



BNP PARIBAS SOBERANO FIC DE FI RENDA FIXA - SIMPLES

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO: AGOSTO/2020

Renda Fixa

CARACTERÍSTICAS GERAIS

CNPJ: 09.636.619/0001-61
Renda Fixa Simples (Cód.:
ANBIMA 218111)
Público Alvo: Investidores em Geral
Regime de Cotas: Abertura
Início das Atividades: 10/10/2008

Tx. de Administração: 0,22% a.a.
Tx. de Adm. Máx.: 0,24% a.a.
Tx. de Perf. / Entr. / Saída: Não há

Aplicação: D+0
Resgate (Conv./Pgto): D+0 / D+0
Horário de Mov.: 17h00min
Aplicação Inicial: R\$ 1.000
Movimentação: R\$ 200
Saldo Mínimo: Não há
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

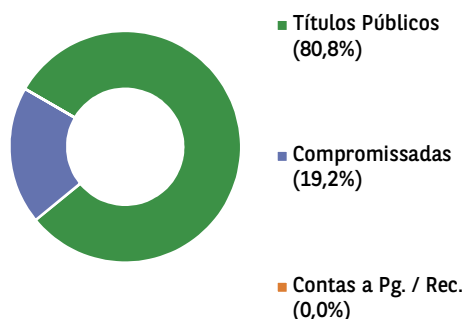
O fundo tem por objetivo acompanhar a variação do Selic investindo no mínimo 95% de sua carteira em cotas do BNP Paribas Master Cash DI FI Referenciado, que investe, exclusivamente, em títulos públicos federais de emissão do Tesouro Nacional e/ou Banco Central do Brasil, pre-fixados ou indexados à variação do CDI, ou, ainda, por operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais.

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

Período	2019 (%)			2020 (%)		
	Fundo	Selic	% Selic	Fundo	Selic	% Selic
Janeiro	0,52	0,54	95,83	0,35	0,38	91,68
Fevereiro	0,47	0,49	94,24	0,26	0,29	89,08
Março	0,45	0,47	95,40	0,31	0,34	91,26
Abril	0,49	0,52	95,44	0,25	0,28	88,05
Maio	0,52	0,54	95,06	0,21	0,24	89,78
Junho	0,45	0,47	95,21	0,19	0,21	88,40
Julho	0,54	0,57	95,10	0,16	0,19	84,81
Agosto	0,48	0,50	94,92	0,13	0,16	83,35
Setembro	0,44	0,46	94,86			
Outubro	0,45	0,48	94,01			
Novembro	0,36	0,38	93,59			
Dezembro	0,35	0,37	93,00			
Acum. Ano	5,65	5,96	94,66	1,88	2,12	88,85

Período	Fundo	Selic	% Selic
Últimos 12 Meses	3,52	3,86	91,03
Últimos 24 Meses	9,68	10,38	93,23
Últimos 36 Meses	16,81	17,94	93,69
Desde o início	186,86	195,37	95,64

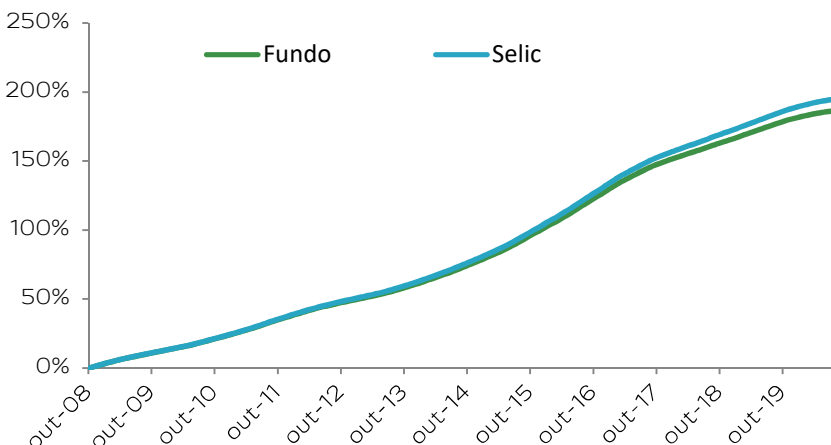
COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA*



*Do fundo BNP Paribas Master Cash DI FI Referenciado.

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 SOBERANO FIC DE FI RENDA FIXA - SIMPLES

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO: AGOSTO/2020

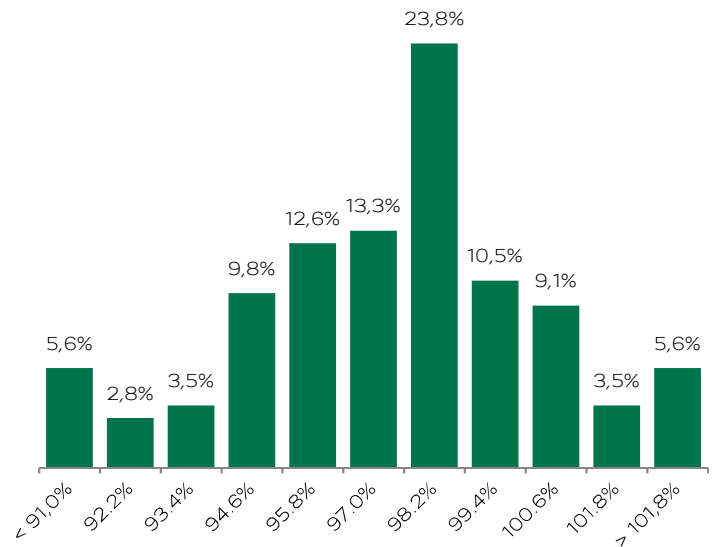
Renda Fixa

INDICADORES FINANCEIROS

Patrimônio Líq. em 31/08/2020*	919.014
PL Médio 12 Meses*	647.119
*R\$ - Mil	
Rentabilidade Máxima Mensal	1,18%
Rentabilidade Mínima Mensal	0,13%
Meses acima do Selic	19
Meses abaixo do Selic	124
Volatilidade (% a.a.)*	0,07%

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

DISTRIBUIÇÃO DOS RETORNOS MENSIS RELATIVOS AO CDI (FREQUÊNCIA)



CONHEÇA O RISCO DO PRODUTO*



Grau de Risco



V@R: 1 2 3 4

Créd. Privado: 1 2 3 4

Derivativos: 1 2 3 4

Ações: 1 2 3 4

Câmbio: 1 2 3 4

Juros & Inflação: 1 2 3 4

*Mais informações em www.bnpparibas.com.br



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" e tem fins meramente informativos, não se caracterizando como oferta ou recomendação de investimento ou desinvestimento. 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 investe em fundos que utilizam 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. 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 SOBERANO DI FIC DE FI REFERENCIADO encontra-se no site www.bnpparibas.com.br.



BNP PARIBAS

**LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS SOBRE O
BNP PARIBAS SOBERANO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE
INVESTIMENTO RENDA FIXA - SIMPLES**

CNPJ/MF: 09.636.619/0001-61

Informações referentes a Agosto de 2020

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o **BNP PARIBAS SOBERANO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - SIMPLES**, 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:** Proporcionar a seus cotistas valorizações de suas cotas mediante aplicações de recursos financeiros em títulos públicos federais de emissão do Tesouro Nacional e/ou Banco Central do Brasil, pre-fixados ou indexados à variação do CDI, ou, ainda, por operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais.
3. **POLÍTICA DE INVESTIMENTOS:**
 - a. A política de investimento do fundo é investir, no mínimo, 95% de seu patrimônio líquido em cotas de fundos de investimento ("Fundos Investidos"), especificamente em cotas do BNP Paribas Master Cash Fundo de Investimento Renda Fixa Referenciado DI, inscrito no CNPJ/MF sob n.º 14.167.491/0001-74 ("Master Cash FI RF").
 - b. Este fundo aplica em fundos que podem:



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 até o limite de	100,00% do Patrimônio líquido
Utiliza derivativos apenas para proteção da carteira?	Sim
Alavancar-se até o limite de	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. Este fundo de investimento em cotas de fundos de investimento não realiza depósito de margem de garantia junto às centrais depositárias, mas pode investir em fundos de investimento que podem estar expostos aos riscos decorrentes de aplicações em ativos que incorram em depósito de margem de garantia. As informações apresentadas são provenientes dos fundos investidos geridos por instituições ligadas.
- 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\$ 200,00
Resgate mínimo	R\$ 200,00
Horário para aplicação e resgate	17:00 (horário de Brasília)
Valor mínimo para permanência	Não há
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	A taxa mínima de Administração é de 0,22% a.a e a taxa Máxima de Administração é de 0,24%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 0,27% 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\$ 919.013.745,97** e as 5 espécies de ativos em que os fundos investidos concentram seus investimentos são:

Títulos públicos federais	80,78% do Patrimônio líquido
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	19,24% 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: 42,12%** no mesmo período o índice SELIC variou **44,42%**. 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 SELIC	Desempenho do fundo como % do SELIC
2020	1,88%	2,12%	88,43%
2019	5,65%	5,97%	94,59%
2018	6,07%	6,43%	94,35%
2017	9,63%	9,97%	96,59%
2016	13,56%	14,02%	96,71%

- 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 SELIC	Desempenho do fundo como % do SELIC
Agosto	0,13%	0,16%	82,85%
Julho	0,16%	0,19%	84,81%
Junho	0,19%	0,22%	87,21%
Mai	0,21%	0,24%	88,70%
Abril	0,25%	0,28%	88,05%
Março	0,31%	0,34%	90,74%
Fevereiro	0,26%	0,29%	88,79%
Janeiro	0,35%	0,38%	91,68%
Dezembro	0,35%	0,38%	92,53%
Novembro	0,36%	0,38%	93,59%
Outubro	0,45%	0,48%	94,23%
Setembro	0,44%	0,47%	94,56%
12 meses	3,52%	3,88%	90,74%

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\$ 1.056,37 (hum mil e cinquenta e seis reais e trinta e sete centavos), já deduzidos impostos no valor de R\$ 9,86.

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\$ 2,68 (dois reais e sessenta e oito 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\$ 8,03	R\$ 13,39
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\$ 322,97	R\$ 597,12

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.

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



BNP PARIBAS

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.