

Competência	16/03/2017 ▾	Exibir
Nome do Fundo	BNP PARIBAS SOBERANO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - SIMPLES	
CNPJ do Fundo	09.636.619/0001-61	
Tipo do Fundo	FDOS DE INVESTIMENTO	
Cód. CVM	115908	
Administrador	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A	
CNPJ do Administrador	01.522.368/0001-82	

Formulário de Informações Complementares

Informações Complementares de código:
19575

CNPJ do fundo:
09.636.619/0001-61

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)

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

Descrição da forma de divulgação
(11) 3049-2820 / mesadeatendimento@br.bnpparibas.com

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

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.

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 <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

O FUNDO buscará manter sua carteira com prazo médio superior a 365 dias e NÃO HAVERÁ GARANTIA DE QUE O FUNDO TERÁ O TRATAMENTO TRIBUTÁRIO PARA FUNDOS LONGO PRAZO. Os rendimentos dos cotistas estão sujeitos ao IR Retido na Fonte: I-Come Cotas: Os rendimentos apropriados semestralmente, no último dia útil dos meses de maio e novembro de cada ano serão tributados à alíquota de 15% e no resgate das cotas, será aplicada alíquota complementar, de acordo com o item II. II-IR no Resgate:O rendimento produzido sofrerá a incidência do IR às alíquotas de: a)22,5% nos resgates feitos até 180 dias da aplicação; b)20% nos resgates feitos após 180 dias até 360 dias da aplicação; c)17,5% nos resgates feitos após 360 dias até 720 dias da aplicação; e d)15% nos resgates feitos após 720 dias da aplicação. III-IOF: Os resgates feitos antes de 30 dias da data aplicação estão sujeitos à tributação à alíquota de 1% ao dia sobre o valor de resgate limitado ao rendimento da operação em função do prazo. Caso o FUNDO se torne Curto Prazo, durante seu período de funcionamento, em função da composição dos Ativos Financeiros de sua carteira, o prazo médio da Carteira é inferior a 365 dias.Os rendimentos obtidos pelos cotistas estão sujeitos ao IR na Fonte de acordo com o Regime

Tributário e prazo de permanência no FUNDO :I-Come Cotas: Os rendimentos apropriados semestralmente, no último dia útil dos meses de maio e novembro de cada ano, serão tributados à alíquota de 20% e no resgate das cotas, será aplicada alíquota complementar de acordo com o item "a". II-IR no Resgate: O rendimento produzido terá a incidência do IR às alíquotas de: a)22,5% nos resgates feitos até 180 dias da data da aplicação; b)20% nos resgates feitos após 180 dias. Os valores adiantados quando da ocorrência dos come-cotas semestrais serão descontados para fins de determinação do montante a ser efetivamente recolhido aos cofres públicos. III-IOF: Os resgates feitos antes de 30 dias da data da aplicação estão sujeitos à alíquota de 1% ao dia sobre o valor de resgate, limitado ao rendimento da operação, em função do prazo. Tributação aplicável ao FUNDO:A carteira do FUNDO não está sujeita à incidência de IR e IOF. Se o FUNDO aplicar em ativos financeiros em mercado externo serão observadas as normas tributárias daquele País.

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 nos quais define, 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 medidas: (a) perda esperada em cenários de stress (Stress testing), VR (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 (VR - 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. 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.

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, São Paulo/SP Autorização para Administrar Carteira de Títulos e Valores Imobiliários: 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.

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, cujo controlador majoritário é o Banco BNP Paribas Brasil S.A, 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 Investimentos: 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 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. 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.

Outras Informações

Informações sobre autorregulação anbima:

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA: Renda Fixa Simples DESCRIÇÃO DO TIPO ANBIMA: Fundos que devem possuir 95% (noventa e cinco por cento) , no mínimo, de seu patrimônio líquido em títulos de dívida pública federal. 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 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 DESTA 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

Aplicação Inicial Mínima: R\$ 25.000,00 Movimentação Mínima: R\$ 5.000,00 Saldo Mínimo: R\$ 5.000,00 Horário Limite de Mov. : 17horas