



BNP PARIBAS

**LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS SOBRE O
WESTERN ASSET SOBERANO II FI RENDA FIXA REFERENCIADO SELIC**

CNPJ/MF: 22.773.421/0001-98

Informações referentes a Março de 2022

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o **WESTERN ASSET SOBERANO II FI RENDA FIXA REFERENCIADO SELIC**, administrado por **BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.** e gerido por **WESTERN ASSET MANAGEMENT**. 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: Público em Geral**
2. **OBJETIVOS DO FUNDO:** O objetivo do FUNDO é proporcionar a seus cotistas valorizações de suas cotas mediante aplicações de recursos financeiros em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral que acompanhem, direta ou indiretamente, a taxa SELIC.
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, determinado índice de referência. Adicionalmente, no mínimo 80% PL deve ser aplicado em: (i) títulos da dívida pública federal; e (ii) cotas de fundos de índice que invistam preponderantemente nos ativos das alíneas "i" 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	0.00% do Patrimônio líquido
Aplicar em um só fundo	10.00% do Patrimônio líquido
Utiliza derivativos apenas para proteção da carteira?	Sim
Se alavancar 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.
- d. As estratégias de investimento do fundo podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.

4. CONDIÇÕES DE INVESTIMENTO

Investimento inicial mínimo	R\$ 100.00
Investimento adicional mínimo	R\$ 0.00
Resgate mínimo	R\$ 0.00
Horário para aplicação e resgate	15:00 (horário de Brasília)
Valor mínimo para permanência	R\$ 100.00
Período de carência	Não há
Conversão das cotas	Na aplicação, o número de cotas compradas será calculado de acordo com o valor das cotas 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 dia da data do pedido de resgate.
Pagamento dos resgates	O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é no dia da data do pedido de resgate.
Taxa de administração	0,15% ao ano sobre o PL do FUNDO
Taxa de entrada	Não há
Taxa de saída	Não há
Taxa de performance	Não há

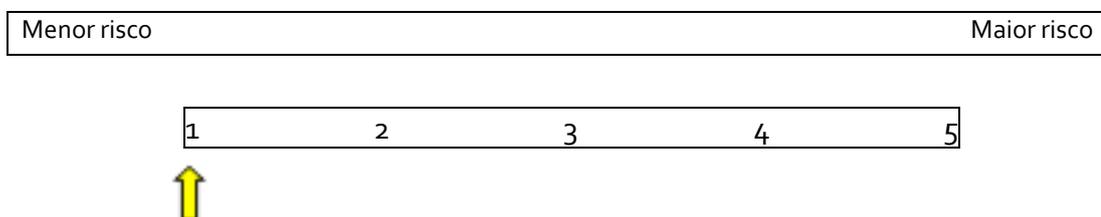


Taxa total de despesas	As despesas pagas pelo fundo representaram 0.18% do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/04/2021 a 31/03/2022. A taxa de despesas pode variar de período para período e reduz a rentabilidade do fundo. O quadro com a descrição das despesas do fundo pode ser encontrado em www.bnpparibas.com.br
-------------------------------	--

5. **COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA:** o patrimônio líquido do fundo é de **R\$ 1,288,086,544.82** e as 5 espécies de ativos em que ele concentra seus investimentos são:

Títulos públicos federais	89.79% do Patrimônio líquido
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	10.23% do Patrimônio líquido
Derivativos	-7.44% 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: 22.96% no mesmo período o índice SELIC variou 23.93%.** A tabela abaixo mostra a rentabilidade do **fundo** a cada ano nos últimos 5 anos.

Ano	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Variação percentual do SELIC	Desempenho do fundo como % do SELIC
2022	2.54%	2.42%	104.65%
2021	4.50%	4.40%	102.47%



2020	2.19%	2.77%	79.12%
2019	5.74%	5.97%	96.14%
2018	6.19%	6.43%	96.33%

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
Março	0.92%	0.92%	99.77%
Fevereiro	0.82%	0.75%	108.86%
Janeiro	0.78%	0.73%	106.36%
Dezembro	0.76%	0.76%	99.04%
Novembro	0.59%	0.59%	100.41%
Outubro	0.53%	0.48%	111.02%
Setembro	0.47%	0.44%	107.02%
Agosto	0.47%	0.42%	109.81%
Julho	0.41%	0.36%	115.60%
Junho	0.36%	0.30%	116.58%
Mai	0.30%	0.27%	113.70%
Abril	0.11%	0.21%	52.79%
12 meses	6.70%	6.41%	104.55%

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\$ 1,037.38 (hum mil e trinta e sete reais e trinta e oito centavos), já deduzidos impostos no valor de R\$ 7.93 (sete reais e noventa e três 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\$ 1.78.



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\$ 5.34	R\$ 8.91
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\$ 325.66	R\$ 601.60

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.

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.

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.

11. SERVIÇO DE ATENDIMENTO AO COTISTA:

- a. Telefone: (11) 3841-3157 E-mail: bnp.clientservices@br.bnpparibas.com
Endereço: Avenida Presidente Juscelino Kubitschek, 1.909 - 9º andar – Torre Sul
- b. Página na rede mundial de computadores: www.bnpparibas.com.br
- c. **Reclamações:** ouvidoria@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.

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.

(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



BNP PARIBAS

útil.

(3) Caso o fundo e/ou o índice de referência apresente rentabilidade negativa, o desempenho percentual em relação ao índice de referência deve ser avaliado em conjunto com as variações individuais dos respectivos indicadores.