



## BNP PARIBAS SOBERANO FIC DE FI RENDA FIXA - SIMPLES

FUND FACTSHEET: DECEMBER/2021

Fixed Income

### FUND FEATURES

Taxpayer Number: 09.636.619/0001-61  
Fixed Income Simple (Cód.: ANBIMA 218111)  
Target Investors: General Investors  
NAV Calculation: Daily - Opening  
Inception Date: 10/10/2008

Management Fee: 0,22% p.a.  
Max. Management Fee: 0,24% p.a.  
Perf. / Entrance / Exit Fee: None

Subscription: T+0  
Redemption (Conv./Settl.): T+0 / T+0  
Cut-Off Time: 05:00 PM (GMT-3)  
Minimum Inv. Amount: BRL 1,000  
Additional Investment: BRL 200  
Minimum Balance: None  
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

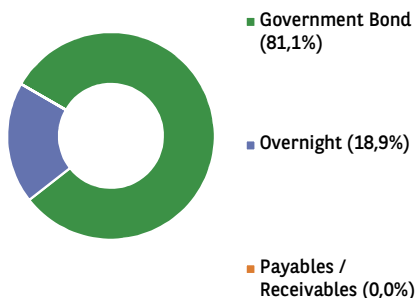
The Fund seeks to replicate Selic rate variation by investing at least 95% of its Portfolio on quotas of the BNP Paribas Master Cash DI FI Referenciado, which invests exclusively on Federal Government Securities, prefixed or indexed to CDI, or on compromised operations backed on federal bonds.

### MONTHLY TRACK RECORD

Period	2020 (%)			2021 (%)		
	Fund	Selic	% Selic	Fund	Selic	% Selic
January	0,35	0,38	91,68	0,14	0,15	94,64
February	0,26	0,29	89,08	0,07	0,34	22,06
March	0,31	0,34	91,26	0,20	0,20	97,00
April	0,25	0,28	88,05	0,15	0,21	73,41
May	0,21	0,24	89,78	0,27	0,27	98,79
June	0,19	0,21	88,40	0,30	0,31	96,49
July	0,16	0,19	84,81	0,37	0,36	104,81
August	0,13	0,16	83,35	0,42	0,43	98,89
September	-0,04	0,16		0,44	0,44	100,36
October	0,11	0,16	67,98	0,52	0,49	107,01
November	0,11	0,15	76,74	0,56	0,59	95,00
December	0,19	0,16	113,13	0,73	0,77	95,47
<b>YTD</b>	<b>2,25</b>	<b>2,76</b>	<b>81,68</b>	<b>4,26</b>	<b>4,40</b>	<b>96,24</b>

Period	Fund	Selic	% Selic
Last 12 Months	4,26	4,40	96,24
Last 24 Months	6,61	7,28	90,45
Last 36 Months	12,62	13,70	92,13
Since Inception	200,17	210,38	95,15

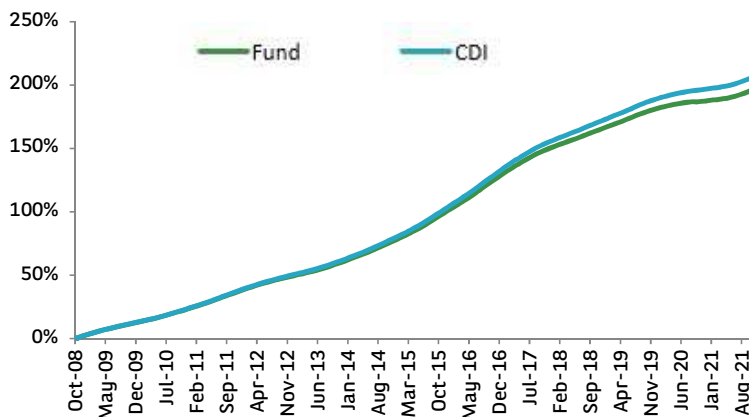
### PORTFOLIO COMPOSITION\*



\*Of the fund BNP Paribas Master Cash DI FI Referenciado.

### 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 SOBERANO FIC DE FI RENDA FIXA - SIMPLES

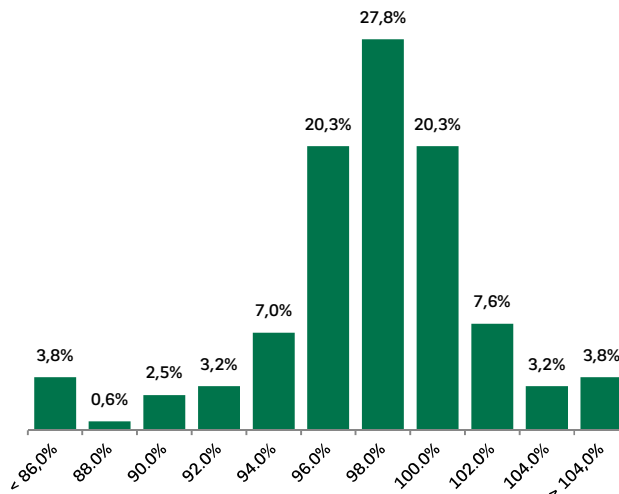
FUND FACTSHEET: DECEMBER/2021

Fixed Income

## FINANCIAL INDICATORS

<b>AUM on 12/31/2021*</b>	773.100
<b>Average AUM 12 Months*</b>	845.540
*BRL - Thousands	
<b>Maximum Monthly Return</b>	1,18%
<b>Minimum Monthly Return</b>	-0,04%
<b>Months over the Selic</b>	23
<b>Months under the Selic</b>	136
<b>Volatility (% p.y.)*</b>	0,14%
*Annualized standard deviation of the fund's daily returns, with analysis period of 252 business days.	

## MONTHLY RETURNS DISTRIBUTION COMPARED TO CDI (FREQUENCY)



### UNDERSTAND THE RISK OF THE PRODUCT\*

<b>V@R:</b>	<input checked="" type="checkbox"/> 1	<input type="checkbox"/> 2	<input type="checkbox"/> 3	<input type="checkbox"/> 4
<b>Corp. Bonds:</b>	<input type="checkbox"/> 1	<input type="checkbox"/> 2	<input type="checkbox"/> 3	<input type="checkbox"/> 4
<b>Derivatives:</b>	<input checked="" type="checkbox"/> 1	<input type="checkbox"/> 2	<input type="checkbox"/> 3	<input type="checkbox"/> 4
<b>Equities:</b>	<input type="checkbox"/> 1	<input type="checkbox"/> 2	<input type="checkbox"/> 3	<input type="checkbox"/> 4
<b>F/X:</b>	<input type="checkbox"/> 1	<input type="checkbox"/> 2	<input type="checkbox"/> 3	<input type="checkbox"/> 4
<b>Interest Rates and Inflation:</b>	<input type="checkbox"/> 1	<input type="checkbox"/> 2	<input type="checkbox"/> 3	<input type="checkbox"/> 4

**Risk Profile**

\*More Information at [www.bnpparibas.com.br](http://www.bnpparibas.com.br)



**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; 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. 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; 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 SOBERANO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE  
INVESTIMENTO RENDA FIXA - SIMPLES**

**CNPJ/MF: 09.636.619/0001-61**

**Informações referentes a Dezembro de 2021**

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](http://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\$ 300.00
Investimento adicional mínimo	R\$ 100.00
Resgate mínimo	R\$ 100.00
Horário para aplicação e resgate	17:00 (horário de Brasília)
Valor mínimo para permanência	R\$ 0.00
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.

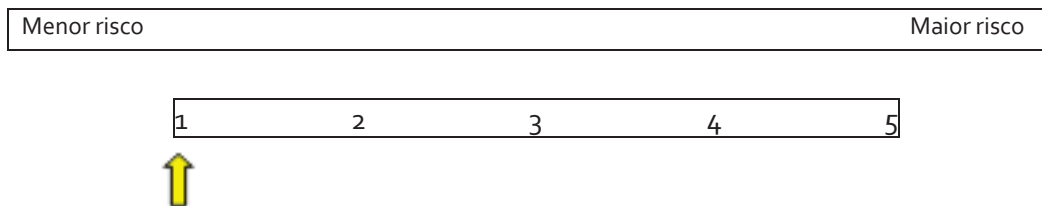


Pagamento dos resgates	O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é a mesma data do pedido de resgate.
Taxa de administração	A taxa mínima de Administração é de 0,22% a.a e a taxa Máxima de Administração é de 0,24%a.a
Taxa de entrada	Não há
Taxa de saída	Não há
Taxa de performance	Não há
Taxa total de despesas	As despesas pagas pelo fundo representaram 0.27% do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/01/2021 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 <a href="http://www.bnpparibas.com.br">www.bnpparibas.com.br</a>

5. **COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA:** o patrimônio líquido do fundo é de **R\$ 773,099,793.10** e as 5 espécies de ativos em que os fundos investidos concentram seus investimentos são:

Títulos públicos federais	81.11% do Patrimônio líquido
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	18.92% do Patrimônio líquido
Derivativos	-4.59% 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:



7. **HISTÓRICO DE RENTABILIDADE (?):**

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



- b. **Rentabilidade acumulada nos últimos 5 anos: 30.96% no mesmo período o índice SELIC variou 33.06%.** 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
2021	4.26%	4.40%	96.87%
2020	2.25%	2.77%	81.39%
2019	5.65%	5.97%	94.59%
2018	6.07%	6.43%	94.35%
2017	9.63%	9.97%	96.59%

- 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
Dezembro	0.73%	0.76%	96.16%
Novembro	0.56%	0.59%	95.00%
Outubro	0.52%	0.48%	108.25%
Setembro	0.44%	0.44%	101.31%
Agosto	0.42%	0.42%	99.78%
Julho	0.37%	0.36%	104.81%
Junho	0.30%	0.30%	97.40%
Mai	0.27%	0.27%	99.86%
Abril	0.15%	0.21%	73.41%
Março	0.20%	0.20%	98.43%
Fevereiro	0.07%	0.13%	55.09%
Janeiro	0.14%	0.15%	94.64%
12 meses	4.26%	4.40%	96.87%

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\$ 1,035.36 (hum mil e trinta e cinco



reais e trinta e seis centavos), já deduzidos impostos no valor de R\$ 7.50 (sete reais e cinquenta 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\$ 2.73 (dois reais e setenta e três 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\$ 8.19	R\$ 13.65
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\$ 322.81	R\$ 596.86

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](http://www.bnpparibas.com.br)
- c. **Reclamações:** [mesadeatendimento@br.bnpparibas.com](mailto: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](http://www.cvm.gov.br).

Você poderá acessar a Ouvidoria pelo telefone – 0800-7715999 ou através do e-mail: [ouvidoria@br.bnpparibas.com](mailto: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.