

**Competência** 10/02/2016 ▾ Exibir

**Nome do Fundo** BNP PARIBAS MATCH DI FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO

**CNPJ do Fundo** 09.636.393/0001-07

**Tipo do Fundo** FDOS DE INVESTIMENTO

**Cód. CVM** 114650

**Administrador** BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A

**CNPJ do Administrador** 01.522.368/0001-82

### Formulário de Informações Complementares

**Informações Complementares de código:**  
2993

**CNPJ do fundo:**  
09.636.393/0001-07

**Periodicidade mínima para divulgação da composição da carteira do fundo:**  
Mensalmente, até 10 (dez) dias após o encerramento do mês a que se referir.

#### Local, Meio ou forma de divulgação

**Tipo do meio de divulgação:** eletrônico

**Descrição do local de divulgação:**  
Site do ADMINISTRADOR ([www.bnpparibas.com.br](http://www.bnpparibas.com.br))

**Descrição da forma de Divulgação:**  
Disponibilizada no site do ADMINISTRADOR

#### Local, Meio ou forma de divulgação cotista

**Tipo do meio de divulgação:** Eletrônico

**Descrição de texto enviada pela instituição:**  
ADMINISTRADOR

**Descrição do local de divulgação**  
[mesadeatendimento@br.bnpparibas.com](mailto:mesadeatendimento@br.bnpparibas.com)

**Descrição da forma de divulgação**  
(11) 3049-2820 / [mesadeatendimento@br.bnpparibas.com](mailto:mesadeatendimento@br.bnpparibas.com)

**Exposição, em ordem de relevância, dos fatores de riscos inerentes à composição da carteira do fundo**

Variação de Taxa de Juros: o principal fator de risco é a variação de taxas de juros Mercado: variação dos preços dos ativos decorrente das condições de mercado quando de sua negociação Crédito: inadimplência por parte das contrapartes e dos emissores dos títulos componentes da carteira Liquidez: impossibilidade de efetuar pagamentos de resgates dentro do prazo estabelecido no regulamento Concentração: a concentração em ativos de poucos emissores ou em determinadas modalidades de ativos potencializa o risco de inadimplemento Restrição de Negociação: restrições de negociação dos ativos financeiros por parte das bolsas de valores e de mercadorias e futuros ou de órgãos reguladores, por conta do volume das operações, participação no volume de negócios e oscilações máximas de preços, entre outras Precificação: a precificação dos ativos financeiros utiliza critérios e procedimentos para registro e avaliação que poderão ocasionar variações nos valores Cambial: condições econômicas nacionais e internacionais podem afetar o mercado e resultar em alterações nas taxas de juros e câmbio 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 Derivativos: a realização de operações no mercado de derivativos poderá acarretar variações no valor do patrimônio líquido do FUNDO Enquadramento Fiscal: alteração da regra tributária, criação de novos tributos, interpretação diversa da atual sobre a incidência de quaisquer tributos ou, ainda, da revogação de isenções vigentes

**Informações Políticas sobre o gestor**

**Informar se o gestor vota ou não em assembleias dos ativos que compõem a carteira:** Sim

**Descrição da política relativa ao exercício de direito do 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 [www.bnpparibas.com.br](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.

**Descrição da tributação aplicável ao fundo e a seus cotistas, contemplando a política a ser adotada pelo administrador quanto ao tratamento tributário perseguido**

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 FUNDOS: 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

### **Descrição da política de administração de risco, em especial dos métodos utilizados pelo administrador para gerenciar os riscos a que o fundo se encontra sujeito, inclusive risco de liquidez**

O ADMINISTRADOR e a GESTORA possuem Comitês de Risco por meio dos quais é definida uma carteira-modelo para os objetivos de performance, política de investimento e 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), VAR (Value at Risk) e Tracking Error para a parcela de Renda Variável. 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 BMF, 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 (VAR Value at Risk). O tracking error em relação ao benchmark é calculado através de modelo multifatorial que permite a identificação das principais fontes de risco. 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.

### **Informações de Risco**

#### **Informação se existe ou não agência de classificação de rating**

Não

#### **CNPJ**

#### **Nome do Prestador**

## **Classificação obtida pela agência de classificação de risco de crédito contratada**

### **Padronização do disclaimer relativo a advertência da manutenção do serviço pela CVM**

#### **Detalhamento do administrador**

##### **Apresentação do administrador**

Razão Social: BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. CNPJ: 01.522.368/0001-82 Endereço: Av. Presidente Juscelino Kubitschek, nº 510, 1º, 10º a 14º andares, Itaim Bibi, São Paulo/SP 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. Em 10 de dezembro de 2008, a Standard Poor's Rating Services, atribuiu em sua escala nacional o rating de crédito de contraparte 'brAAA' ao Banco BNP Paribas Brasil S.A. 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.

##### **Apresentação do gestor de recursos**

Razão Social: BNP Paribas Asset Management Brasil Ltda. CNPJ: 02.562.663/0001-25 Endereço: Av. Presidente Juscelino Kubitschek, nº 510, 14º andar, Itaim Bibi, São Paulo/SP 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.

## Detalhamento do Serviço Prestado

**Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41:**Custodiante

**Nome do Prestador:**

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

## Detalhamento de Distribuição

**Indicação se o distribuidor oferta para o público alvo do fundo, preponderantemente, fundos geridos por um único gestor ou por gestoras ligadas a um mesmo grupo econômico:** Sim

**Descrição detalhada**

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, podendo o ADMINISTRADOR contratar terceiros para prestar os referidos serviços, sob responsabilidade do ADMINISTRADOR. O ADMINISTRADOR atua por meio dos seus canais de distribuição internos para os segmentos de clientes de acordo com o público alvo do FUNDO. 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, a GESTORA e o Distribuidor, se for o caso, 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. O ADMINISTRADOR remunera o Distribuidor por meio de uma percentagem incidente sobre os recursos efetivamente captados por intermédio do Distribuidor, calculada sobre o montante pago pelo FUNDO a título de administração e performance, se houver.

## Outras Informações

**Informações sobre autorregulação anbima:**

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA: Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento. DESCRIÇÃO DO TIPO ANBIMA: Fundos que investem em ativos de renda fixa com duration média ponderada da carteira inferior a 21 dias úteis. Estes fundos buscam minimizar a oscilação nos retornos promovida por alterações nas taxas de juros futuros. Também estão nesta categoria os fundos que buscam retorno por meio de ativos de renda fixa remunerados à taxa flutuante em CDI ou Selic. Fundos que possuírem ativos no exterior deverão realizar o hedge cambial da parcela investida no exterior. Fundos que investem no mínimo 80% da carteira em títulos públicos federais, ativos com baixo risco de crédito do mercado doméstico ou externo, ou sintetizados via derivativos, com registro das câmaras de compensação. ESTE FORMULÁRIO FOI PREPARADO COM AS INFORMAÇÕES NECESSÁRIAS AO ATENDIMENTO DAS DISPOSIÇÕES DO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO, BEM COMO DAS NORMAS EMANADAS PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS. A AUTORIZAÇÃO PARA FUNCIONAMENTO E/OU VENDA DAS COTAS DESTA 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.

### **Demais informações relevantes ao investidor**

O ADMINISTRADOR deve divulgar através de correspondência aos cotistas, comunicado na página da CVM e manter na sua página na internet, ato ou fato relevante ocorrido ou relacionado ao funcionamento do FUNDO ou aos ativos integrantes de sua carteira. O ADMINISTRADOR deve remeter: informe diário; balancete; demonstrativo da composição e diversificação da carteira; perfil mensal; Lâmina de Informações Essenciais; Formulário de Informações Complementares, demonstrações contábeis do FUNDO, de acordo com os prazos da legislação. Compete à Assembleia deliberar sobre: demonstrações contábeis; substituição do ADMINISTRADOR, GESTORA, Custodiante; fusão, incorporação, cisão, transformação, liquidação, aumento da taxa de administração, performance, taxa máxima de custódia, alteração da política de investimento e regulamento, amortização e resgate compulsório de cotas, quando não previsto no Regulamento. O regulamento do FUNDO pode ser alterado, independentemente da Assembleia para: a) atendimento a exigências da CVM de adequação a normas; b) atualização dos dados cadastrais do ADMINISTRADOR e prestadores de serviços; c) redução da taxa de administração e de performance. As alterações devem ser comunicadas aos cotistas em até 30 dias da implementação, sendo que o item "c" deve ser comunicado imediatamente. A convocação da Assembleia será feita por correspondência aos cotistas em no mínimo 10 dias de antecedência da data de sua realização, com dia, hora e local em que será realizada. A presença de todos os cotistas supre a falta de convocação e dispensa o envio do resumo das deliberações. O ADMINISTRADOR, Custodiante, GESTORA ou cotistas que detenham no mínimo 5% das cotas emitidas, poderão convocar Assembleia para deliberar sobre os interesses do FUNDO e dos cotistas. A convocação será enviada ao ADMINISTRADOR, que em até 30 dias, convocará Assembleia às expensas dos requerentes, salvo se a Assembleia Geral convocada deliberar em contrário. As deliberações serão tomadas por maioria de votos, cabendo a cada cota 1 voto. Votam na Assembleia os cotistas inscritos no registro de cotistas na data da convocação, representantes legais e procuradores legalmente constituídos há menos de 1 ano. Todos poderão votar por meio eletrônico, desde que recebida pelo ADMINISTRADOR antes do início da Assembleia. Não podem votar nas Assembleias do FUNDO: ADMINISTRADOR, GESTORA, empresas ligadas a eles, prestadores de serviços do FUNDO e sócios, diretores e funcionários do ADMINISTRADOR, GESTORA e prestadores de serviço, exceto se eles forem os únicos cotistas e se houver aquiescência expressa da maioria dos cotistas presentes a Assembleia. O resumo das decisões da Assembleia deverá ser enviado a cada cotista em até 30 dias após a sua realização, podendo ser utilizado para tal finalidade o extrato de conta. As deliberações relativas às demonstrações contábeis do FUNDO que não contiverem ressalvas podem ser consideradas automaticamente aprovadas caso a assembleia correspondente não seja instalada pelo não comparecimento dos cotistas. No caso de fechamento dos mercados, casos excepcionais de iliquidez dos ativos financeiros da carteira do FUNDO em decorrência de pedidos de resgates incompatíveis com a liquidez existente ou que possam implicar alteração do tratamento tributário do FUNDO ou dos cotistas, o ADMINISTRADOR pode declarar o fechamento do FUNDO para resgates e o ADMINISTRADOR deverá divulgar imediatamente fato relevante por ocasião do fechamento e reabertura do FUNDO. Caso o FUNDO fique fechado por período superior a 5 dias,

o ADMINISTRADOR, além da divulgação de fato relevante por ocasião do fechamento, convocará, no prazo máximo de 1 dia, para realização em até 15, assembleia para deliberar sobre as seguintes possibilidades: substituição do ADMINISTRADOR, da GESTORA ou ambos; reabertura ou manutenção do fechamento do FUNDO para resgate; possibilidade do pagamento de resgate em ativos financeiros; cisão do FUNDO; liquidação do FUNDO.