



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

FUND FACTSHEET: DECEMBER/2021

Fixed Income

FUND FEATURES

Taxpayer Number: 09.636.393/0001-07
Fixed Inc. Short Duration
ANBIMA Invest. Grade (Cód.: 217018)
Target Investors: General Investors
NAV Calculation: Daily - Opening
Inception Date: 09/16/2008

Management Fee: 0,35% p.y.
Performance Fee: None
Entrance/Exit Fee: None

Subscription: T+0
Redemption (Conv./Settl.): T+0 / T+0
Cut-Off Time: 04:00 PM (GMT-3)
Minimum Inv. Amount: BRL 1,000
Additional Investment: BRL 1,000
Minimum Balance: BRL 1,000
Tax Treatment: Seeks Long Term

Manager: BNP Paribas Asset Management
Administrator: Bank BNP Paribas
Custody: Bank BNP Paribas
Distribution: Bank BNP Paribas

READ THE BY-LAWS ALL LEGAL DOCUMENTS BEFORE
INVESTING

MAIN OBJECTIVE AND INVESTMENT POLICY

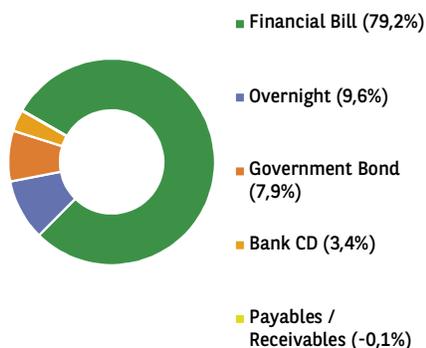
The fund seeks to replicate the variation of the Brazilian Overnight Rate (CDI), investing predominantly in Government and Private Bonds, either directly or indirectly, indexed on the CDI variation.

MONTHLY TRACK RECORD

Period	2020 (%)			2021 (%)		
	Fund	CDI	% CDI	Fund	CDI	% CDI
January	0,36	0,38	95,38	0,04	0,15	24,41
February	0,28	0,29	95,39	0,07	0,13	55,48
March	0,23	0,34	67,72	0,16	0,20	80,96
April	-0,15	0,28		0,18	0,21	85,83
May	0,17	0,24	71,11	0,20	0,27	75,14
June	-0,01	0,22		0,31	0,31	102,20
July	0,14	0,19	74,60	0,42	0,36	118,66
August	0,04	0,16	26,37	0,68	0,42	159,92
September	0,05	0,16	30,09	0,71	0,44	162,55
October	0,07	0,16	42,62	0,71	0,48	146,93
November	0,20	0,15	130,47	0,80	0,59	136,43
December	0,33	0,16	202,06	0,77	0,77	106,35
YTD	1,71	2,77	61,96	5,17	4,39	118,60

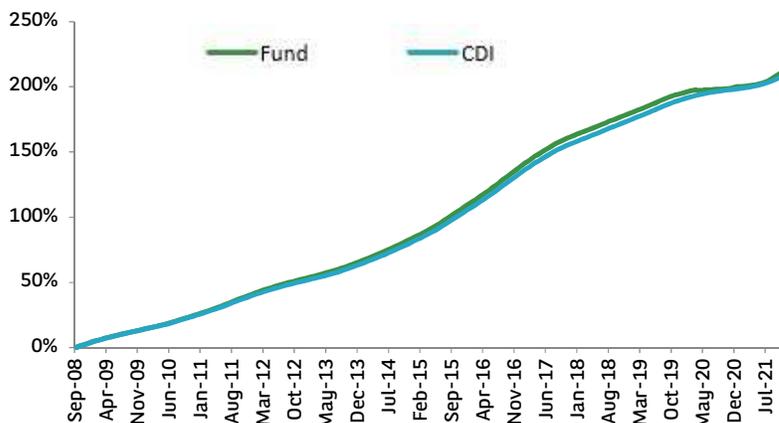
Period	Fund	CDI	% CDI
Last 12 Months	5,17	4,39	118,60
Last 24 Months	6,98	7,28	96,23
Last 36 Months	13,04	13,68	95,53
Since Inception	215,63	211,57	101,92

PORTFOLIO COMPOSITION



PERFORMANCE SINCE INCEPTION UNTIL

12/31/2021



To Invest:

São Paulo Rio de Janeiro Curitiba Belo Horizonte

Individuals 11 3841-3130 21 3094-8200 41 3099-7250 31 3254-1250
Institutional Inv. 11 3049-2820



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

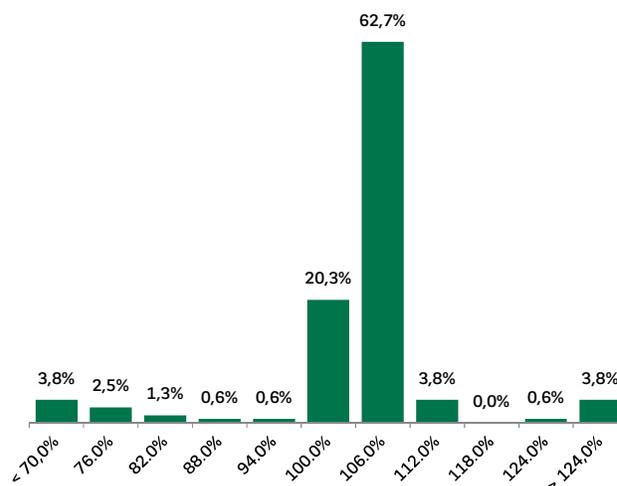
FUND FACTSHEET: DECEMBER/2021

Fixed Income

FINANCIAL INDICATORS

AUM on 12/31/2021*	955.248
Average AUM 12 Months*	646.522
*BRL - Thousands	
Maximum Monthly Performance	1,25%
Minimum Monthly Performance	-0,15%
Months over the CDI	112
Months under the CDI	48
Volatility (% p.y.)*	0,33%
*Annualized standard deviation of the fund's daily returns, with analysis period of 252 business days.	

MONTHLY RETURNS DISTRIBUTION COMPARED TO CDI (FREQUENCY)

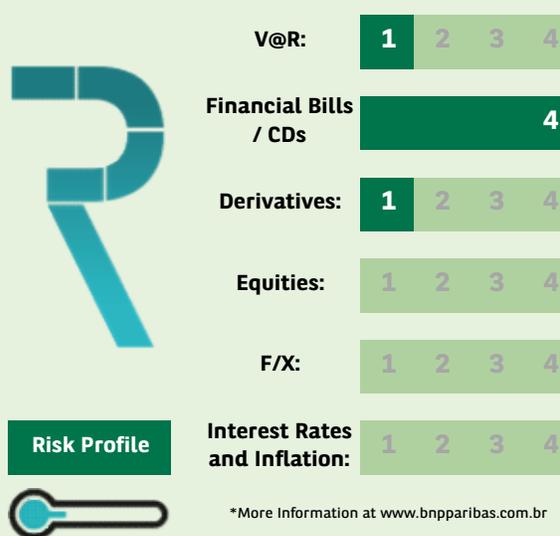


ISSUERS CONCENTRATION RISK

This fund is subject to the risk of substantial loss in the event of situations that might incur in the nonpayment of the assets that are part of its portfolio, or because of an intervention, liquidation, temporary administration regime, bankruptcy, judicial or extrajudicial recuperation of the issuers responsible for the assets of the fund.



UNDERSTAND THE RISK OF THE PRODUCT*



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

The asset manager for a changing world

This document was produced by Banco BNP Paribas Brazil for information purposes only; Despite the care used both in obtaining and handling the information presented, the bank BNP Paribas is not responsible for the accidental publication of incorrect information, nor for investment decisions with based on information contained herein, which may even be changed without notice; To evaluate the performance of investment funds, we recommend an analysis, at least twelve months; Investment funds are not guaranteed by the fund manager, the portfolio manager, of any insurance mechanism, or even of the Fundo Garantidor de Crédito, FGC; The performance is not net of taxes; Past performance is no guarantee or promise of future performance; This material does not represent an investment offer. Prior to any investment decision, it is mandatory to check your risk profile and compare to the risk profile of the intended product, in accordance with local applicable regulation. Are advised to read carefully the prospectus and the by law of investment funds by investors to invest their funds.



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 Dezembro de 2021

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\$ 1,000.00
Investimento adicional mínimo	R\$ 1,000.00
Resgate mínimo	R\$ 1,000.00
Horário para aplicação e resgate	16:00 (horário de Brasília)
Valor mínimo para permanência	R\$ 1,000.00
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 0.40% do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/01/2021 a 31/12/2021. 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\$ 955,248,267.33** e as 5 espécies de ativos em que ele concentra seus investimentos são:

Depósitos a prazo e outros títulos de instituições financeiras	66.37% do Patrimônio líquido
Títulos públicos federais	14.99% do Patrimônio líquido
Outras aplicações	9.89% do Patrimônio líquido
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	8.78% do Patrimônio líquido
Derivativos	-0.37% 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: 32.06%** no mesmo período o índice CDI variou **33.03%**. 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
2021	5.17%	4.40%	117.70%
2020	1.71%	2.77%	61.96%
2019	5.67%	5.97%	94.97%
2018	6.21%	6.42%	96.69%
2017	10.00%	9.95%	100.46%

- 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
Dezembro	0.77%	0.76%	101.48%
Novembro	0.80%	0.59%	136.43%
Outubro	0.71%	0.48%	146.93%
Setembro	0.71%	0.44%	162.55%
Agosto	0.68%	0.42%	159.92%
Julho	0.42%	0.36%	118.66%
Junho	0.31%	0.30%	103.17%
Mai	0.20%	0.27%	75.14%
Abril	0.18%	0.21%	85.83%
Março	0.16%	0.20%	80.96%
Fevereiro	0.07%	0.13%	55.48%
Janeiro	0.04%	0.15%	24.41%
12 meses	5.17%	4.40%	117.70%

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 2021 e não houvesse realizado outras aplicações, nem solicitado resgates durante o ano, no primeiro dia útil de 2022, você poderia resgatar R\$ 1,042.92 (hum mil e quarenta e dois



reais e noventa e dois centavos), já deduzidos impostos no valor de R\$ 9.10 (nove reais e dez centavos).

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\$ 3.99 (três reais e noventa e nove 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\$ 11.96	R\$ 19.93
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\$ 319.04	R\$ 590.58

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.