

BNP PARIBAS FIC FI INFRA DEBÊNTURES INCENTIVADAS RF IS

Renda Fixa

31/05/2024

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: **38.443.033/0001-89**
 ANBIMA: **Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre**
 Público Alvo: **Somente Pessoas Físicas**
 Regime de Cotas: **Fechamento**
 Data de Início: **17/02/2021***
 *O FUNDO INVESTIDO iniciou em 29/12/2016
 Código ANBIMA **576859**
 ISIN code **BR07ESCTF009**
 Mnemônico **-**
 Conta CETIP **-**

Tx. de Adm/ Tx. Max: **0,98% a.a./1,00% a.a.**
 Tx. de Performance: **Não há**
 Tx. de Entrada / Saída: **Não há**

Aplicação: **D+0**
 Resgate (Conv./Pgto): **D+29 / D+30 (d.c.)**
 Horário de Mov.: **15h30min**
 Aplicação Inicial: **R\$ 500**
 Movimentação: **R\$ 500**
 Saldo Mínimo: **R\$ 500**
 Tributação: **Busca Longo Prazo**

Administração: **Banco BNP Paribas**
 Custódia: **Banco BNP Paribas**

OBJETIVOS DO FUNDO

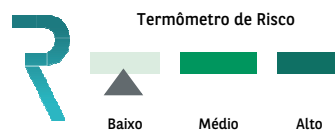
O Fundo tem por objetivo sustentável a mitigação das mudanças climáticas investindo, seguindo a estratégia de sustentabilidade da Gestora. O Fundo investe, no mínimo, 95% de seu Patrimônio Líquido no fundo BNPP Master Infra Fundo de Investimento Incentivado Sustentável (CNPJ. 25.108.905/0001-00), cuja carteira é composta predominantemente por debêntures de infraestrutura que atendam aos critérios de elegibilidade previstos na Lei 12.431/2011* ("Ativos de Infraestrutura"). O processo de investimento do Fundo segue os critérios ASG da Política de Sustentabilidade da Gestora e está disponível em: <https://bnpp.lk/MasterInfra>

RENTABILIDADE (%)

	Mês	Ano	Últimos 12 M	Últimos 24 M	Últimos 36 M	Desde o Início**
Fundo	1,14	3,34	10,37	17,94	28,44	30,15
IMA-B5	1,05	2,92	8,94	19,23	30,62	32,01
Vs IMA-B5	0,09	0,42	1,43	-1,29	-2,18	-1,86

**Rentabilidade acumulada desde 29/12/2016

CONHEÇA O RISCO DO PRODUTO*



*Mais informações em brasil.bnpparibas.com ou [www.bnpparibas-am.com/pt-br/\(Gestor\)](http://www.bnpparibas-am.com/pt-br/(Gestor)).

V@R: **2** 3 4

Créd. Privado: **4**

Derivativos: **1** 2 3 4

Ações: **1** 2 3 4

Câmbio: **1** 2 3 4

Juros & Inflação: **4**

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

TRIBUTAÇÃO

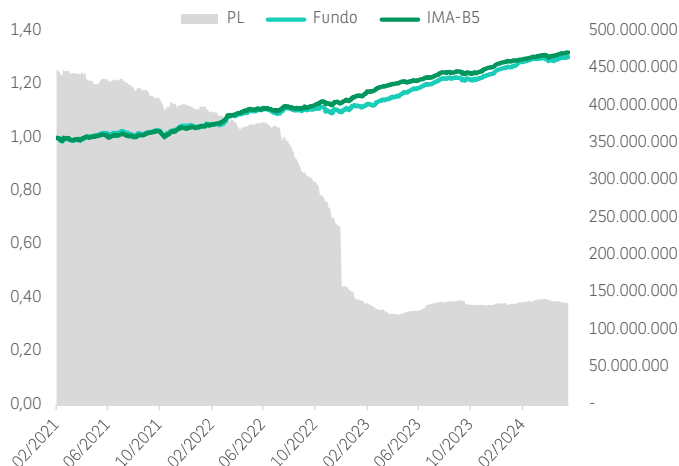
Para ser elegível à isenção de imposto de renda, o fundo deverá atingir o mínimo de 67% do portfólio em Ativos de Infraestrutura em 180 dias. Após 2 anos, o fundo deverá ter, no mínimo, 85% nesses ativos. Os ativos deverão ter duration superior a 4 anos.

*LEI 12.431/2011

Regime tributário diferenciado para debêntures emitidas por empresas envolvidas em projetos estratégicos em infraestrutura com o objetivo de fomentar o investimento no setor. O Brasil demanda grandes investimentos em estradas, energia, telecomunicações, portos e saneamento.

RENTABILIDADE/PL ACUMULADA ATE

31/05/2024



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE (%)

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2024	Fundo	0,91	1,59	0,65	-0,98	1,14								3,34
	IMA-B5	0,68	0,59	0,77	-0,20	1,05								2,92
	Vs IMA-B5	0,23	1,00	-0,12	-0,78	0,09								0,42
2023	Fundo	0,63	0,37	1,73	1,12	2,03	1,65	1,15	0,78	-0,12	-0,24	1,74	1,68	13,23
	IMA-B5	1,40	1,41	1,52	0,90	0,57	1,05	0,97	0,61	0,13	-0,31	1,80	1,46	12,13
	Vs IMA-B5	-0,77	-1,03	0,21	0,22	1,46	0,60	0,18	0,17	-0,26	0,07	-0,07	0,21	1,10
2022	Fundo	-0,22	0,71	2,65	1,19	0,98	0,34	-0,58	0,23	0,26	1,01	-1,00	0,55	6,25
	IMA-B5	0,11	1,06	2,61	1,56	0,78	0,33	0,01	0,00	0,42	1,91	-0,33	0,94	9,78
	Vs IMA-B5	-0,33	-0,35	0,04	-0,37	0,20	0,00	-0,59	0,23	-0,16	-0,91	-0,66	-0,39	-3,53
2021	Fundo			0,49	1,14	0,80	0,40	0,06	-0,18	0,61	-1,29	2,86	0,86	4,69
	IMA-B5			0,34	0,87	0,69	-0,13	0,03	0,15	1,00	-1,24	2,50	0,79	5,08
	Vs IMA-B5			0,15	0,27	0,11	0,53	0,03	-0,33	-0,39	-0,05	0,35	0,07	-0,39

INDICADORES FINANCEIROS

Patrimônio Líq. (PL) em 31/05/2024
PL Médio (12 meses)

R\$ - MIL
136.492
136.470

Maior Rentabilidade Mensal 2,86%
Menor Rentabilidade Mensal -1,29%
Volatilidade (% a.a.)* 1,39%

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

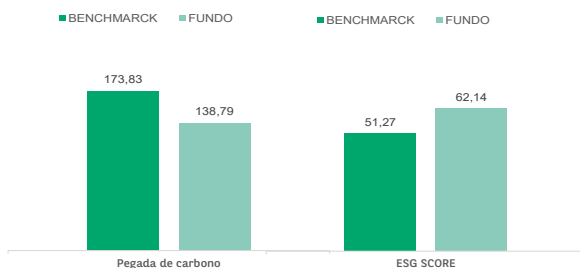
CONDUTA DE NEGÓCIOS RESPONSÁVEL

A BNPP AM Brasil estabelece critérios para o investimento em determinados setores a fim de evitar que os portfólios invistam em atividades que possam causar sérios danos sociais ou ambientais. Não investimos em setores ou atividades que acreditamos violar as normas internacionais, locais, ou causar danos inaceitáveis à sociedade ou ao meio ambiente sem contrabalançar com benefícios. Essas abordagens constituem nossa Política de Conduta de Negócios Responsável que é incorporada no processo de investimento de todos os nossos fundos mútuos.

IDA INFRA

Para fins de comparação dos indicadores sustentáveis do fundo, estamos calculando o ESG Score e a Pegada de Carbono do índice IDA-IPCA Infraestrutura, Índice de Debêntures ANBIMA que espelha o comportamento de uma carteira composta por debêntures indexadas ao IPCA e incentivadas. É composto pelas debêntures que fazem parte da precificação diária da Anbima, desde que cumpram alguns critérios de seleção, por exemplo, são admitidas apenas séries com prazo superior a um mês.

INDICADORES SUSTENTÁVEIS



CONTATO
mesadeatendimento@br.bnpparibas.com
(11) 3049-2820

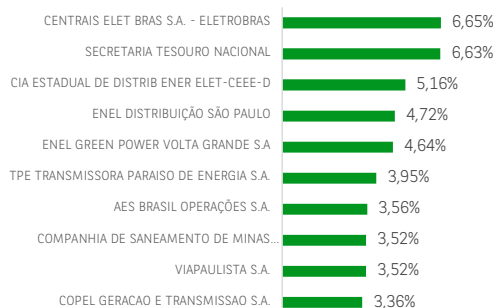


Este documento foi produzido pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A. ou por suas empresas subsidiárias, coligadas e controladas, em conjunto denominadas "BNP Paribas" e tem fins meramente informativos, não se caracterizando como oferta ou recomendação de investimento ou desinvestimento. O BNP Paribas é uma 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. 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. 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. Acesse o site: brasil.bnpparibas (Administrador) ou www.bnpparibas-am.com/pt-br (Gestor).

LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS

Nos termos da regulamentação da CVM, informamos que o FUNDO possui Lâmina de Informações Essenciais e a mesma se encontra disponível no site do Administrador, brasil.bnpparibas.com, para avaliação em conjunto com o presente material. Leia a Lâmina de Informações Essenciais antes de investir.

MAIORES CONCENTRAÇÕES POR EMISSOR



PEGADA DE CARBONO

A pegada de carbono do portfólio ou do benchmark é a soma das emissões de carbono das empresas dividida pelo Enterprise Value das empresas multiplicado pelo peso das empresas no portfólio ou no benchmark. As emissões de carbono são a soma das emissões de Escopo 1 (emissões diretas das instalações da empresa) e as emissões de Escopo 2 (emissões indiretas ligadas ao consumo de energia da empresa). O provedor de dados de carbono é Trucost. A pegada é expressa em toneladas de CO2 equivalente por ano e por milhão de euros investidos. Enterprise Value (EV) é a medida do valor total de uma empresa. É calculado somando a capitalização de mercado e a dívida financeira de uma empresa.

ESG SCORE

A metodologia interna de pontuação ESG da BNPP AM determina a pontuação ESG de um emissor avaliando o desempenho versus pontuação dos pares em um conjunto restrito de questões ESG importantes relacionadas ao meio ambiente (por exemplo, mudança climática), questões sociais (por exemplo, gestão de recursos humanos) e governança (por exemplo, independência e competência dos diretores). A BNPP AM utiliza diversas informações de pesquisa e fontes de dados (por exemplo, Sustainalytics, ISS e Trucost) para determinar as pontuações ESG dos emissores. Se os compromissos e práticas do emissor em um pilar de avaliação (E, S ou G) forem melhores do que dos pares, ele receberá uma 'contribuição' positiva para este pilar. A cada emissor é atribuída uma nota final de 1 a 99, resultado de 50 como referência mais a soma das contribuições de cada um dos três pilares.