



**BNP PARIBAS**

**LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS SOBRE O  
BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO AÇÕES**

**CNPJ/MF: 11.108.013/0001-03**

**Informações referentes a Setembro de 2024**

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o **BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO AÇÕES**, administrado por **BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.** e gerido por **BNP ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA.** 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:** Este Fundo é destinado a Investidores em Geral
2. **OBJETIVOS DO FUNDO:** Atuar no sentido de proporcionar a seus cotistas valorizações de suas cotas mediante aplicações de recursos financeiros em carteira diversificada, de ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda variável disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral, através de uma estratégia ativa de investimento a partir de análises fundamentalistas. A carteira do FUNDO deverá obedecer as diretrizes de diversificação de investimentos estabelecidas neste Regulamento e na regulamentação em vigor, bem como as vedações aplicáveis às Entidades Fechadas de Previdência Complementar e aos Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pela União, Estado, Distrito Federal e Municípios descritas no Regulamento.
3. **POLÍTICA DE INVESTIMENTOS:**
  - a. A carteira do FUNDO terá como objetivo de superar a variação do Índice BM&FBOVESPA Small Cap, apurado pelos preços de fechamento de Small Cap, apurado pelos preços de fechamento de mercado, calculado pela BM&FBOVESPA, sendo preponderantemente composta por ações de empresas que não estejam incluídas entre as maiores participações



do IBrX - Índice Brasil, ou seja, ações de empresas com relativa baixa e média capitalização de mercado.

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	100.00% 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\$ 1,000.00
Investimento adicional mínimo	R\$ 1,000.00
Resgate mínimo	R\$ 1,000.00
Horário para aplicação e resgate	15:30 (horário de Brasília)
Valor mínimo para permanência	R\$ 1,000.00
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 do 1º dia útil contado da data da aplicação. No resgate, o número de cotas canceladas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do 5º dia útil contado da data do pedido de resgate.
Pagamento dos resgates	O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é de 7 dias úteis contados da



	data do pedido de resgate.
Taxa de administração	2% a.a.
Taxa de entrada	Não há
Taxa de saída	Não há
Taxa de performance	20% sobre a rentabilidade da carteira líquida de taxa de administração e despesas que exceder à variação do Índice BM&FBOVESPA Small Cap ("SMLL")
Taxa total de despesas	As despesas pagas pelo fundo representaram 2.35% do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/10/2023 a 30/09/2024. 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\$ 141,937,506.90** e as 5 espécies de ativos em que ele concentra seus investimentos são:

Ações	98.33% do Patrimônio líquido
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	1.55% do Patrimônio líquido

6. **RISCO (1):** 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 (2)(3):**

- a. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.
- b. **Rentabilidade acumulada nos últimos 5 anos: -26.16%** no mesmo período o índice **SMLL** variou **-28.50%**. A tabela abaixo mostra a rentabilidade do fundo a cada ano nos



últimos 5 anos. Em 5 desses anos, o fundo perdeu parte do patrimônio que detinha no início do ano.

Ano	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Varição percentual do SMLL	Contribuição em relação ao SMLL (Rentabilidade do fundo - Rentabilidade do índice de referência)
2024	-11.29%	-13.67%	-78.91%
2023	14.44%	17.12%	-2.68%
2022	-12.10%	-15.06%	-75.57%
2021	-15.00%	-16.20%	-92.05%
2020	-2.65%	-0.65%	-175.32%

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

Mês	Rentabilidade do fundo (líquida de despesas, mas não de impostos)	Varição percentual do SMLL	Contribuição em relação ao SMLL (Rentabilidade do fundo - Rentabilidade do índice de referência)
Setembro	-2.03%	-4.41%	16.67%
Agosto	4.48%	4.51%	-0.03%
Julho	1.34%	1.49%	-0.15%
Junho	-0.31%	-0.39%	-73.06%
Mai	-4.69%	-3.38%	-127.83%
Abril	-8.85%	-7.76%	-112.36%
Março	2.97%	2.15%	0.82%
Fevereiro	0.63%	0.47%	0.16%
Janeiro	-4.71%	-6.55%	-60.84%
Dezembro	6.52%	7.05%	-0.53%
Novembro	11.05%	12.46%	-1.42%
Outubro	-7.30%	-7.40%	-98.69%
12 meses	-2.73%	-3.75%	-62.31%

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\$ 1,131.78 (hum mil e cento e trinta e um reais e setenta e oito centavos), já deduzidos impostos no valor de R\$ 23.26 (vinte e três reais e vinte e seis centavos).
- 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\$ 22.32 (vinte e dois reais e trinta e dois centavos).
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:

Simulação das Despesas	+3 anos	+5 anos
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\$ 66.95	R\$ 111.58
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\$ 264.05	R\$ 498.93

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 para os segmentos de investidores institucionais, 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.

O principal distribuidor não oferta, para o público alvo do fundo, preponderantemente fundos geridos por um único gestor, ou gestores ligados a um mesmo grupo econômico.

Não há conflito de interesses no esforço de venda.

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

- a. Telefone: 11 3049-2820
- b. Página na rede mundial de computadores: [www.bnpparibas.com.br](http://www.bnpparibas.com.br)
- c. **Reclamações:** [mesadeatendimento@br.bnpparibas.com](mailto:mesadeatendimento@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. Consideramos também a categoria à qual o fundo pertence. Adicionalmente ressaltamos que o risco informado não leva em conta o risco do FUNDO em relação a outros fundos equivalentes disponíveis no mercado, nem eventos econômicos atípicos que possam impactar a rentabilidade do FUNDO.

(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.

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