

FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES DO BNP PARIBAS CASH DI FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO

DATA DA COMPETÊNCIA DO DOCUMENTO: 01/07/2020

CNPJ: 29.109.271/0001-61

I - PERIODICIDADE PARA DIVULGAÇÃO DA COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA:

Mensalmente, até 10 (dez) dias após o encerramento do mês a que se referir.

II - LOCAL, MEIO E FORMA DE DIVULGAÇÃO:

O Regulamento e o presente formulário são disponibilizados em meio eletrônico, sob responsabilidade do ADMINISTRADOR: www.bnpparibas.com.br.

III – LOCAL, MEIO E FORMA DE SOLICITAÇÃO DE INFORMAÇÕES PELO COTISTA:

O serviço de atendimento ao cotista contempla os meios:

Eletrônico: tel. (11) 3049-2820 e e-mail mesadeatendimento@br.bnpparibas.com.

Físico: sede do ADMINISTRADOR (Av. Presidente Juscelino Kubitschek, nº 1.909, Torre Sul - 10º andar, São Paulo/SP).

IV - FATORES DE RISCO

Mercado: variação dos preços dos ativos decorrente das condições de mercado quando de sua negociação.

Liquidez: impossibilidade de efetuar pagamentos de resgates dentro do prazo estabelecido no regulamento.

Derivativos: a realização de operações no mercado de derivativos poderá acarretar variações no valor do patrimônio líquido do FUNDO.

Enquadramento Fiscal: o FUNDO poderá sofrer o impacto de depreciação no valor de mercado dos títulos de maior prazo de resgate e implicar em aumento de tributação para os cotistas independente do prazo de permanência no FUNDO.

Alocação dos Ativos: risco da parcela alocada em ativos no exterior e a parcela alocada em fundos no Brasil, levando em conta a evolução diária dos mercados em que o(s) fundo(s) do exterior investem, a variação diária do câmbio, a variação dos mercados e a precificação dos ativos em que os fundos domiciliados no Brasil investem.

Regulatório: alterações nas normas ou leis aplicáveis ao FUNDO podem causar um efeito adverso relevante no preço dos ativos e/ou na performance das posições financeiras adquiridas pelo FUNDO.

Mercado Externo: a performance do FUNDO pode ser afetada por requisitos regulatórios por exigências tributárias relativas aos países que o FUNDO invista ou pela variação do Real em relação a outras moedas.

FATCA: Os investimentos diretos ou indiretos do FUNDO em ativos americanos, poderão se sujeitar à tributação pelo imposto de renda americano na fonte, à alíquota de 30%, exceto se o FUNDO cumprir com o FATCA.

Além dos riscos acima, o FUNDO poderá estar sujeito a outros riscos inerentes à aplicação em ativos financeiros em geral que podem afetar adversamente o desempenho do FUNDO e suas características operacionais.

V - POLÍTICA DE EXERCÍCIO DE DIREITO DE VOTO

A GESTORA adota política de exercício de direito de voto em assembleias referentes aos Ativos Financeiros integrantes da carteira do FUNDO.

A GESTORA baseará sua análise sobre a relevância da matéria objeto de deliberação, buscando sempre as melhores condições para os fundos, atuando com lealdade em relação aos interesses dos cotistas e do FUNDO, evitando, assim, práticas que possam ferir a relação fiduciária com eles mantida.

A Política de Voto ficará disponível na página da GESTORA, na rede mundial de computadores, no site <http://www.bnpparibas.com.br> em "Asset Management".

Excepcionalmente, a pedido da GESTORA, o ADMINISTRADOR poderá exercer a Política de Voto do FUNDO, nos termos acima, sob orientação da GESTORA e sob sua responsabilidade.

O resumo do teor dos votos proferidos e a justificativa sumária do voto proferido ou as razões sumárias para eventual abstenção ou não exercício do direito de voto deverão ser incluídas no perfil mensal do FUNDO.

VI – TRIBUTAÇÃO

Embora o FUNDO busque manter uma carteira de ativos com prazo médio de vencimento superior a 365 dias, **NÃO EXISTE GARANTIA DE QUE O FUNDO TERÁ TRATAMENTO TRIBUTÁRIO DE FUNDOS LONGO PRAZO**

Cotistas: O Imposto de Renda na Fonte (IRF) incidirá semestralmente (come-cotas), no último dia útil de maio e novembro de cada ano, à alíquota de 15% sobre os rendimentos produzidos no período. No resgate, todo o rendimento produzido sofrerá a incidência do IRF às alíquotas de (i) 22,5%, nos resgates efetuados até 180 dias da data da aplicação; (ii) 20%, nos resgates efetuados após 180 dias e até 360 dias; (iii) 17,5%, nos resgates efetuados após 360 dias e até 720 dias; e (iv) 15%, nos resgates efetuados após 720 dias. Nessa ocasião, os valores adiantados quando da ocorrência dos come-cotas semestrais serão descontados para fins de determinação do montante a ser efetivamente recolhido. Ainda que o FUNDO busque manter a carteira enquadrada como de longo prazo, não há compromisso nem garantia de que este FUNDO receberá o tratamento tributário aplicável para fundos de longo prazo, o que poderá sujeitar seus Cotistas à tributação aplicável a um fundo de investimento enquadrado como de curto prazo para fins fiscais. Nesse caso, o IRF incidirá semestralmente, no último dia útil de maio e novembro de cada ano, à alíquota de 20% sobre os rendimentos produzidos no período. No resgate, os rendimentos serão tributados pelo IRF, em função do prazo do investimento, às alíquotas de: (i) 22,5%, em aplicações com prazo de até 180 dias; e (ii) 20%, em aplicações com prazo acima de 180. Ocorrendo incidência do IRF semestral, na ocasião do resgate será aplicada alíquota complementar aplicável, para fins de determinação do montante a ser efetivamente recolhido. IOF/Títulos: Os resgates ocorridos em um prazo inferior a 30 dias da data de aplicação no Fundo sofrerão incidência do IOF à alíquota de 1% ao dia sobre o valor do resgate, limitado ao rendimento da operação, conforme tabela decrescente em função do prazo prevista na regulamentação em vigor. A partir do 30º dia de aplicação, a alíquota passa a zero.

FUNDO: A atual legislação fiscal estabelece que a carteira do FUNDO não está sujeita à incidência de IR e os recursos do FUNDO não estão sujeitos à incidência do IOF

O cotista que de acordo com a legislação vigente não estiver sujeito ou estiver sujeito à tributação diferenciada do IR e do IOF, deverá apresentar ao ADMINISTRADOR documentação comprobatória.

VII - POLÍTICA DE ADMINISTRAÇÃO DOS RISCOS:

A GESTORA possui Comitês de Risco por meio dos quais é definida uma carteira-modelo para os objetivos de performance, conforme Política de Investimento. A ADMINISTRADORA é responsável pela Política de Administração de risco do FUNDO, conforme segue:

I- Risco de Mercado: A administração deste risco é avaliada, principalmente, através de projeções da perda esperada em cenários de stress (Stress testing), V@R (Value at Risk) e Tracking Error para a parcela de Renda Variável, quando aplicável. A perda esperada em cenários de stress é calculada através da simulação dos efeitos produzidos na carteira frente a cenários de mercado adversos. Os referidos cenários estão baseados no modelo de margens da BM&F, definidos através dos Comitês de Risco e projetam oscilações máximas e mínimas para os mercados em que o FUNDO atua. A administração de risco é efetuada através da utilização de modelos estatísticos que visam projetar, em condições normais de mercado, a máxima perda provável para o portfólio de investimentos do FUNDO, num dado horizonte de tempo, para um intervalo de confiança definido (V@R – Value at Risk). O Tracking Error calcula a aderência do fundo em relação ao benchmark. Estas simulações são efetuadas em base diária, de modo a projetar o risco assumido pelo FUNDO com base em sua carteira atualizada.

II- Risco de Crédito: A GESTORA utiliza uma política de atribuição de limites proporcionais à sua avaliação da qualidade do crédito dos títulos e emissores, que contempla: limite (% do PL) por emissor ou título; limite (R\$) por emissor; limite (% do PL) por emissor ou títulos na mesma categoria; e limite do montante da emissão ou do patrimônio do emissor.

III- Risco de Liquidez: A administração deste risco requer planejamento para a gestão e operação sob condições normais de stress e deve ser consistente nas análises e medidas que permitam a projeção de liquidez dos recursos geridos, considerando-se também a cotização e o perfil do passivo do FUNDO e avaliar as opções sob várias condições de mercado, plano de contingência e manutenção de níveis adequados de liquidez a custos razoáveis.

O ADMINISTRADOR e a GESTORA não adotam política específica para administrar os demais riscos. Não há garantia contra eventuais perdas patrimoniais que possam ser incorridas pelo FUNDO.

VIII - AGÊNCIA DE RATING:

Não há agência de classificação de risco de crédito contratada pelo FUNDO.

IX - APRESENTAÇÃO DO ADMINISTRADOR E DA GESTORA:

IX.1 – ADMINISTRADOR

Razão Social: BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

CNPJ: 01.522.368/0001-82

Endereço: Endereço: Av. Pres. Juscelino Kubitschek, 1.909 | 10º andar – Torre Sul

Autorização de Funcionamento: Autorização de Funcionamento nº 96.00639119, datada de 16/10/1996 e autorização a prestar os serviços de administração de carteiras de valores mobiliários por meio do Ato Declaratório CVM nº 4448 de 21/08/1997.

Informações Adicionais: O ADMINISTRADOR é filial do BNP Paribas, instituição financeira internacional, maior banco privado da França e um dos maiores da Europa, presente em mais de 80 países, no Brasil há mais de 50 anos através de um escritório de representação e desde 1996 como banco múltiplo. Dentre os principais serviços prestados pelo ADMINISTRADOR estão administração fiduciária, custódia, escrituração e distribuição de fundos de investimento.

Quanto aos tipos de fundos de investimento administrados pelo ADMINISTRADOR, estes compreendem, em sua maioria, fundos de investimento regidos pela Instrução CVM 555/14.

No desempenho das suas atividades, o ADMINISTRADOR emprega altos padrões de fidúcia e adota os mecanismos necessários, tanto físicos quanto eletrônicos, para evitar eventuais conflitos de interesse.

O ADMINISTRADOR poderá renunciar à administração do FUNDO, ficando obrigado a convocar imediatamente a assembleia geral de cotistas para eleger o substituto, a se realizar no prazo de até 15 (quinze) dias, devendo o ADMINISTRADOR permanecer no exercício de suas funções até sua efetiva substituição, que deverá ocorrer no prazo máximo de 30 (trinta) dias, sob pena de liquidação do FUNDO pelo ADMINISTRADOR.

As aplicações realizadas no FUNDO não contam com garantia do ADMINISTRADOR e/ou da GESTORA, ou, ainda, de qualquer mecanismo de seguro e do Fundo Garantidor de Créditos – FGC.

IX.II – GESTORA

Razão Social: BNP Paribas Asset Management Brasil Ltda.

CNPJ: 02.562.663/0001-25

Endereço: Endereço: Av. Pres. Juscelino Kubitschek, 1.909 | 10º andar – Torre Sul

Autorização de funcionamento: Ato Declaratório CVM nº 5.032, datado de 03 de setembro de 1998

Informações Adicionais: A GESTORA iniciou suas atividades em junho de 1998, é controlada pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A e pelo BNP Paribas Asset Management Group S.A.S., subsidiária do Grupo BNP Paribas para a gestão internacional de ativos.

No desempenho de suas atividades, a GESTORA conta com profissionais altamente especializados e com experiência nos mercados financeiro e de capitais.

A GESTORA possui uma ampla família de Fundos em diversas categorias, tais como:

- Fundos Renda Fixa
- Fundos Multimercados
- Fundos para Investidores Estrangeiros
- Fundos de Ações
- Fundos Previdenciários
- Fundos de Capital Protegido
- Fundos de Investimento no Exterior

A estrutura da GESTORA divide-se nas seguintes áreas:

- Risco e Controles
- Compliance
- Governança
- Renda Variável (Long Only, Long & Short, High Alpha, Equities Research)
- Renda Fixa, Multimercado, Pesquisa de Crédito
- Pesquisa Econômica, *Asset Allocation*
- Fundo de Fundos
- Produtos e Relacionamento com Investidores
- Alternativos e Estruturados

A GESTORA utiliza sistemas de mercado para a administração das carteiras, largamente utilizados por outros gestores para essa finalidade, adequados e confiáveis, cujas atualizações

sejam velozes e satisfatórias. Além disso, a equipe de gestão utiliza ferramentas para acompanhamento de mercado e plataformas de negociações, bem como consultorias econômicas.

O Processo de Investimento e Análise da GESTORA conta com comitês formais periódicos, dentre eles: Comitê de Investimento, Crédito, Performance, Compliance, Liquidez, Risco e Produtos.

A GESTORA adota mecanismos a fim de evitar conflitos de interesse, nos quais os interesses próprios da GESTORA possam ser divergentes ou conflitantes com os interesses dos cotistas.

X - PRESTADORES DE SERVIÇO

Custodiante: BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Responsável pela Escrituração da Emissão e Resgate de Cotas: BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Auditor Independente: KPMG AUDITORES INDEPENDENTES.

Distribuidor: BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Consultor de Investimentos: N.A.

O DISTRIBUIDOR OFERTA PARA O PÚBLICO ALVO DO FUNDO, PREPONDERANTEMENTE, FUNDOS GERIDOS POR UM ÚNICO GESTOR OU POR GESTORES LIGADOS A UM MESMO GRUPO.

XI - POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO DE COTAS:

O serviço de distribuição consiste, basicamente, no agenciamento de clientes, pessoas jurídicas ou físicas, domiciliadas no país ou no exterior, inclusive outros fundos de investimento, de forma direta e/ou através do mecanismo de distribuição por conta e ordem, conforme previstos na regulamentação em vigor.

O ADMINISTRADOR é o principal distribuidor das cotas do FUNDO ("Distribuidor Principal") e atua por meio dos seus canais de distribuição internos para os segmentos de investidores institucionais, de acordo com o público alvo.

O ADMINISTRADOR, em nome do fundo ou em nome próprio (no caso de agentes autônomos de investimento), pode contratar outros prestadores de serviços de distribuição na modalidade por conta e ordem ("DISTRIBUIDOR"). Nesta modalidade, o DISTRIBUIDOR é responsável pelo cadastro, identificação, verificação da adequação do produto ao perfil do cliente, bem como por todo o relacionamento com o cliente. O DISTRIBUIDOR é remunerado pela distribuição das cotas do FUNDO, sendo que tal remuneração é debitada da taxa de administração prevista no regulamento do FUNDO. Não há conflito de interesses entre as atividades do ADMINISTRADOR, do DISTRIBUIDOR e dos demais prestadores de serviços do FUNDO.

A remuneração do DISTRIBUIDOR é paga mensalmente e acordada previamente com o Distribuidor Principal, no qual são negociados os percentuais que serão incidentes sobre a parcela da taxa de administração cobrada pelos fundos de investimento e calculada com base no valor diário das aplicações mantidas pelos cotistas indicados pelo DISTRIBUIDOR.

Os funcionários do ADMINISTRADOR, GESTORA e demais prestadores de serviço do FUNDO devem comunicar aos seus superiores imediatos potenciais conflitos de interesse, sejam relativos a análises, investimentos, operações com títulos e valores mobiliários, clientes ou potenciais clientes.

O ADMINISTRADOR e a GESTORA possuem uma política de *suitability* e *know your client*, a fim de verificar a adequação dos produtos e serviços ao perfil de seus clientes, com o objetivo de recomendar o que for mais adequado.

INFORMAÇÕES SOBRE AUTORREGULAÇÃO ANBIMA

Classificação: **Renda Fixa Duração Livre Soberano**

Renda Fixa: Buscam retorno por meio de investimentos em ativos de renda fixa (sendo aceitos títulos sintetizados por derivativos), admitindo-se estratégias que impliquem em risco de juros e de índice de preços do mercado doméstico. Excluem-se estratégias que impliquem em risco de moeda estrangeira ou de renda variável, não admitindo alavancagem.

Duração Livre: fundos que têm como objetivo buscar retorno por meio de investimentos em ativos e derivativos de renda fixa, sem compromisso de manter limites mínimo ou máximo para a duration média ponderada da carteira. O hedge cambial da parcela de ativos no exterior é facultativo.

Soberano: Devem manter 100% em títulos públicos federais

ESTE FORMULÁRIO FOI PREPARADO COM AS INFORMAÇÕES NECESSARIAS AO ATENDIMENTO DAS DISPOSIÇÕES DO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO, BEM COMO DAS NORMAS EMANADAS DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS. A AUTORIZAÇÃO PARA FUNCIONAMENTO E/OU VENDA DAS COTAS DESTE FUNDO NÃO IMPLICA, POR PARTE DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS OU DA ANBIMA, GARANTIA DE VERACIDADE DAS INFORMAÇÕES PRESTADAS, OU JULGAMENTO SOBRE A QUALIDADE DO FUNDO, DE SEU ADMINISTRADOR OU DAS DEMAIS INSTITUIÇÕES PRESTADORAS DE SERVIÇOS.

ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS COTISTAS.

O INVESTIMENTO DO FUNDO DE QUE TRATA ESTE FORMULÁRIO APRESENTA RISCOS PARA O INVESTIDOR. AINDA QUE O GESTOR DA CARTEIRA MANTENHA SISTEMA DE GERENCIAMENTO DE RISCOS, NÃO HÁ GARANTIA DE COMPLETA ELIMINAÇÃO DA POSSIBILIDADE DE PERDAS PARA O FUNDO E PARA O INVESTIDOR.

ESTE FUNDO NÃO CONTA COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO, OU, AINDA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS – FGC.

A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA.

AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESSE FORMULÁRIO ESTÃO EM CONSONÂNCIA COM O REGULAMENTO DO FUNDO, MAS NÃO O SUBSTITUEM. É RECOMENDADA A LEITURA CUIDADOSA TANTO DESTE FORMULÁRIO QUANTO DO REGULAMENTO, COM ESPECIAL

ATENÇÃO PARA AS CLÁUSULAS RELATIVAS AO OBJETIVO E À POLÍTICA DE INVESTIMENTO DO FUNDO, BEM COMO ÀS DISPOSIÇÕES DO FORMULÁRIO E DO REGULAMENTO QUE TRATAM DOS FATORES DE RISCO A QUE O FUNDO ESTÁ EXPOSTO.

XIII - DEMAIS INFORMAÇÕES RELEVANTES

LIMITES DO FUNDO PARA MOVIMENTAÇÃO	
Aplicação Inicial Mínima:	N/A
Movimentação Mínima	N/A
Saldo Mínimo	N/A
Horário limite de movimentação	17h00min

XIV – AUDITOR INDEPENDENTE:

ERNST & YOUNG AUDITORES INDEPENDENTES S/S