



BNP PARIBAS MATCH DI FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO: AGOSTO/2020

Renda Fixa

CARACTERÍSTICAS GERAIS

CNPJ: 09.636.393/0001-07
Renda Fixa Duração Baixa
ANBIMA Grau de Invest. (Cód.: 217018)
Público Alvo: Investidores em Geral
Regime de Cotas: Abertura
Início das Atividades: 16/09/2008

Tx. de Administração: 0,35% a.a.
Tx. de Performance: Não há
Tx. de Entrada / Saída: Não há

Aplicação: D+0
Resgate (Conv./Pgto): D+0 / D+0
Horário de Mov.: 16h00min
Aplicação Inicial: R\$ 50.000
Movimentação: R\$ 5.000
Saldo Mínimo: R\$ 5.000
Tributação: Busca Longo Prazo

Gestão: BNP Paribas Asset Management
Administração: Banco BNP Paribas
Custódia: Banco BNP Paribas
Distribuição: Banco BNP Paribas

LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES
COMPLEMENTARES E O REGULAMENTO ANTES DE
INVESTIR

OBJETIVO E POLÍTICA DE INVESTIMENTO DO FUNDO

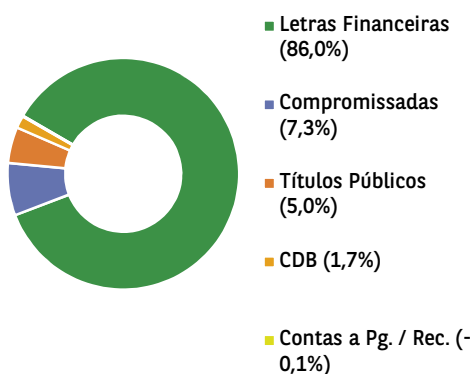
Acompanhar a variação do CDI, investindo majoritariamente e seletivamente em títulos de renda fixa de emissão de instituições financeiras atrelados direta ou indiretamente ao CDI.

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

Período	2019 (%)			2020 (%)		
	Fundo	CDI	% CDI	Fundo	CDI	% CDI
Janeiro	0,50	0,54	92,93	0,36	0,38	95,38
Fevereiro	0,48	0,49	96,50	0,28	0,29	95,39
Março	0,46	0,47	98,86	0,23	0,34	67,72
Abril	0,51	0,52	99,19	-0,15	0,28	
Maio	0,53	0,54	97,17	0,17	0,24	71,11
Junho	0,45	0,47	95,57	-0,01	0,22	
Julho	0,60	0,57	104,84	0,14	0,19	74,60
Agosto	0,50	0,50	98,78	0,04	0,16	26,37
Setembro	0,45	0,47	96,54			
Outubro	0,47	0,48	97,04			
Novembro	0,30	0,38	78,08			
Dezembro	0,29	0,38	75,87			
Acum. Ano	5,67	5,97	94,97	1,07	2,12	50,13

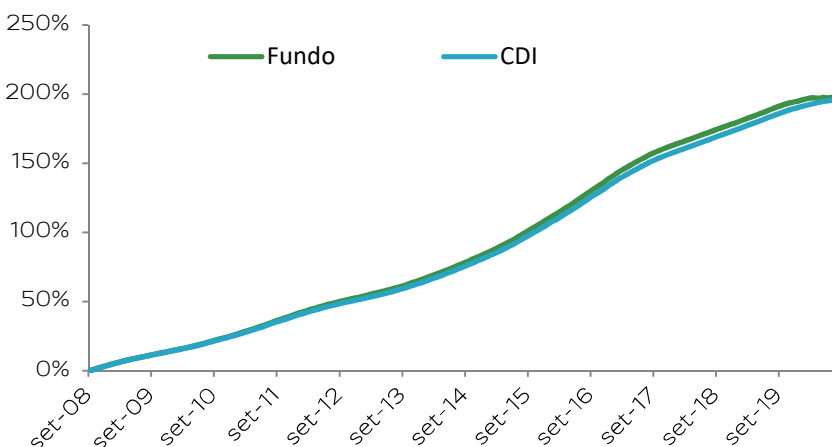
Período	Fundo	CDI	% CDI
Últimos 12 Meses	2,59	3,88	66,79
Últimos 24 Meses	8,87	10,40	85,33
Últimos 36 Meses	16,12	17,95	89,81
Desde o início	198,19	196,68	100,77

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA



RENTABILIDADE ACUMULADA ATÉ

31/08/2020



Para Investir: São Paulo Rio de Janeiro Curitiba Belo Horizonte

Pessoas Físicas 11 3841-3130 21 3094-8200 41 3099-7250 31 3254-1250
Inv. Institucionais 11 3049-2820



BNP PARIBAS MATCH DI FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO: AGOSTO/2020

Renda Fixa

INDICADORES FINANCEIROS

Patrimônio Líq. (PL) em 31/08/2020* 933.553
 PL Médio 12 Meses* 1.389.638
 *R\$ - Mil

Maior Rentabilidade Mensal 1,25%
 Menor Rentabilidade Mensal -0,15%

Meses acima do CDI 103
 Meses abaixo do CDI 41

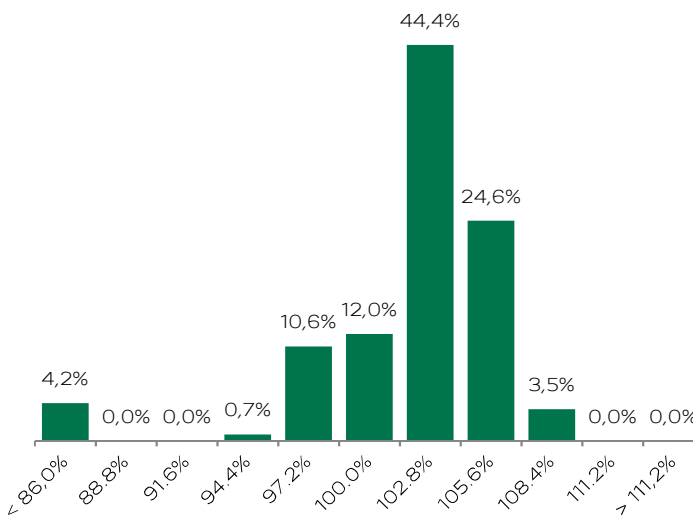
Volatilidade (% a.a.)* 0,38%

*Representa o desvio padrão anualizado dos retornos diários do fundo, com período de análise de 252 dias úteis.

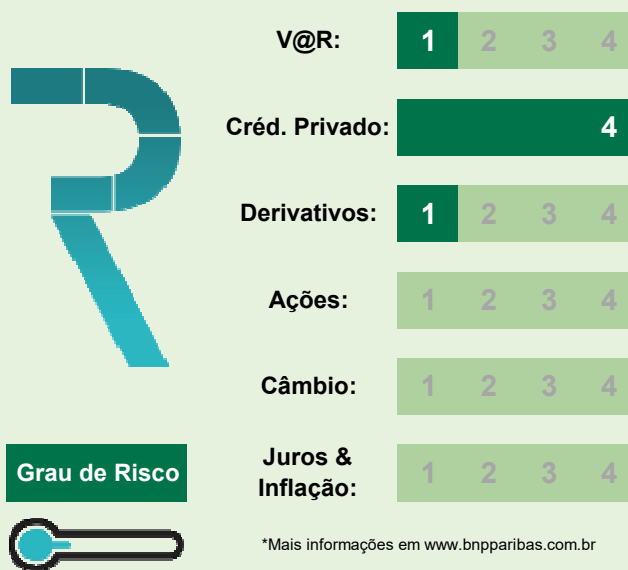
CONCENTRAÇÃO EM CRÉDITOS PRIVADOS

Este fundo está sujeito a risco de perda substancial de seu patrimônio líquido em caso de eventos que acarretem o não pagamento dos ativos integrante de sua carteira, inclusive por força de intervenção, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial dos emissores responsáveis pelos ativos do fundo.

DISTRIBUIÇÃO DOS RETORNOS MENSIS RELATIVOS AO CDI (FREQUÊNCIA)



CONHEÇA O RISCO DO PRODUTO*



BNP PARIBAS
 ASSET MANAGEMENT

The asset manager for a changing world

Este documento foi produzido pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A. ou por suas empresas subsidiárias, coligadas e controladas, em conjunto denominadas "BNP Paribas", com fins meramente informativos não se caracterizando como oferta ou solicitação de investimento ou desinvestimento de ativos. O BNP Paribas é uma instituição financeira regularmente constituída, com seu funcionamento devidamente autorizado pelo Banco Central do Brasil e habilitada pela Comissão de Valores Mobiliários para Administrar fundos de investimento. Apesar do cuidado na obtenção e manuseio das informações apresentadas, o BNP Paribas não se responsabiliza pela publicação acidental de informações incorretas, nem tampouco por decisões de investimento tomadas com base nas informações contidas neste documento, as quais podem sofrer mudanças a qualquer momento sem aviso prévio. LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. Descrição do tipo ANBIMA disponível no formulário de informações complementares. Antes de qualquer decisão de investimento, é obrigatório certificar-se sobre o seu perfil de risco X perfil de risco do produto pretendido, nos termos da regulamentação em vigor. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos, porém já é líquida de taxas de administração e outros custos pertinentes ao fundo. Para avaliação da performance de fundos de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, doze meses; Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador, do Gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou do Fundo Garantidor de Crédito - FGC. Este fundo utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais aos seus cotistas. Este fundo poderá adquirir títulos de emissores privados, em montante superior a 50% (cinquenta por cento) de seu patrimônio líquido e, portanto, estará sujeito a risco de perdas substanciais em caso de eventos que acarretem o não pagamento dos ativos integrantes de sua carteira, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial dos emissores responsáveis pelos ativos do fundo. IMPORTANTE: A notação gráfica dos diversos riscos assumidos pelo fundo é uma forma meramente ilustrativa que não deve servir como indicação para tomada de decisão de investimento ou desinvestimento. Para tanto é recomendada a leitura, análise e entendimento do Regulamento do fundo. As escalas refletem a visão da gestora baseada na Política de Investimento do fundo podendo além de ser dinâmica não refletir diretamente as alocações ocorridas no fundo ao longo do tempo. Adicionalmente informamos que esta notação é propriedade intelectual da BNP Paribas Asset Management Brasil Ltda., não devendo ser usada por outro gestor ou administrador de recursos. Você poderá acessar a Ouvidoria pelo telefone – 0800-7715999 ou através do e-mail: ouvidoria@br.bnpparibas.com. O horário de funcionamento da Ouvidoria é de segunda-feira à sexta-feira, das 09h às 18h. A lâmina de informações essenciais BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO encontra-se no site www.bnpparibas.com.br.



BNP PARIBAS

**LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS SOBRE O
BNP PARIBAS MATCH DI FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO -
CRÉDITO PRIVADO**

CNPJ/MF: 09.636.393/0001-07

Informações referentes a Agosto de 2020

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o **BNP PARIBAS MATCH DI FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO - CRÉDITO PRIVADO**, 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. 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:** O fundo é destinado a investidores em geral.
2. **OBJETIVOS DO FUNDO:** O fundo tem por objetivo acompanhar a variação do CDI. Embora a Gestora empregue toda a sua diligência e técnica no sentido de atingir este objetivo, não há garantia de que o desempenho do fundo supere continuamente o CDI. O **FUNDO** é um “Fundo Referenciado”, tendo como indicador de desempenho o CDI.
3. **POLÍTICA DE INVESTIMENTOS:**
 - a. Mínimo de 95% do PL do **FUNDO** deve ser investido em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa que acompanham, direta ou indiretamente, a variação do indicador de desempenho (“benchmark”) expresso na denominação do **FUNDO**. Adicionalmente, no mínimo 80% PL deve ser aplicado em: (i) títulos da dívida pública federal; (ii) ativos financeiros de renda fixa considerados de baixo risco de crédito pelo gestor; e (iii) cotas de fundos de índice que invistam preponderantemente nos ativos das



alíneas "i" e "ii" acima e utilizem instrumentos derivativos apenas para proteção da carteira (hedge).

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 até o limite de	10,00% do Patrimônio líquido
Utiliza derivativos apenas para proteção da carteira?	Sim
Alavancar-se até o limite de (i)	0,00% 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\$ 50.000,00
Investimento adicional mínimo	R\$ 5.000,00
Resgate mínimo	R\$ 5.000,00
Horário para aplicação e resgate	16:00 (horário de Brasília)
Valor mínimo para permanência	R\$ 5.000,00
Período de carência	Não há
Conversão das cotas	Na aplicação, o número de cotas compradas será calculado de acordo com o valor das cotas na abertura da data da aplicação. No resgate, o número de cotas canceladas será calculado de acordo com o valor das cotas na abertura da data do pedido de resgate.
Pagamento dos resgates	O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é a mesma data do pedido de



	resgate.
Taxa de administração	0,35% a.a.
Taxa de entrada	Não há
Taxa de saída	Não há
Taxa de performance	Não há
Taxa total de despesas	As despesas pagas pelo fundo representaram 0,36% do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/09/2019 a 31/08/2020. 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 www.bnpparibas.com.br

5. **COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA:** o patrimônio líquido do fundo é de **R\$ 933.552.852,60** e as 5 espécies de ativos em que ele concentra seus investimentos são:

Depósitos a prazo e outros títulos de instituições financeiras	69,29% do Patrimônio líquido
Outras aplicações	18,42% do Patrimônio líquido
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	7,33% do Patrimônio líquido
Títulos públicos federais	5,04% 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):**

a. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.



- b. **Rentabilidade acumulada nos últimos 5 anos: 42,51%** no mesmo período o índice CDI variou **44,36%**. A tabela abaixo mostra a rentabilidade do **fundo** a cada ano nos últimos 5 anos.

Ano	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Varição percentual do CDI	Desempenho do fundo como % do CDI
2020	1,07%	2,12%	50,13%
2019	5,67%	5,97%	94,97%
2018	6,21%	6,42%	96,69%
2017	10,00%	9,95%	100,46%
2016	14,22%	14,00%	101,58%

- 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 CDI	Desempenho do fundo como % do CDI
Agosto	0,04%	0,16%	26,37%
Julho	0,14%	0,19%	74,60%
Junho	-0,01%	0,22%	-6,34%
Mai	0,17%	0,24%	71,11%
Abril	-0,15%	0,28%	-53,69%
Março	0,23%	0,34%	67,72%
Fevereiro	0,28%	0,29%	95,39%
Janeiro	0,36%	0,38%	95,38%
Dezembro	0,29%	0,38%	75,87%
Novembro	0,30%	0,38%	78,08%
Outubro	0,47%	0,48%	97,04%
Setembro	0,45%	0,47%	96,54%
12 meses	2,59%	3,88%	66,79%

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 2019 e não houvesse realizado outras aplicações, nem solicitado resgates durante o ano,



no primeiro dia útil de 2020, você poderia resgatar R\$ 1.046,70, já deduzidos impostos no valor de R\$ 9,91.

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\$ 3,67.

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\$ 11,02	R\$ 18,37
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\$ 319,98	R\$ 592,14

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,



BNP PARIBAS

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
- c. **Reclamações:** 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.

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

12. 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.



BNP PARIBAS

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.