



**BNP PARIBAS**

**LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS SOBRE O  
WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO**

**CNPJ/MF: 17.453.850/0001-48**

**Informações referentes a Julho de 2024**

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o **WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO**, administrado por **BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.** e gerido por **WESTERN ASSET MANAGEMENT**. As informações completas sobre esse fundo podem ser obtidas no Regulamento do fundo, disponível no site [www.bnpparibas.com.br](http://www.bnpparibas.com.br). As informações contidas neste material são atualizadas mensalmente. Ao realizar aplicações adicionais, consulte a sua versão mais atualizada.

**Antes de investir, compare o fundo com outros da mesma classificação.**

1. **PÚBLICO-ALVO: Público em geral**
2. **OBJETIVOS DO FUNDO: O objetivo do FUNDO é, no médio e longo prazos, buscar a valorização dos capitais investidos pelos cotistas por meio de investimentos no mercado de renda fixa e no mercado renda variável, buscando a maior exposição possível ao mercado de renda variável.**
3. **POLÍTICA DE INVESTIMENTOS:**
  - a. O FUNDO buscará manter, em condições normais de mercado, exposição da carteira de, no mínimo, 95% no mercado de renda variável. No mercado de renda variável, o FUNDO realizará operações de derivativos envolvendo contratos futuros referenciados em índices de ações, adotando o "S&P500 - Standard & Poor's 500"\*. No mercado de renda fixa, a GESTORA poderá investir em títulos públicos federais, cotas de fundos de investimento (FIs), cotas de fundos de investimento em cotas (FICs) e operações compromissadas com lastro em títulos público
  - b. O fundo pode:



Aplicar em ativos no exterior até o limite de	0.00% do Patrimônio líquido
Aplicar em crédito privado até o limite de	0.00% do Patrimônio líquido
Aplicar em um só fundo	10.00% do Patrimônio líquido
Utiliza derivativos apenas para proteção da carteira?	Não
Limite margem de garantia/risco de capital	100.00% do Patrimônio líquido

(i) No cálculo do limite de alavancagem, deve-se considerar o valor das margens exigidas em operações com garantia somada a "margem potencial" de operações de derivativos sem garantia. O cálculo de "margem potencial" de operações de derivativos sem garantia deve se basear em modelo de cálculo de garantia do administrador e não pode ser compensado com as margens das operações com garantia.

- c. A metodologia utilizada para o cálculo do limite de alavancagem, disposto no item 3.b é o percentual máximo que pode ser depositado pelo fundo em margem de garantia para garantir a liquidação das operações contratadas somado à margem potencial para a liquidação dos derivativos negociados no mercado de balcão.
- d. As estratégias de investimento do fundo podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.

#### 4. CONDIÇÕES DE INVESTIMENTO

Investimento inicial mínimo	R\$ 500.00
Investimento adicional mínimo	R\$ 100.00
Resgate mínimo	R\$ 100.00
Horário para aplicação e resgate	15:00 (horário de Brasília)
Valor mínimo para permanência	R\$ 500.00
Período de carência	Não há
Conversão das cotas	Na aplicação, o número de cotas compradas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento da data da aplicação. No resgate, o número de cotas canceladas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do dia do pedido de resgate.
Pagamento dos resgates	O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é no 1º dia útil seguinte da conversão.
Taxa de administração	1% ao ano sobre o PL do FUNDO
Taxa de entrada	Não há
Taxa de saída	Não há
Taxa de performance	Não há



<b>Taxa total de despesas</b>	As despesas pagas pelo fundo representaram 1,08 do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/08/2023 a 31/07/2024. A taxa de despesas pode variar de período para período e reduz a rentabilidade do fundo. O quadro com a descrição das despesas do fundo pode ser encontrado em <a href="http://www.bnpparibas.com.br">www.bnpparibas.com.br</a>
-------------------------------	---

5. **COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA:** o patrimônio líquido do fundo é de **R\$ 1,165,726,555.93** e as 5 espécies de ativos em que ele concentra seus investimentos são:

<b>Derivativos</b>	99.13% do Patrimônio líquido
<b>Títulos públicos federais</b>	94.25% do Patrimônio líquido
<b>Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais</b>	4.67% do Patrimônio líquido

6. **RISCO<sup>(1)</sup>:** o BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. classifica os fundos que administra numa escala de 1 a 5 de acordo com o risco envolvido na estratégia de investimento de cada um deles. Nessa escala, a classificação do fundo é:

Menor risco Maior risco

1                      2                      3                      4                      5



7. **HISTÓRICO DE RENTABILIDADE<sup>(2)</sup>:**

- a. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.
- b. **Rentabilidade acumulada nos últimos 5 anos: 105.49%** . A tabela abaixo mostra a rentabilidade do **fundo** a cada ano nos últimos 5 anos. Em **1** desses anos, o fundo perdeu parte do patrimônio que detinha no início do ano.

Ano	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Não há índice de referência	Desempenho do fundo como % do
2024	18.14%	N/A	N/A
2023	33.02%	N/A	N/A



2022	-11.99%	N/A	N/A
2021	32.45%	N/A	N/A
2020	12.17%	N/A	N/A

c. **Rentabilidade mensal:** a rentabilidade do **fundo** nos últimos 12 meses foi:

Mês	Rentabilidade do fundo (líquida de despesas, mas não de impostos)	Não há índice de referência	Desempenho do fundo como % do
Julho	1.36%	N/A	N/A
Junho	3.91%	N/A	N/A
Maio	5.02%	N/A	N/A
Abril	-3.83%	N/A	N/A
Março	3.41%	N/A	N/A
Fevereiro	5.65%	N/A	N/A
Janeiro	1.66%	N/A	N/A
Dezembro	5.17%	N/A	N/A
Novembro	9.32%	N/A	N/A
Outubro	-1.74%	N/A	N/A
Setembro	-4.43%	N/A	N/A
Agosto	-0.95%	N/A	N/A
12 meses	26.34%	N/A	N/A

8. **EXEMPLO COMPARATIVO:** utilize a informação do exemplo abaixo para comparar os custos e os benefícios de investir no fundo com os de investir em outros fundos.

a. **Rentabilidade:** Se você tivesse aplicado R\$ 1.000,00 (mil reais) no **fundo** no primeiro dia útil de 2023 e não houvesse realizado outras aplicações, nem solicitado resgates durante o ano, no primeiro dia útil de 2024, você poderia resgatar R\$ R\$ 1269,96, já deduzidos impostos no valor de R\$ R\$ 57,27.

b. **Despesas:** As despesas do **fundo**, incluindo a taxa de administração, a taxa de performance (se houver), e as despesas operacionais e de serviços teriam custado R\$ R\$ 14,01.

9. **SIMULAÇÃO DE DESPESAS:** utilize a informação a seguir para comparar o efeito das despesas em períodos mais longos de investimento entre diversos fundos:



Assumindo que a última taxa total de despesas divulgada se mantenha constante e que o **fundo** tenha rentabilidade bruta hipotética de 10% ao ano nos próximos 3 e 5 anos, o retorno após as despesas terem sido descontadas, considerando a mesma aplicação inicial de R\$ 1.000,00 (mil reais), é apresentado na tabela abaixo:

<b>Simulação das Despesas</b>	<b>+3 anos</b>	<b>+5 anos</b>
Saldo bruto acumulado (hipotético - rentabilidade bruta anual de 10%)	R\$ 1,331.00	R\$ 1,610.51
Despesas previstas (se a TAXA TOTAL DE DESPESAS se mantiver constante)	R\$ 42,03	R\$ 70,1
Retorno bruto hipotético após dedução das despesas e do valor do investimento original (antes da incidência de impostos, de taxas de ingresso e/ou saída, ou de taxa de performance)	R\$ 288,97	R\$ 540,41

Este exemplo tem a finalidade de facilitar a comparação do efeito das despesas no longo prazo. Esta simulação pode ser encontrada na lâmina e na demonstração de desempenho de outros fundos de investimento.

A simulação acima não implica promessa de que os valores reais ou esperados das despesas ou dos retornos serão iguais aos aqui apresentados.

## 10. **POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO**

O ADMINISTRADOR é o principal distribuidor das cotas do FUNDO e atua por meio dos seus canais de distribuição internos e externos, de acordo com o público alvo. 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.

A remuneração dos distribuidores é descontada da taxa de administração do fundo.

Não há conflito de interesses no esforço de venda.

#PRINCIPAL\_CONFLITO\_INTERESSE#



**BNP PARIBAS**

**11. SERVIÇO DE ATENDIMENTO AO COTISTA:**

- a. Telefone: (11) 3841-3157 E-mail: [atendimento.clientes.ifso@br.bnpparibas.com](mailto:atendimento.clientes.ifso@br.bnpparibas.com)  
Endereço: Avenida Presidente Juscelino Kubitschek, 1.909 - 9º andar – Torre Sul
- b. Página na rede mundial de computadores: [www.bnpparibas.com.br](http://www.bnpparibas.com.br)
- c. **Reclamações:** [ouvidoria@br.bnpparibas.com](mailto:ouvidoria@br.bnpparibas.com)

**12. SUPERVISÃO E FISCALIZAÇÃO:**

- a. Comissão de Valores Mobiliários – CVM
- b. Serviço de Atendimento ao Cidadão em [www.cvm.gov.br](http://www.cvm.gov.br).

Você poderá acessar a Ouvidoria pelo telefone – 0800-7715999 ou através do e-mail: [ouvidoria@br.bnpparibas.com](mailto:ouvidoria@br.bnpparibas.com). O horário de funcionamento da Ouvidoria é de segunda-feira a sexta-feira, das 08h00 às 18h00.

**INFORMAÇÕES IMPORTANTES:**

(1) Foram considerados na mensuração da escala de risco do fundo, os riscos de mercado, de liquidez, de crédito e de alavancagem, conforme exposição do FUNDO a estes, constante na política de investimento.

(2) A rentabilidade do fundo exposta no item 7, é calculada com base na cota do último dia útil do período de análise. No “Exemplo Comparativo”, este cálculo é realizado com base no primeiro dia útil.

(3) Caso o fundo e/ou o índice de referência apresente rentabilidade negativa, o desempenho percentual em relação ao índice de referência deve ser avaliado em conjunto com as variações individuais dos respectivos indicadores.



**BNP PARIBAS**

O campo referente ao "Limite de Alavancagem" desta Lâmina deverá ser lido como "Limite de Margem", em conformidade com o entendimento do Ofício-Circular nº 7/2023/CVM/SIN