissionais, e não obter injustas vantagens sobre investidores, fornecedores ou parceiros. Assim, é estritamente proibido o recebimento ou o oferecimento de presentes ou benefícios de qualquer valor a/de funcionários públicos, pessoas ou organizações, particulares ou públicas, excetuando-se os casos de pessoas ou entidades que possuam relacionamento comercial com a Sociedade e desde que em valor de até US\$ 200,00 (duzentos dólares americanos).

Poderão ser aceitos convites a almoços, jantares, festas e eventos patrocinados por terceiros, desde que a aceitação de tal convite não seja configurada em intenção de alterar lealdade ou capacidade de julgamento do Colaborador perante a Sociedade.

Brindes promocionais são permitidos desde que contenham a identificação do fornecedor ou cliente. Em caso de dúvida, o colaborador deve aconselhar-se com o Diretor de Risco, Compliance e PLD.

10.4. Descrever os planos de contingência, continuidade de negócios e recuperação de desastres adotados:

A Sociedade conta com um Plano de Continuidade de Negócios que especifica os planos a serem adotados em situações de desastre ou problemas de sistema. Dentre as soluções apresentadas estão: backup *on time* na nuvem, e acesso remoto aos e-mails e arquivos, através da senha de acesso, bem como redundância de armazenamento para salvaguarda em caso de eventual sinistro.

10.5. Descrever as políticas, práticas e controles internos para a gestão do risco de liquidez das carteiras de valores mobiliários:

A metodologia de gestão de liquidez está descrita detalhadamente no Manual de Gerenciamento de Risco de Liquidez. A Sociedade utiliza como ferramenta um relatório diário com cálculo da quantidade de dias necessários para liquidar as posições de forma eficiente, de acordo com a liquidez de cada ativo, bem como considerando o perfil do passivo dos fundos. Ademais, são realizadas análises em cenários de estresses, de modo a verificar se os fundos teriam capacidade de honrar seus compromissos futuros nos cenários de estresse tanto dos ativos como do passivo.

Na regra de liquidez interna assume-se conseguir liquidar 70% (setenta por cento) do patrimônio do fundo em até 20 (vinte) dias, dessa forma respeitando o prazo de resgate dos fundos de 30 dias.

10.6. Descrever as políticas, as práticas e os controles internos para o cumprimento das normas específicas de que trata o inciso I do art. 30, caso decida atuar na distribuição de cotas de fundos de investimento de que seja administrador ou gestor:

N/A, posto que a Sociedade não desempenhará a atividade de distribuição.

10.7. Endereço da página do administrador na rede mundial de computadores na qual podem ser encontrados os documentos exigidos pelo art. 14 desta Instrução:

www.atalayacapital.com.br

11. Contingências:

11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, que sejam relevantes para os negócios da empresa, indicando:

a) principais fatos:

A Sociedade não figura no polo passivo de nenhum processo judicial, administrativo ou arbitral, sob sigilo ou não, que sejam relevantes para os negócios da mesma.

b) valores, bens ou direitos envolvidos:

Diante do exposto acima, não há valores, bens ou direitos envolvidos em processos judiciais, administrativos ou arbitrais, sob sigilo de justiça ou não.

<p>11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem na sua reputação profissional, indicando:</p>
<p>a) principais fatos:</p> <p>O Diretor responsável pela atividade de administração de carteira de valores mobiliários não figura no polo passivo de processos judiciais, administrativos ou arbitrais, seja sob sigilo de justiça ou não, que afete a sua reputação como profissional.</p>
<p>b) valores, bens ou direitos envolvidos:</p> <p>Diante do exposto, não há valores, bens ou direitos envolvidos em demandas judiciais, administrativas ou arbitrais.</p>
<p>11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores:</p> <p>Não há outras informações relevantes a declarar.</p>
<p>11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que a empresa tenha figurado no polo passivo, indicando:</p>
<p>a) principais fatos:</p> <p>Não houve condenação em processos judiciais, administrativos ou arbitrais para ocorrer o trânsito em julgado de qualquer decisão em processos em que a empresa tenha figurado no polo passivo.</p>
<p>b) valores, bens ou direitos envolvidos:</p> <p>Diante do exposto acima, resta evidente que não houve qualquer tipo de valor, bem ou direito envolvido.</p>
<p>11.5. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas nos últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo e tenha afetado seus negócios ou sua reputação profissional, indicando:</p>
<p>a) principais fatos:</p> <p>Não houve condenação judicial, administrativa ou arbitral transitada em julgado em processos que o diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários tenha figurado no polo passivo.</p>
<p>b) valores, bens ou direitos envolvidos:</p> <p>Diante do exposto acima, resta evidente que não houve qualquer tipo de valor, bem ou direito envolvido.</p>
<p>12. Declarações adicionais do diretor responsável pela administração, atestando:</p> <p>Por meio desta, o Diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários da Sociedade declara que:</p> <p>a) não foi acusado em processos administrativos nem punido, nos últimos 5 (cinco) anos em decorrência de atividade sujeita ao controle e fiscalização da CVM, Banco Central do Brasil, Superintendência de Seguros Privados – SUSEP ou Superintendência Nacional de Previdência Complementar – PREVIC, incluindo que não está inabilitado ou suspenso para o exercício de cargo em instituições financeiras e demais entidades autorizadas a funcionar pelos citados órgãos;</p> <p>b) não existem condenações por crime falimentar, prevaricação, suborno, concussão, peculato, “lavagem” de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores, contra a economia popular, a ordem</p>

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 existem impedimentos para administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e 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;

f) não tem contra si títulos levados a protesto.

Rio de Janeiro, 31 de Dezembro de 2021.

LUCIANO DE PABLO PARDO BRANDÃO