



BNP PARIBAS

**LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS SOBRE O
BNP PARIBAS MASTER IMA-B5 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO
CNPJ/MF: 15.715.263/0001-54
Informações referentes a Março de 2022**

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o **BNP PARIBAS MASTER IMA-B5 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO**, 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 receber aplicações, única e exclusivamente, de fundos de investimento e carteiras administradas geridas pela **BNP Paribas Asset Management Brasil Ltda.**
2. **OBJETIVOS DO FUNDO:** O fundo tem como objetivo de investimento procurar superar a variação do **IMA-B5**, Índice de Mercado ANBIMA série B5, composto por títulos públicos federais atrelados ao **IPCA**, com maturidade menor do que cinco anos. 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 **IMA-B5**.
3. **POLÍTICA DE INVESTIMENTOS:**
 - a. Mínimo de 80% do patrimônio líquido ("PL") deve ser investido em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa, relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos, à variação de taxa de juros, de índice de preço, ou ambos (pós ou pré- fixados).
 - 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 | 50.00% do Patrimônio líquido |
| Aplicar em um só fundo | 10.00% do Patrimônio líquido |
| Utiliza derivativos apenas para proteção da carteira? | Sim |
| Alavancar-se até o limite de (1) | 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 | Não há |
| Investimento adicional mínimo | Não há |
| Resgate mínimo | Não há |
| Horário para aplicação e resgate | 16:00 (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 no fechamento da data da aplicação. No resgate, o número de cotas canceladas será calculado de acordo com o valor das cotas no fechamento do 1º dia útil contado da data do pedido de resgate. |
| Pagamento dos resgates | O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é o 2º dia útil da data do pedido de resgate. |
| Taxa de administração | 0,02%a.a |
| Taxa de entrada | Não há |
| Taxa de saída | Não há |
| Taxa de performance | Não há |

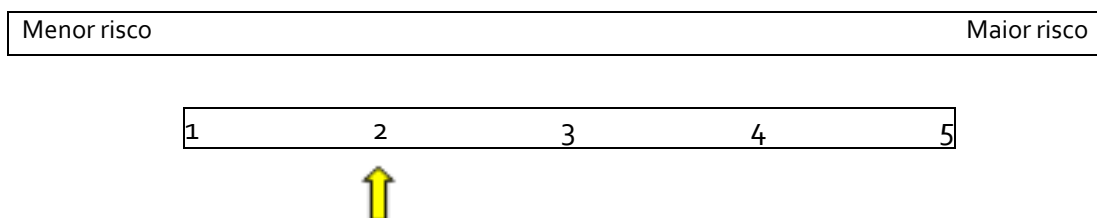


| | |
|-----------------------------------|--|
| Taxa total de despesas (1) | As despesas pagas pelo fundo representaram 0.15% do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/04/2021 a 31/03/2022. A taxa de despesas pode variar de período para período e reduz a rentabilidade do fundo. 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\$ 170,566,631.12** e as 5 espécies de ativos em que ele concentra seus investimentos são:

| | |
|---|-------------------------------|
| Títulos públicos federais | 101.64% do Patrimônio líquido |
| Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais | 0.01% do Patrimônio líquido |
| Derivativos | -0.01% 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 (2):**

- a. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.
- b. **Rentabilidade acumulada nos últimos 5 anos: 45.44% no mesmo período o índice IMA-B5 variou 45.80%.** 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 IMA-B5 | Desempenho do fundo como % do IMA-B5 |
|------|--|------------------------------|--------------------------------------|
| 2022 | 3.78% | 3.81% | 99.06% |
| 2021 | 3.01% | 4.57% | 65.95% |



| | | | |
|------|--------|--------|---------|
| 2020 | 8.58% | 8.04% | 106.68% |
| 2019 | 14.15% | 13.15% | 107.57% |
| 2018 | 9.77% | 9.87% | 98.99% |

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 IMA-B5 | Desempenho do fundo como % do IMA-B5 |
|-----------|---|---------------------------------|---|
| Março | 2.59% | 2.61% | 99.39% |
| Fevereiro | 1.06% | 1.06% | 99.35% |
| Janeiro | 0.10% | 0.11% | 89.28% |
| Dezembro | 0.77% | 0.79% | 98.21% |
| Novembro | 2.50% | 2.50% | 99.80% |
| Outubro | -1.42% | -1.24% | 115.12% |
| Setembro | 0.80% | 1.00% | 79.54% |
| Agosto | -0.06% | 0.15% | -38.52% |
| Julho | -0.13% | 0.03% | -439.09% |
| Junho | -0.12% | -0.13% | 91.10% |
| Mai | 0.70% | 0.69% | 101.44% |
| Abril | 0.93% | 0.87% | 106.37% |
| 12 meses | 7.92% | 8.72% | 90.90% |

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\$ 1,024.54 (hum mil e vinte e quatro reais e cinquenta e quatro centavos), já deduzidos impostos no valor de R\$ 5.21 (cinco reais e vinte e um 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\$ 1.60 (hum real e sessenta 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\$ 4.79 | R\$ 7.98 |
| 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\$ 326.21 | R\$ 602.53 |

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.



BNP PARIBAS

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. 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.

ii) A rentabilidade do fundo exposta no item 7, é calculada com base na cota do último dia útil do



BNP PARIBAS

período de análise. No Exemplo Comparativo, este cálculo é realizado com base no primeiro dia útil.

(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.