



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Formulário de Referência - Pessoa Jurídica

CNPJ: 41.006.363/0001-11

Nome do Administrador de Carteira: ALPHATREE CAPITAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA.

Ano de competência: 2021

2. Histórico da empresa

2.1. Breve histórico sobre a constituição da empresa

A ALPHATREE CAPITAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA. ("Gestora") é uma sociedade empresária limitada, constituída em 26 de fevereiro de 2021 e tem por objeto social a gestão profissional de recursos de terceiros, os quais consistem em fundos de investimento constituídos nos termos da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, conforme alterada ("Instrução CVM 555" e "Fundos 555", respectivamente).

A Gestora possui credenciamento como administradora de carteiras de valores mobiliários na categoria "gestor de recursos" perante a Comissão de Valores Mobiliários ("CVM") para o exercício da atividade de gestor de recursos, devidamente autorizada através dos Atos declaratórios 18.974 CVM de 10 de agosto de 2021.

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

a. Principais eventos societários tais como incorporações, fusões, cisões, alienações e aquisições de controle societário

1ª Alteração Contratual: 07.05.2021:

- Alteração do endereço da Sede

2ª Alteração Societária: 29.10.2021

- Redistribuição do Capital Social e Ingresso de novo sócio: Rodrigo Jolig

- Alteração da Administração e Nomeação de administradores : Jose Robazzi e Leonardo Miranda

- Definição de Valor Patrimonial

b. Escopo das atividades

Desde a constituição, não ocorreram mudanças no escopo das atividades da Alphatree Capital.

c. Recursos humanos e computacionais

Desde a constituição, não ocorreram mudanças nos recursos humanos da empresa, apenas novas contratações para compor o quadro da empresa.

Com relação aos aspectos computacionais, as mudanças foram: aquisição de novos equipamentos (câmeras, desktop, telefones e notebooks) e melhorias no sistema de TI, tais como a implementação de sistema de segurança, antivírus, softwares mais seguros e atualização e modificação de programas e backups.

d. Regras, políticas, procedimentos e controles internos

Desde a fundação, não ocorreram mudanças significativas, apenas melhorias e ajustes nos Manuais e Políticas Internas (Política de Investimentos Pessoais, Política de Gestão de Riscos de Liquidez, Política de KYE e KYC).

3. Recursos Humanos

3.1. Descrever os recursos humanos da empresa, fornecendo as seguintes informações:

a. Número de sócios:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

b. Número de empregados:

5

c. Número de terceirizados:

2

CPF	Nome
349.874.538-78	JONAS TAKAYUKI DOI
287.605.328-40	RODRIGO JOLIG
109.628.898-22	JOSE ROMEU DEL MORO ROBAZZI

4. Auditores

Observação: A empresa deve informar apenas dados relativos à área envolvida na administração de carteiras de valores mobiliários, caso exerça outras atividades.

4.1. Em relação aos auditores independentes, indicar, se houver:

Nome empresarial	Data da contratação	Descrição
------------------	---------------------	-----------

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 (A apresentação destas demonstrações financeiras e deste relatório é obrigatória apenas para o administrador registrado na categoria Administrador Fiduciário, subcategoria Capital Mínimo, de acordo com o inciso II do § 2º do art. 1º.):)

Demonstração Financeira: Não se aplica

Relatório: Não se aplica

6. Escopo das Atividades

6.1. Descrever detalhadamente as atividades desenvolvidas pela empresa, indicando, no mínimo



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

a. Tipos e características dos serviços prestados (gestão discricionária, planejamento patrimonial, controladoria, tesouraria, etc.)

A Gestora foi constituída exclusivamente com o objetivo de exercer a gestão discricionária de fundos de investimento.

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.)

Os produtos geridos pela Gestora consistem em Fundos regidos pela Instrução CVM 555.

c. Tipos de valores mobiliários objeto de administração e gestão

As carteiras dos Fundos 555 geridos são compostas por ativos líquidos variados negociados ou não em mercados organizados, incluindo, sem limitação, títulos públicos, ações, cotas de fundos de investimento em direitos creditórios, derivativos, renda fixa, câmbio, operações compromissadas, entre outros.

d. Se atua na distribuição de cotas de fundos de investimentos 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 atuação da Gestora é única e exclusivamente com gestão de recursos, conforme descrito no item 6.1. (a), não existindo, portanto, conflitos de interesse a serem endereçados.

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

A atuação da Gestora é única e exclusivamente com gestão de recursos, conforme descrito no item 6.1. (a), não existindo, portanto, conflitos de interesse a serem endereçados.

6.3. Descrever o perfil dos investidores de fundo e carteiras administradas geridas pela empresa, fornecendo as seguintes informações

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
a. Número de investidores	14	0	14



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

b. Número de investidores, dividido por:	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	0	0	0
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	0	0	0
iii. Instituições Financeiras	0		0
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	0		0
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	0		0
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	0	0	0
vii. Seguradoras	0		0
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	0		0
ix. Clubes de Investimento	0	0	0
x. Fundos de Investimento	3		3
xi. Investidores não Residentes	0		0

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
conta em ordem	11	0	11

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	14	0	14

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
c. Recursos financeiros sob administração	R\$ 324.402.762,82	R\$ 0,00	R\$ 324.402.762,82

d. Recursos financeiros sob administração aplicados em ativos financeiros no exterior R \$ 559.392,66

e. Recursos financeiros sob administração de cada um dos 10 (dez) maiores clientes (não é necessário identificar os nomes) Caso deseje identificar o cliente, informe o nome após o valor dos recursos, utilizando o caracter ";" como separador



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Valor	Nome
R\$ 307.583.066,02	
R\$ 7.171.127,87	
R\$ 5.036.932,18	
R\$ 2.046.584,01	
R\$ 1.219.397,72	
R\$ 1.027.756,55	
R\$ 204.658,40	
R\$ 76.431,64	
R\$ 51.106,67	
R\$ 30.698,76	

f. Recursos financeiros sob administração, dividido entre investidores:

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
i. Pessoas Naturais	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
ii. Pessoas Jurídicas (não financeiras ou institucionais)	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
iii. Instituições Financeiras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
iv. Entidades Abertas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
v. Entidades Fechadas de Previdência Complementar	R\$ 0,00		R\$ 0,00
vi. Regimes Próprios de Previdência Social	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
vii. Seguradoras	R\$ 0,00		R\$ 0,00
viii. Sociedades de Capitalização e de Arrendamento Mercantil	R\$ 0,00		R\$ 0,00
ix. Clubes de Investimento	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
x. Fundos de Investimento	R\$ 319.746.129,07		R\$ 319.746.129,07
xi. Investidores não Residentes	R\$ 0,00		R\$ 0,00

xii. Outros	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
conta em ordem	R\$ 4.656.633,75	R\$ 0,00	R\$ 4.656.633,75

	Fundos e carteiras destinados a investidores qualificados	Fundos e carteiras destinados a investidores não qualificados	Total
Total	R\$ 324.402.762,82	R\$ 0,00	R\$ 324.402.762,82

6.4. Fornecer o valor dos recursos financeiros sob administração, dividido entre:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

a. Ações	R\$ 32.194.678,50
b. Debêntures e outros títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas não financeira	R\$ 0,00
c. Títulos de renda fixa emitidos por pessoas jurídicas financeiras	R\$ 0,00
d. Cotas de fundos de investimento em ações	R\$ 0,00
e. Cotas de fundos de investimento em participações	R\$ 0,00
f. Cotas de fundos de investimento imobiliário	R\$ 0,00
g. Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios	R\$ 0,00
h. Cotas de fundos de investimento em renda fixa	R\$ 0,00
i. Cotas de outros fundos de investimento	R\$ 559.392,66
j. Derivativos (valor de mercado)	R\$ -1.802.187,75
k. Outros valores mobiliários	R\$ 0,00
l. Títulos públicos	R\$ 230.346.963,93
m. Outros ativos	R\$ 64.426.839,40
Total	R\$ 325.725.686,74

6.5. Descrever o perfil dos gestores de recursos das carteiras de valores mobiliários nas quais o administrador exerce atividades de administração fiduciária:

Não aplicado à categoria de Gestor de Recursos.

6.6. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes:

N/A

7. Grupo Econômico

7.1. Descrever o grupo econômico em que se insere a empresa, indicando:

a. Controladores diretos e indiretos

CPF/CNPJ	Nome
40.407.354/0001-70	controle direto JDH Parterns Holding Ltda
40.673.967/0001-59	controle direto JDH Associados Holding Ltda
287.605.328-40	controle indireto Rodrigo Jolig
349.874.538-78	controle indireto Jonas Takayuki Doi
07.513.209/0001-06	controle indireto Perspectiva Investimentos e Participações

b. Controladas e coligadas

CNPJ	Nome
-	Não Informado

c. Participações da empresa em sociedade do grupo

CNPJ	Nome
-	Não Informado

d. Participações de sociedades do grupo na empresa



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

CNPJ	Nome
-	Não Informado

e. Sociedades sob controle comum

CNPJ	Nome
-	Não Informado

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 7.1.

Nenhum arquivo selecionado.

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

Comitê Executivo: É o órgão deliberativo de alçada máxima, com a função primordial de definir a estratégia de negócios da Gestora, avaliar o desempenho da equipe e definir a distribuição de resultados. Tem autonomia para acompanhar todas as atividades dos Colaboradores, Diretores e demais Comitês das Gestoras, podendo, inclusive, solicitar e acessar quaisquer informações e documentos de propriedade da Gestora e dos fundos de investimento geridos.

Comitê de Investimentos: O comitê tem por objetivo (i) Apresentação dos modelos de investimento;(ii) Análise dos cenários de investimentos;(iii) Discussão e análise de elementos particulares e alavancas de valor de companhias investidas; (iv) Análise cenário macroeconômico a longo prazo; e (v) Acompanhamento do mercado e dos riscos envolvidos.

Comitê de Compliance, Risco e PLD: O comitê possui as seguintes atribuições:(i) analisar eventuais situações apresentadas pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD sobre as atividades e rotinas de Compliance;(ii) revisar as metodologias e parâmetros de controle existentes;(iii) analisar eventuais casos de infringência das regras descritas no Manual de Regras, Procedimentos e Controles Internos da Gestora, nas demais políticas e manuais internos da Gestora, das regras contidas na regulamentação em vigor, ou de outros eventos relevantes e definir as sanções a serem aplicadas.

b. Em relação aos comitês, sua composição, frequência com que são realizadas suas reuniões e a forma como são registradas suas decisões

O Comitê Executivo é composto pelo diretor de investimentos Rodrigo Jolig e pelo diretor executivo Jonas Doi podendo outros Colaboradores serem convidados a participar pontualmente como ouvintes ou contribuintes. O Comitê Executivo se reúne mensalmente, ou sempre que necessário, mediante convocação de qualquer um de seus membros.

Comitê de Investimentos: Composto pelo Diretor de Investimentos, pelo Diretor Executivo e pelo Economista Chefe da Gestora. As reuniões serão realizadas semanalmente, podendo, ainda, serem convocadas reuniões em caráter extraordinário sempre que o Diretor de Investimentos julgar necessário. As deliberações são consignadas em ata ou registradas por e-mail.

Comitê de Compliance e Risco: Composto pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD, pelo Diretor de Investimentos, pelos membros do Comitê Executivo e pelos colaboradores da Gestora que integrem a Área de Compliance. As reuniões serão realizadas semanalmente ou sob demanda, e suas deliberações são consignadas em ata ou registradas por e-mail.

c. Em relação aos membros da diretoria, suas atribuições e poderes individuais



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Diretor de Investimentos: Responsável pela definição das estratégias e tomada de decisões de investimento, com base, entre outras, nas informações fornecidas pelos analistas da Equipe de Gestão, visando a busca de melhores oportunidades de investimento para as carteiras dos Veículos sob gestão.

Diretor de Compliance, Risco e PLD: Responsável pela implementação e cumprimento de regras, políticas, procedimentos e controles internos, bem como pela implementação e manutenção da política de prevenção à lavagem de dinheiro e financiamento ao terrorismo.

O Diretor de Compliance, Risco e PLD exerce suas funções com independência e não está subordinado à área de gestão de recursos, possuindo possui autonomia para desfazer qualquer posição dos veículos de investimento da Gestora na hipótese em que os limites de riscos estabelecidos para as carteiras dos veículos sob gestão sejam ultrapassados.

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

Nenhum arquivo selecionado

8.3. Em relação a cada um dos membros de comitês da empresa relevantes para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, indicar:

CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos
338.196.868-86	Fabio Koiti Shirassu	37	engenheiro	Diretor de Compliance e Risco	19/02/2021	indeterminado	Membro do Comitê de Compliance e Riscos
349.874.538-78	Jonas Takayuki Doi	36	engenheiro	Diretor Executivo	19/02/2021	indeterminado	Membro do Comitê Executivo Membro do Comitê de Investimentos Membro do Comitê de Riscos
287.605.328-40	Rodrigo Jolig	41	engenheiro	Diretor de Investimentos	12/01/2021	indeterminado	Diretor de Investimentos Membro do Comitê Executivo Membro do Comitê de Investimentos Membro do Comitê de Riscos

8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, indicar:



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Qualificação	CPF	Nome	Idade	Profissão	Cargo	Data da posse	Prazo do mandato	Outros cargos	Cursos concluídos	Certificação profissional
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	349.874.538-78	Jonas Takayuki Doi	36	engenheiro	Diretor Executivo	19/02/2021	indeterminado	Membro do Comitê de Investimentos Membro do Comitê Executivo	Mestrado em Economia FGV Graduação em engenharia na Escola Politécnica da USP.	CGA-ANBIMA
8.6 (GESTÃO DE RISCO)	338.196.868-86	Fabio Koiti Shirassu	37	engenheiro	Diretor de Compliance e Risco	19/02/2021	indeterminado	Membro do Comitê de Compliance e Risco	Mestrado Profissional em Finanças e Economia FGV Graduação em Engenharia Elétrica - Escola Politécnica de São Paulo	CPA-20
8.4 (GESTÃO DE CARTEIRA)	287.605.328-40	Rodrigo Jolig	41	engenheiro	Diretor de Investimentos	01/12/2021	indeterminado	Membro do Comitê de Investimentos Membro do Comitê Executivo Membro do Comitê de Riscos	Engenharia de Produção pela Escola Politécnica USP Techische Universität Berlin	CFA CGA

8.4. a 8.7. Em relação a cada um dos diretores, fornecer principais experiências profissionais durante os últimos cinco anos, indicando:

**COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS**

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

CPF do Diretor	Nome do Diretor	Nome da Empresa	Cargo	Atividade principal	Data de Entrada	Data de Saída
349.874.538-78	Jonas Takayuki Doi	Verde Asset Management	Gestor Macro Brasil- Fundo Verde	-Elaboração e gestão de operações de renda fixa e moedas para o CEO e CIO Luis Stuhlberger no fundo Verde -Gestor do book Macro Brasil dentro do Fundo Verde -Gestor dos fundos de Renda Fixa -Elaboração de relatórios e estudos sobre o mercado de Renda Fixa e Moedas Análise quantitativa no mercado de Renda Fixa e Moedas	01/01/2015	07/08/2020
338.196.868-86	Fabio Koiti Shirassu	Propel Investimentos	Diretor de Risco e Compliance	-Elaboração de relatórios de risco de mercado, contendo VaR paramétrico, Marginal e Componente, Betas de mercado, Stress Test; -Responsável pela construção e manutenção da base de dados em MySQL para gerenciamento e controle das posições das carteiras; -Controle de enquadramento (regulamento) dos fundos 555; Controle de operações incluindo back-office, cadastro de ativo e passivo, cálculo de resultado, e compra/venda de ativos.	01/11/2017	30/12/2020



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

287.605.328-40	Rodrigo Jolig	Morgan Stanley International London	Chefe global de opções de câmbio para mercados emergentes e chefe da mesa de opções de Londres	-Responsável pela gestão das posições de opções sobre moedas emergentes dos livros de São Paulo, Nova York, Londres e Hong Kong. -Criação de um business altamente competitivo, client oriented e reconhecimento interno e externo. -Responsável por supervisionar a mesa de opções de cambio de Londres, com 7 traders entre g10 e EM	30/08/2018	28/10/2020
----------------	---------------	-------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------	------------



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

338.196.868-86	Fabio Koiti Shirassu	3R Gestora de Recursos	Gerente de Operações e Riscos	Back Office: batimento de carteira dos fundos, estimativa da cota, batimento de notas de corretagens, alocação de operações nos fundos; Middle Office: cálculo de resultado (PnL), Performance Attribution, elaboração de relatórios de controle; Front Office: aluguel de ações, compra/venda de títulos públicos; Cadastro: corretoras e passivos (cotistas), operacional de aplicações e resgates de cotistas; Risco de Mercado/Liquid ez: VaR paramétrico, VaR histórico, Stress Test, Stop Loss/Gain, controle de caixa, margem de garantia, liquidez dos ativos em carteira; Compliance: enquadramento de fundos, divisão de ordens; Suporte a área de Negócios: elaboração de lâminas, relatórios periódicos de desempenhos dos fundos, contendo Performance Attribution, e	30/05/2015	30/11/2017
----------------	----------------------	------------------------	-------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------	------------



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

				indicadores como Beta, Máximo Drawdown, Índice de Sharpe; Suporte ao Portfolio Manager: elaboração de relatórios auxiliares, como Participação de Investidores Estrangeiros na Bolsa, Calendário de Indicadores Econômicos, Atas dos Comitês de Investimento, Controle de Calls dos Analistas.		
287.605.328-40	Rodrigo Jolig	Morgan Stanley New York	Diretor executivo - Trader de opções de câmbio	-Responsável por precificar para clientes e gerenciar o livro de opções vanilla e exóticas de 1ª e 2ª gerações sobre moedas da América Latina, maior foco em BRL, MXN, CLP e COP. -Precificação de opções sobre moedas asiáticas durante os horários de Nova York. Desde 2013, responsável por consolidar o risco global de opções de mercados emergentes, com foco em aumentar a competitividade em moedas da Europa central e África.	30/05/2011	30/08/2018



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

349.874.538-78	Jonas Takayuki Doi	redit Suisse Hedging Griffio	Gestor Macro Brasil - Fundos de Renda Fixa e Multimercado	-Gestor de produtos de Renda Fixa, Moedas e Multimercado de baixa volatilidade -Contato com clientes locais e estrangeiros -Elaboração de relatórios e estudos sobre o mercado de Renda Fixa e Moedas	30/06/2010	30/06/2014
----------------	--------------------	------------------------------	-----------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------	------------

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

a. Quantidade de profissionais

6

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

A Equipe de Gestão é responsável pela análise de investimentos, por elaborar estudos acerca da alocação dos ativos e posições dos Veículos sob gestão, análise e seleção de títulos de renda fixa e variável, com base nos fundamentos corporativos dos emissores, nos retornos atrelados a cada ativo e execução das recomendações de seleção e alocação indicadas pelo Comitê de Investimentos.

c. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

Sistemas: Planilhas de acompanhamento proprietários da Gestora e outras fontes públicas de informação sobre os ativos que poderão ser adquiridos pelas carteiras administradas e fundos de investimento sob gestão. Além disso, existem sistemas de coleta de dados de mercado contratados de terceiros, sistemas de roteamento de ordens, bases de dados relacionais e não-relacionais proprietárias com dados de mercado, ferramentas de análise quantitativa Matlabs e Views, ambientes de desenvolvimento para sistemas em C#, Java, Python, Visual Basic, Office. Por fim, sistema de trocas de mensagens Reuters e Bloomberg e sistemas de trading DMA multi corretoras de 3 provedores diferentes (redundância).

Rotina e Procedimentos: A Gestora realiza a gestão de investimentos com base em uma filosofia fundamentalista-quantitativa, e que por meio de um processo rigoroso de análise busca a melhor relação entre qualidade, retorno e risco para atingir um retorno satisfatório com um horizonte de investimento longo. O processo de investimento parte de um fluxograma composto basicamente de três principais etapas: (i) análise macroeconômica do cenário de longo prazo da economia; (ii) análise dos ativos financeiros utilizando modelos proprietários econométricos e quantitativos; (iii) definição dos portfólios pelo Comitê de Investimento contemplando os resultados das etapas anteriores. Dentre os instrumentos de análise, seleção e monitoramento dos ativos, a gestora usa, principalmente: (i) análise em modelos macroeconômicos fundamentalistas; (ii) análise de modelos quantitativos; (iii) análise top-down; e (iv) análise bottom-up. Uma vez aprovada a tese de investimento, o Comitê de Investimento define a exposição que o ativo deve ter na carteira. A exposição leva em conta: (i) o retorno esperado; (ii) o risco; (iii) a correlação com teses existentes; (iv) a liquidez, e (v) o grau de confiança da Equipe de Gestão com o investimento em pauta.

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

a. Quantidade de profissionais

2



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

As atividades da Equipe de Compliance são desenvolvidas de acordo com o disposto nas disposições do Manual de Regras, Procedimentos e Controles Internos da Gestora, elaborado em conformidade com o disposto no item 2.7 do Ofício Circular/CVM/SIN/Nº 05/2014, na Instrução CVM nº 558, de 26 de março de 2015, conforme alterada, e demais orientações da CVM e entidades autorreguladoras, o qual tem por objetivo estabelecer normas, princípios, conceitos e valores que orientam a conduta dos colaboradores da Gestora, tanto na sua atuação interna quanto na comunicação com os diversos públicos ("Manual").

São atribuições do Diretor de Compliance, Risco e PLD: (i) Acompanhar as políticas descritas no Manual; (ii) Levar quaisquer pedidos de autorização, orientação ou esclarecimento ou casos de ocorrência, suspeita ou indício de prática que não esteja de acordo com as disposições do Manual e das demais normas aplicáveis à atividade da Gestora para apreciação do Comitê de Compliance; (iii) atender prontamente todos os colaboradores da Gestora; (iv) identificar possíveis condutas contrárias ao Manual; (v) centralizar informações e revisões periódicas dos processos de compliance, principalmente quando são realizadas alterações nas políticas vigentes ou se o volume de novos colaboradores assim exigir; (vi) assessorar o gerenciamento dos negócios no que se refere ao entendimento, interpretação e impacto da legislação, monitorando as melhores práticas em sua execução, bem como analisar periodicamente, as normas emitidas pelos órgãos competentes, como a CVM e outros organismos congêneres; (vii) elaborar relatório anual listando as operações identificadas como suspeitas que tenham sido comunicadas às autoridades competentes, no âmbito da Política de Combate e Prevenção à Lavagem de Dinheiro da Gestora; (viii) encaminhar aos órgãos de administração da Gestora, até o último dia útil do mês de abril de cada ano, relatório referente ao ano civil imediatamente anterior à data de entrega, contendo: (a) as conclusões dos exames efetuados; (b) as recomendações a respeito de eventuais deficiências, com o estabelecimento de cronogramas de saneamento, quando for o caso; e (c) a manifestação do diretor responsável pela administração de carteiras de valores mobiliários ou, quando for o caso, pelo diretor responsável pela gestão de risco a respeito das deficiências encontradas em verificações anteriores e das medidas planejadas, de acordo com cronograma específico, ou efetivamente adotadas para saná-las; devendo referido relatório permanecer disponível à CVM na sede da Gestora; (ix) Definir os princípios éticos a serem observados por todos os Colaboradores, constantes do Manual ou de outros documentos que vierem a ser produzidos para este fim, elaborando sua revisão periódica; (x) Promover a ampla divulgação e aplicação dos preceitos éticos no desenvolvimento das atividades de todos os colaboradores, inclusive por meio dos treinamentos periódicos previstos no Manual; (xi) Apreciar todos os casos que cheguem ao seu conhecimento sobre o potencial descumprimento dos preceitos éticos e de compliance previstos no Manual ou nos demais documentos aqui mencionados, e apreciar e analisar situações não previstas; (xii) garantir o sigilo de eventuais denunciadores de delitos ou infrações, mesmo quando estes não solicitarem, exceto nos casos de necessidade de testemunho judicial; (xiii) solicitar sempre que necessário, para a análise de suas questões, o apoio da auditoria interna ou externa ou outros assessores profissionais; (xiv) aplicar as eventuais sanções aos colaboradores; e (xv) analisar situações que cheguem ao seu conhecimento e que possam ser caracterizadas como "conflitos de interesse" pessoais e profissionais. Esses conflitos podem acontecer, inclusive, mas não limitadamente, em situações que envolvam:

a) Investimentos pessoais; b) Transações financeiras com clientes fora do âmbito da Gestora; c) Recebimento de favores/presente.

c. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

Sistemas: A Gestora utiliza um hardware de firewall projetado para evitar e detectar conexões não autorizadas e incursões maliciosas, além da proteção atualizada contra malware nos seus dispositivos e software antivírus projetado para detectar, evitar e, quando possível, limpar programas conhecidos que afetem de forma maliciosa os sistemas da empresa (por exemplo, vírus, worms, spyware).

Além disso, são conduzidas varreduras diárias para detectar e limpar qualquer programa que venha a obter acesso a um dispositivo na rede.

A Alphatree utiliza um plano de manutenção projetado para guardar os seus dispositivos e softwares contra vulnerabilidades com o uso de varreduras e patches. A Gestora mantém e testa regularmente medidas de backup consideradas apropriadas pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD. As informações e base de dados da Gestora são atualmente objeto de backup diário com o uso de computação na nuvem. Rotina e Procedimentos: Todas as rotinas e procedimentos de Compliance constam expressamente do Manual, bem como das demais políticas internas da Gestora entre eles:

- Analisar eventuais situações pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD sobre as atividades e rotinas de compliance;
- Revisar as metodologias e parâmetros de controle existentes; e
- Analisar eventuais casos de infringência das regras descritas neste Manual, nas demais políticas e manuais internos da Gestora, das regras contidas na regulamentação em vigor, ou de outros eventos relevantes e definir sobre as sanções a serem aplicadas.

d. A forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

O Diretor de Compliance, Risco e PLD possui autonomia no exercício de suas atividades, inclusive para convocar reuniões com a Equipe de Gestão para discussão de qualquer situação relevante, por não ser subordinado à esta. O descumprimento ou indício de descumprimento de quaisquer das regras estabelecidas nos manuais e políticas da Gestora por qualquer de seus colaboradores, inclusive pelo Diretor de Investimentos, é avaliado pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD, o qual aplicará as sanções cabíveis, nos termos do Manual, garantido sempre direito de defesa.

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

a. Quantidade de profissionais *

3

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

As atividades desenvolvidas pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD e pelo Comitê de Compliance e Risco constam expressamente da Política de Gestão de Riscos da Gestora e possuem estrita relação com a identificação e monitoramento dos riscos inerentes aos fundos de investimento sob gestão. São obrigações do Comitê de Compliance e Risco: (i) garantir o cumprimento contínuo e a qualidade de execução das disposições da Política de Gestão de Riscos; (ii) atuar de forma preventiva e constante para alertar, informar e solicitar providências pelos Colaboradores atuantes na área de gestão de recursos da Gestora frente a eventuais desenquadramentos de limites normativos e aqueles estabelecidos internamente, conforme periodicidade definida na Política de Gestão de Riscos; (iii) elaborar relatórios de risco e promover a sua divulgação, conforme periodicidade e formatos definidos na Política de Gestão de Riscos; (iv) quando aplicável, acompanhar a marcação a mercado realizada pelo administrador fiduciário dos Veículos de Investimento e verificar se o cálculo da cota está de acordo com o manual de marcação a mercado disponibilizado; (v) fazer a custódia dos documentos que contenham as justificativas sobre as decisões tomadas no âmbito da fiscalização do cumprimento da Política de Gestão de Riscos; (vi) revisar o conteúdo da Política de Gestão de Riscos; (vii) realizar testes de aderência/eficácia das métricas e procedimentos definidos na Política de Gestão de Riscos; (viii) proporcionar treinamentos aos Colaboradores sobre a Política de Gestão de Riscos; e (viii) apresentar ao Comitê de Compliance e Risco os parâmetros atuais de risco das carteiras e recomendar eventuais aprimoramentos e/ou alterações.

c. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

Monitoramento Geral: O Comitê de Compliance e Risco realiza monitoramento diário em relação aos principais riscos relacionados aos Veículos de Investimento, de acordo com cada tipo de risco, conforme descrito na Política de Gestão de Riscos.

Ferramentas de Apoio: O Comitê de Compliance e Risco realiza suas atividades com o auxílio de planilhas em Excel desenvolvidas internamente e do sistema Lote 45, elabora relatórios diários, que refletem os enquadramentos constantes dos documentos regulatórios dos Veículos de Investimento, que são encaminhados aos membros da Equipe de Gestão diariamente. Caso algum limite objetivo seja extrapolado, caso qualquer dos procedimentos aqui definidos não seja observado, ou, ainda, na identificação de alguma situação de risco não abordada na Política de Gestão de Riscos, o Comitê de Compliance e Risco deverá: (i) notificar imediatamente a Equipe de Gestão e solicitar as devidas justificativas a respeito do desenquadramento ou do risco identificado; (ii) estabelecer plano de ação que se traduza no pronto enquadramento das carteiras dos Veículos de Investimento aos limites previstos em seus documentos regulatórios ou nessa Política vigente; e (iii) avaliar a necessidade de eventuais ajustes aos procedimentos e controles adotados pela Gestora. Caso a Equipe de Gestão não cumpra as determinações definidas no plano de ação mencionado acima, o Diretor de Compliance, Risco e PLD está autorizado a ordenar a compra/venda de posições para fins de reenquadramento das carteiras dos Veículos de Investimento nos exatos termos definidos no plano de ação. Sem prejuízo do disposto acima, o Comitê de Compliance e Risco poderá realizar uma análise subjetiva da concentração das carteiras e, caso identifique um risco relevante, deverá sugerir a adoção de medidas adicionais para o gerenciamento de risco, podendo inclusive solicitar a realização de reunião extraordinária do Comitê de Compliance e Risco para tratar do tema e sugerir a adoção de plano de ação para mitigação do referido risco. Os eventos mencionados acima deverão também ser objeto de reprodução no relatório anual de risco e compliance da Gestora, apresentado até o último dia de abril de cada ano aos administradores da Gestora. **Testes de Aderência.** O Comitê de Compliance e Risco deve realizar anualmente testes de aderência/eficácia das métricas e procedimentos previstos nesta Política.

d. A forma como a empresa garante a independência do trabalho executado pelo setor

O Comitê de Compliance, Risco e PLD, liderada pelo Diretor de Compliance, Risco e PLD, possui total autonomia no exercício de suas atividades, não sendo subordinada à Equipe de Gestão, e podendo inclusive desfazer posições nos fundos de investimento sob gestão.



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

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

a. Quantidade de profissionais

b. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

N/A

c. A indicação de um responsável pela área e descrição de sua experiência na atividades

N/A

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

a. Quantidade de profissionais

b. Natureza das atividades desenvolvidas pelos seus integrantes

N/A

c. Programa de treinamento dos profissionais envolvidos na distribuição de cotas

N/A

d. Infraestrutura disponível, contendo relação discriminada dos equipamentos, programas e serviços utilizados na distribuição

N/A

e. Os sistemas de informação, as rotinas e os procedimentos envolvidos

N/A

8.13. Fornecer outras informações que a empresa julgue relevantes

N/A

9. Remuneração da Empresa

9.1. Em relação a cada serviço prestado ou produto gerido, conforme descrito no item 2.1. do anexo 15-I, indicar as principais formas de remuneração que pratica:

Pela gestão de fundos de investimento, a Gestora cobra a taxa de gestão pela prestação dos seus serviços um percentual de, em regra, até 2% (dois por cento) ao ano, e, eventualmente, uma taxa de performance, podendo esta ser provisionada e paga semestralmente ou anualmente, equivalente, em regra, a 20% (vinte por cento) do que exceder o índice de referência. (benchmark) indicado para o fundo de investimento. Os fundos de investimento não cobrarão taxa de ingresso ou taxa de saída.

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

a. Taxa com bases fixas (%):



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

0,00

b. Taxa de performance (%):

0,00

c. Taxa de ingresso (%):

0,00

d. Taxa de saída (%):

0,00

e. Outras taxas (%):

0,00

Total (%):

0,00

9.3. Fornecer outras informações que julgue relevantes:

N/A - A Gestora foi recentemente constituída e não auferiu receita nos últimos 36 (trinta e seis meses).

10. Regras Procedimentos e Controles Internos

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

A seleção e contratação de Terceiros é um processo conduzido de forma conjunta pelo Diretor de Investimentos e pelo Diretor de Compliance e PLD da Gestora, conforme definido no Formulário de Referência da Gestora. A equipe do Compliance e Jurídico é responsável pela condução do processo de due diligence prévio à contratação. O referido processo de due diligence visa obter informações qualitativas sobre o Terceiro que tenha interesse em iniciar vínculo jurídico com a Gestora e com os Fundos de Investimento geridos, de modo a permitir um melhor julgamento durante a pré-seleção. A avaliação de tais informações será feita mediante a apresentação do questionário de due diligence. Em todos os casos, o Diretor de Compliance e PLD exigirá, no que couber, a documentação comprobatória das informações prestadas. Caso não seja possível aferir a veracidade da informação por meio de documentos comprobatórios, o Diretor de Compliance e PLD enviará melhores informações para conferir tais informações. Para maiores informações, consultar a Política de Contratação Terceiros.

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

A Gestora realiza um acompanhamento periódico de todos os custos de transações com valores mobiliários. De forma a minimizar os custos de transação e atuar sempre no melhor interesse dos fundos de investimento sob sua gestão, a Gestora acompanha as corretoras com as quais atua e os custos incorridos em determinado período e busca avaliar se a alocação é compatível com critérios aplicáveis à corretora, tais como: (i) aptidão na execução, incluindo agilidade, eficiência, condições de segurança, frequência de erros, impacto no mercado/liquidez; (ii) serviços operacionais, incluindo alocação, envio de notas de corretagem, liquidação e custódia; (iii) preços e custos relacionados às transações; e (v) disponibilização de sistemas de informação acerca das transações efetuadas.

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

A Alphatree possui instituída a Política de acordos de Soft Dollar, que devem ser transparentes e mantidos por documento escrito, devendo ser utilizado pela gestora exclusivamente em benefício dos clientes, como ferramentas de auxílio da avaliação, seleção e decisão de investimento e suporte à gestão dos fundos e investimento geridos pela Alphatree. Além disso, a Alphatree não deverá selecionar os seus fornecedores considerando somente os benefícios por meio de acordos de Soft Dollar, mas também deverá levar em consideração, a eficiência, produtividades ou menores custos oferecidos por esses fornecedores, de acordo com os seguintes princípios e regras de conduta:

- (i) Colocar os interesses dos clientes acima de seus próprios interesses;
- (ii) Definir de boa-fé se os valores pagos pelos clientes e, conseqüentemente, repassados aos Fornecedores, são razoáveis em relação aos serviços de execução de ordens ou outros benefícios que esteja recebendo;
- (iii) Ter a certeza de que o benefício recebido auxiliará diretamente no processo de tomada de decisões de investimento em relação ao veículo que gerou tal benefício, devendo alocar os custos do serviço recebido de acordo com seu uso, se o benefício apresentar natureza mista;
- (iv) Divulgar amplamente a clientes, potenciais clientes e ao mercado os critérios e políticas adotadas com relação às práticas de Soft Dollar, bem como os potenciais conflitos de interesses oriundos da adoção de tais práticas;
- (v) Cumprir com seu dever de lealdade, transparência e fidúcia com os clientes; e
- (vi) Transferir à carteira dos clientes qualquer benefício ou vantagem que possa alcançar em decorrência de sua condição de Gestora de carteira de valores mobiliários, conforme disposto no artigo 16, inciso VI, da ICVM 558.

Quanto aos brindes, presentes e vantagens, os colaboradores não devem, direta ou indiretamente, nem para si nem para terceiros, solicitar, aceitar ou admitir dinheiro, benefícios, favores, presentes, promessas ou quaisquer outras vantagens que possam influenciar o desempenho de suas funções ou como recompensa por ato ou omissão decorrente de seu trabalho. Os Colaboradores somente poderão aceitar, presentes, refeições ou outros benefícios, sem prévia autorização do Diretor de Compliance, Risco e PLD, nos casos seguintes casos:

- (a) refeição, que não possua valor suficientemente alto a ponto de influenciar o bom desempenho das funções do Colaborador;
- (b) material publicitário ou promocional até um valor de USD100 (cem dólares americanos) distribuídos no curso normal dos negócios;
- (c) qualquer presente ou benefício com valor não superior a USD100 (cem dólares americanos) habitualmente oferecidos na ocasião de um aniversário ou outra ocasião semelhante, que não seja incomum;
- (d) qualquer presente ou benefício com valor de até USD100 (cem dólares americanos); e
- (e) presente da família ou amigos não ligados com os deveres e responsabilidades profissionais.

Caso o benefício ou presente não se enquadrar nos dispostos acima, o Colaborador somente poderá aceitá-lo mediante prévia autorização do Diretor de Compliance, Risco e PLD. Para maiores informações a respeito da Política do soft dollar e benefícios e brindes, consulte as Políticas Internas da Alphatree : <https://www.alphatree.com.br/>

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



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

O Plano de Continuidade de Negócios da Gestora dispõe de um ambiente de sistemas baseado em nuvem, bem como equipamentos de uso diários de natureza móvel (notebooks), portanto em caso de interrupção ou de quebra de infraestrutura de rede, a empresa é capaz de voltar a operar rapidamente em outra(s) localidade(s). Os procedimentos serão adotados na eventualidade de contingência, de modo a impedir descontinuidade operacional por problemas que impactem no funcionamento da empresa no âmbito da sua atividade de gestão de recursos. Para coordenar todas as ações necessárias em situações de contingência, bem como promover o adequado treinamento e ações para restabelecimento da situação de atividade normal, foi definido como responsável pela Equipe de Contingência o Diretor de Compliance, Risco e PLD da Alphatree, que, anualmente, realiza um teste de contingência para verificar:

- a) Acesso aos sistemas;
- b) Acesso ao e-mail corporativo;
- c) Acesso aos dados armazenados;
- d) Verificação do treinamento aos colaboradores para atuarem como backup; e
- e) Qualquer outra atividade necessária para continuidade do negócio.

O detalhamento do Plano de Contingência e Continuidade dos Negócios da Alphatree consta em Política específica, é revisada em periodicidade anual e está disponível na sede da empresa a todos os interessados.

Plano de recuperação de desastres: A empresa utiliza back-up recorrente em nuvem, permitindo a reconstrução dos ambientes operacionais via restauração de backups em pequeno espaço de tempo em localidades distribuídas.

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

A liquidez dos ativos é monitorada constantemente nos fundos de investimento, de forma que as posições sempre tenham tamanhos adequados, principalmente ao volume negociado dos ativos (individualmente e como portfólio) e ao fluxo de aplicação e resgates.

A análise leva em consideração o prazo de resgate, o número de dias necessários para zerar cada posição, o fluxo de resgates e aplicações de cada veículo, possíveis chamadas adicionais de margem e ajuste de derivativos.

10.6. Descrever as políticas, as práticas e 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

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.alphatree.com.br

11. Contingências

Importante: Não é necessário avaliação do administrador a respeito da chance de perda ou do valor que acredita ser efetivamente devedor em caso de eventual condenação.

11.1. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que a empresa figure no polo passivo, e sejam relevantes para seu patrimônio pessoal, incluindo:

a. Principais fatos *

Não há

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

11.2. Descrever os processos judiciais, administrativos ou arbitrais, que não estejam sob sigilo, em que o diretor responsável pela administração de carteira de valores mobiliários figure no polo passivo e que afetem o seus negócios ou sua reputação profissional, incluindo:

a. Principais fatos

Não há

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há

11.3. Descrever outras contingências relevantes não abrangidas pelos itens anteriores:

Não há

11.4. Descrever condenações judiciais, administrativas ou arbitrais, transitadas em julgado, prolatadas no últimos 5 (cinco) anos em processos que não estejam sob sigilo, em que tenha figurado no polo passivo, indicando:

a. Principais fatos

Não há

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há

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:

a. Principais fatos

Não há

b. Valores, bens ou direitos envolvidos

Não há

12. Declarações

Declaração do administrador, atestando:

Que reuiu o formulário de referência

Mercado

Que o conjunto de informações nele contido é um retrato verdadeiro, preciso e completo de seus negócios (PF) ou da estrutura, dos negócios, das políticas e das práticas adotadas pela empresa (PJ)

Mercado

Declarações adicionais do administrador, informando sobre



COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Rua Sete de Setembro, 111/2-5º e 23-34º Andares – Centro – Rio de Janeiro - RJ – CEP: 20050-901 – Brasil

Tel.: (21) 3554-8686 - www.cvm.gov.br

Acusações decorrentes de processos administrativos, bem como punições sofridas, 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 da 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

Nada a declarar

Mercado

Condenações 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

Nada a declarar

Mercado

Impedimentos de administrar seus bens ou deles dispor em razão de decisão judicial e administrativa

Nada a declarar

Mercado

Inclusão em cadastro de serviços de proteção ao crédito

Nada a declarar

Mercado

Inclusão em relação de comitentes inadimplentes de entidade administradora de mercado organizado

Nada a declarar

Mercado

Títulos contra si levados a protesto

Nada a declarar

Mercado