

Política de Prevenção e Combate à Lavagem de Dinheiro

Data de Atualização: Junho/2022

A Sociedade adotará os melhores padrões de políticas e procedimentos relacionados à prevenção ao crime de lavagem de dinheiro, nos termos da Lei nº 9.613, e da Instrução CVM 617 e do “Guia de Prevenção à Lavagem de Dinheiro”, e ao Financiamento do Terrorismo no Mercado de Capitais Brasileiro, elaborado pela ANBIMA.

Os Diretores e colaboradores deverão empreender seus maiores esforços para evitar a lavagem de dinheiro, que é o processo de disfarçar a natureza e a origem de dinheiro associado a uma atividade criminosa, integrando o "dinheiro sujo" no fluxo comercial, de modo que pareça legítimo ou que não seja possível identificar a sua verdadeira origem.

Como parte das atividades realizadas pela CHESS CAPITAL, é necessário prestar especial atenção às operações que podem representar sérios indícios de crimes de lavagem de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores, nos termos das regras e normas aplicáveis citadas acima. De forma a monitorar e identificar tais indicações, a Gestora observará os seguintes procedimentos, sem prejuízo de outros procedimentos e controles internos previstos na Instrução CVM 617 e outras regulações vigentes:

- (i) Manutenção de registros de todas as operações que envolvam valores mobiliários, independentemente do seu valor, conforme as disposições do Capítulo VI – Registro De Operações e Manutenção De Arquivos da Instrução CVM 617;
- (ii) Manutenção de registros de todas as operações financeiras dos fundos de investimentos geridos pela CHESS CAPITAL;
- (iii) Especial atenção às operações envolvendo os valores mobiliários referidos no artigo 20º da Instrução CVM 617; e
- (iv) Análise das operações que podem possuir relacionamento com outro conjunto de operações com motivos distintos além de investimentos no mercado financeiro e de capitais.

1.1. Responsabilidades e Processos

O Diretor responsável pela prevenção e combate à lavagem de dinheiro garantirá a:

- (i) Implementação e execução de todos os procedimentos descritos ao longo desta Política;

- (ii) Comunicação à CVM, nos termos do artigo 22º da Instrução CVM 617 e dentro de 24 horas de ocorrência que, objetivamente, lhe permita fazê-lo, de cada operação ou operações propostas, cobertas pelos registros referidos no artigo 22º, inciso 3 da Instrução CVM 617, que possam representar graves indícios ou suspeitas significativas de crimes de lavagem de dinheiro ou ocultação de bens, direitos e valores decorrentes de crimes referidos na Lei nº 9.613, datada de 3 de março de 1998, conforme alterada, incluindo terrorismo ou seu financiamento ou a eles relacionados, em que: (a) características excepcionais são confirmadas quanto (i) às partes envolvidas, (ii) forma de execução ou (iii) instrumentos utilizados, ou (b) falta de fundamento econômico ou legal nas operações realizadas;
- (iii) Comunicação à CVM, anualmente, da não ocorrência de nenhuma das hipóteses previstas no item (ii) acima, caso aplicável, até o último dia útil de janeiro de cada ano;
- (iv) Considerando o seu porte, volume, complexidade e tipo das atividades que a Gestora desempenha no mercado de valores mobiliários, a elaboração de relatório relativo à avaliação interna de risco de LDFT, conforme artigo 6º da Instrução CVM 617, contendo o disposto nos incisos I e II do art. 5º e art. 6º da ICVM 617, até o último dia útil do mês de abril de cada ano.

1.2. Sanções Econômicas

A Gestora não realiza transações com países ou entidades elencadas em (i) lista de sanções expedidas pela OFAC, ONU, União Europeia e de Trabalho Escravo do Ministério do Trabalho e Emprego; (ii) lista de restrições emanadas pelo CSNU ou (iii) que estejam classificados por organismos internacionais, em especial o GAFI, como não cooperante ou com deficiências estratégicas em relação à prevenção e ao combate à lavagem de dinheiro e ao financiamento do terrorismo.

A Gestora também proíbe qualquer operação com indivíduos que sejam caracterizados como “sanctions target persons” - as pessoas físicas e jurídicas que estejam na lista disposta pelo OFAC, a qual também dispõe o rol de países considerados de alto risco ou não cooperante e “Specially Designated Nationals” – SDNs que inclui indivíduos, grupos ou entidades terroristas, traficantes, grupos envolvidos com distribuição e lavagem de dinheiro.

1.3. Política Conheça Seu Colaborador (KYE)

Para os fins deste item, serão considerados “Colaboradores” os diretores e colaboradores, bem como administradores, empregados e estagiários de uma organização que seja parceira comercial da Sociedade.

A Sociedade responsabiliza-se por conhecer seus colaboradores, por meio do acompanhamento acerca dos aspectos comportamentais, padrões de vida e respectivos resultados operacionais, atentando para interações inusitadas e significativas nestas variáveis.

A Sociedade manterá seus Diretores e colaboradores constantemente treinados e atualizados em relação às regras, procedimentos e controles internos e prevenção à lavagem de dinheiro e ao financiamento ao terrorismo.

1.3.1. Educação e Treinamento de Colaboradores

Para assegurar o conhecimento e a compreensão das políticas e procedimentos de manutenção do sigilo e segregação de informações disponíveis em vigor, e da conscientização das consequências da não observância de referidas normas e procedimentos, os Diretores e colaboradores da Sociedade serão submetidos a treinamentos periódicos. Os treinamentos contemplarão a apresentação:

- Das políticas e procedimentos descritos na Política de *Compliance* e nas demais normas internas aplicáveis à Sociedade;
- De instruções de uso dos sistemas de arquivamento de informações.

Nos referidos treinamentos, serão disponibilizados, aos Diretores e colaboradores, cópias da Política de *Compliance* e das demais normas internas aplicáveis à Sociedade. Ao final do treinamento, os Diretores e colaboradores deverão assinar um termo de adesão confirmando sua ciência e compreensão das políticas e procedimentos instituídos.

O procedimento de treinamento será repetido:

- Quando da contratação de novos Diretores e colaboradores, sendo o treinamento então ministrado exclusivamente aos Diretores e colaboradores então contratados; e
- Sempre que as políticas e procedimentos forem atualizados, as declarações assinadas serão mantidas pelo Diretor de *Compliance*, Risco e PLD nos arquivos da Sociedade.

Além do treinamento acima descrito, o Diretor de *Compliance*, Risco e PLD providenciará para que os Diretores e colaboradores sejam informados e treinados acerca de eventuais alterações na regulamentação relativa ao mercado de capitais, incluindo, mas não se limitando, às atividades da Sociedade e à manutenção do sigilo e segregação de informações.

1.4. Procedimentos de Prevenção e Combate à Lavagem de Dinheiro (AML) das Contrapartes

Nos termos do disposto na Lei nº 9.613, de 1998 e na Instrução CVM nº 617/19, e no Guia de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e ao Financiamento do Terrorismo no Mercado de Capitais Brasileiro divulgado pela ANBIMA, a negociação de ativos e valores mobiliários financeiros nos fundos de investimento e carteiras administradas também deve ser analisada e monitorada para fins de PLDFT. Neste sentido, a CHESS CAPITAL, nas operações ativas realizadas pelos fundos de investimentos sob sua gestão, entende a contraparte como o “cliente” da operação e deste modo, é responsável pelo seu cadastro e constante monitoramento.

A CHESS CAPITAL solicitará os documentos abaixo como parte integrante de seu processo de avaliação da contraparte:

Contraparte - Pessoa Física: Se a contraparte for pessoa física, a Gestora deve obter, no mínimo, as seguintes informações: (i) nome completo, sexo, profissão, data de nascimento, naturalidade, nacionalidade, estado civil, filiação, nome do cônjuge ou companheiro; (ii) natureza e número do documento de identificação, nome do órgão expedidor e data de expedição; (iii) número de inscrição no Cadastro de Pessoas Físicas (“CPF/MF”); (iv) endereço completo (logradouro, complemento, bairro, cidade, unidade da federação e CEP) e número de telefone; (v) endereço eletrônico para correspondência; (vi) ocupação profissional e entidade para a qual trabalha; (vii) informações sobre os rendimentos e a situação patrimonial; (viii) datas das atualizações do cadastro; (ix) assinatura do cliente; (x) cópia dos seguintes documentos: documento de identidade e comprovante de residência ou domicílio; e (xi) cópias dos seguintes documentos, se for o caso: procuração e documento de identidade do procurador.

Contraparte - Pessoa Jurídica: Se a contraparte for pessoa jurídica, a Gestora deve obter, no mínimo, as seguintes informações: (i) a denominação ou razão social; (ii) nomes e CPF/MF dos controladores diretos ou razão social e inscrição no Cadastro Nacional de Pessoa Jurídica (“CNPJ”) dos controladores diretos; (iii) nomes e CPF/MF dos administradores; (iv) nomes dos procuradores; (v) número de CNPJ e NIRE; (vi) endereço completo (logradouro, complemento, bairro, cidade, unidade da federação e CEP); (vii) número de telefone; (viii) endereço eletrônico para correspondência; (ix) atividade principal desenvolvida; (x) faturamento médio mensal dos últimos doze meses e a situação patrimonial; (xi) denominação ou razão social de pessoas jurídicas controladoras, controladas ou coligadas; (xii) qualificação dos representantes ou procuradores e descrição de seus poderes; (xiii) datas das atualizações do cadastro; (xiv) assinatura do cliente; (xv) cópia dos seguintes documentos: CNPJ, documento de constituição da pessoa jurídica devidamente atualizado e registrado no órgão

competente, e atos societários que indiquem os administradores da pessoa jurídica, se for o caso; e (xvi) cópias dos seguintes documentos, se for o caso: procuração e documento de identidade do procurador.

Contraparte – Âmbito Offshore: Para operações com ativos e fundos de investimentos no exterior, a CHESS CAPITAL observará as normas e preceitos da Instrução CVM nº 555, de 17 de dezembro de 2014, especialmente o Artigo 98 e seguintes.

Na seleção dos administradores e distribuidores de fundos, a Gestora exigirá de tais prestadores, conforme o caso, políticas de prevenção à lavagem de dinheiro e que adotem procedimentos para a boa execução dessas políticas, dentre os quais: utilização da política KYC, realização de treinamento adequado para os funcionários, manutenção de cadastros atualizados de clientes, utilização de sistema específico para investigação e detecção de atividades consideradas suspeitas, e existência de Comitê de Prevenção a Lavagem de Dinheiro ou equivalente. A Gestora também adota como mecanismo padrão de checagem cadastral e reputacional de suas contrapartes a busca em sites de pesquisa, sendo certo que qualquer apontamento deverá ser levado para conhecimento e avaliação da imediata da Diretoria de Compliance.

A CHESS CAPITAL não se eximirá de realizar o controle da contraparte, qualquer que seja o ativo e o ambiente negociado, inclusive em bolsa. Para isso, manterá, na medida da razoabilidade e conforme aplicável, rotinas para identificação e verificação de operações suspeitas e que violem a legislação em vigor. Atenção especial será dada a títulos e a valores mobiliários objeto de distribuição privada (renda fixa ou ações), direitos creditórios, empreendimentos imobiliários etc. Isto posto, a Gestora diligenciará no processo de identificação de contraparte com o objetivo de garantir possuir processos de identificação de contraparte adequados às características e especificidades dos seus negócios.

A CHESS CAPITAL não considerará os bancos incorporados em uma jurisdição na qual não tenha presença física e não afiliado a grupo financeiro regulamentado (“Shell Banks”) como opção de contraparte de suas operações - a Gestora e os fundos sob sua gestão não abrem contas, mantem relacionamento ou transações com ou em nome de Shell Banks.

Cumprе ressaltar que a CHESS CAPITAL executa procedimentos para monitorar e avaliar a faixas de preços dos ativos e valores mobiliários negociados pelos fundos de investimento sob sua gestão vis à vis parâmetros de mercado, de modo que eventuais operações efetuadas fora dos padrões praticados no mercado, de acordo com as características do negócio, sejam identificadas e, se for o caso, comunicados aos órgãos competentes, em especial o COAF.

Por fim, o envio de comunicação de operações suspeitas ao COAF será de responsabilidade da Diretora de Compliance e Risco, sempre que identificados quaisquer indícios de crimes de lavagem de dinheiro. A responsabilidade do Diretor de Compliance e Risco pelo reporte ao COAF não afasta o dever de todos os Colaboradores de comunicar ao Diretor de Compliance e Risco sempre que entenderem qualquer conduta como suspeita.

1.5. Atualização

Esta política será revisada e atualizada pela Diretoria de Risco, Compliance e PLD da Chess Capital com periodicidade mínima anual e em momentos extraordinários (sem periodicidade definida), se aplicável, conforme (i) atualização ou mudança em regulamentação pertinente à atividade da Sociedade ou (ii) solicitação e/ou entendimento de necessidade de ajuste pela Diretoria.