

## FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

CA INDOSUEZ SOUVERAIN FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA SIMPLES

CNPJ/MF nº 35.844.755/0001-57

(“Fundo”)

COMPETÊNCIA: Março/2020

DATA DE GERAÇÃO: 30/03/2020

ESTE FORMULÁRIO FOI PREPARADO COM AS INFORMAÇÕES NECESSÁRIAS AO ATENDIMENTO DAS DISPOSIÇÕES DO CÓDIGO ANBIMA DE ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS DE TERCEIROS, BEM COMO DAS NORMAS EMANADAS DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS. A AUTORIZAÇÃO PARA FUNCIONAMENTO E/OU VENDA DAS COTAS DESTES FUNDO NÃO IMPLICA, POR PARTE DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS OU DA ANBIMA, GARANTIA DE VERACIDADE DAS INFORMAÇÕES PRESTADAS, OU JULGAMENTO SOBRE A QUALIDADE DO FUNDO, DE SEU ADMINISTRADOR OU DAS DEMAIS INSTITUIÇÕES PRESTADORAS DE SERVIÇOS.

ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS COTISTAS.

O INVESTIMENTO DO FUNDO DE QUE TRATA ESTE FORMULÁRIO APRESENTA RISCOS PARA O INVESTIDOR. AINDA QUE O GESTOR DA CARTEIRA MANTENHA SISTEMA DE GERENCIAMENTO DE RISCOS, NÃO HÁ GARANTIA DE COMPLETA ELIMINAÇÃO DA POSSIBILIDADE DE PERDAS PARA O FUNDO E PARA O INVESTIDOR.

ESTE FUNDO NÃO CONTA COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO, OU, AINDA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS – FGC.

A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA.

AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESSE FORMULÁRIO ESTÃO EM CONSONÂNCIA COM O REGULAMENTO DO FUNDO, MAS NÃO O SUBSTITUEM. É RECOMENDADA A LEITURA CUIDADOSA TANTO DESTES FORMULÁRIO QUANTO DO REGULAMENTO, COM ESPECIAL ATENÇÃO PARA AS CLÁUSULAS RELATIVAS AO OBJETIVO E À POLÍTICA DE INVESTIMENTO DO FUNDO, BEM COMO ÀS DISPOSIÇÕES DO FORMULÁRIO E DO REGULAMENTO QUE TRATAM DOS FATORES DE RISCO A QUE O FUNDO ESTÁ EXPOSTO.

O GESTOR DESTA FUNDO ADOTA POLÍTICA DE EXERCÍCIO DE DIREITO DE VOTO EM ASSEMBLEIAS, QUE DISCIPLINA OS PRINCÍPIOS GERAIS, O PROCESSO DECISÓRIO E QUAIS SÃO AS MATÉRIAS RELEVANTES OBRIGATÓRIAS PARA O EXERCÍCIO DO DIREITO DE VOTO. TAL POLÍTICA ORIENTA AS DECISÕES DO GESTOR EM ASSEMBLEIAS DE DETENTORES DE ATIVOS QUE CONFIRAM AOS SEUS TITULARES O DIREITO DE VOTO.

- **PERIODICIDADE MÍNIMA PARA DIVULGAÇÃO DA COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DO FUNDO:**  
Mensalmente, até 10 (dez) dias após o encerramento do mês a que se referir.
- **LOCAL DE DIVULGAÇÃO DAS INFORMAÇÕES:**  
Sede do administrador
- **MEIO DE DIVULGAÇÃO DAS INFORMAÇÕES:**  
Eletrônico
- **FORMA DE DIVULGAÇÃO:**  
Disponibilizada aos Cotistas na sede do Administrador
- **RESPONSÁVEL PELA DIVULGAÇÃO:**  
Administrador.
- **LOCAL DE SOLICITAÇÃO DE INFORMAÇÕES PELO COTISTA:**  
As informações podem ser solicitadas para área de atendimento ao cotista na sede do Administrador.
- **MEIO DE SOLICITAÇÃO DE INFORMAÇÕES PELO COTISTA:**  
Por e-mail ou telefone.
- **FORMA DE SOLICITAÇÃO DE INFORMAÇÕES PELO COTISTA:**  
As informações podem ser solicitadas para área de atendimento ao cotista através do e-mail [cadvm@ca-indosuez.com.br](mailto:cadvm@ca-indosuez.com.br) ou dos telefones (11) 3896-6336 / (11) 3896-6352; Rio de Janeiro: (21) 2106-6200.

- **FATORES DE RISCO**

Em decorrência da sua política de investimento, o Fundo, e, conseqüentemente, seus Cotistas, estarão sujeitos, principalmente, aos riscos abaixo relacionados. O detalhamento de cada um encontra-se no regulamento do Fundo.

I. Risco de Mercado.

II. Risco de Crédito.

IV. Risco de Liquidez.

V. Risco Regulatório.

VI. Riscos Operacionais.

VII. Outros Riscos.

- **POLÍTICA RELATIVA AO EXERCÍCIO DE DIREITO DE VOTO**

O Gestor adota política de exercício de direito de voto decorrente dos ativos financeiros detidos pelo Fundo, a qual está disponível no website do administrador (<https://brazil.ca-indosuez.com/pt>), que disciplina os princípios gerais, o processo decisório e quais são as matérias relevantes obrigatórias para exercício do direito de voto. Tal política orienta as decisões do Gestor em assembleias de detentores de ativos financeiros que confirmam aos seus titulares o direito de voto.

- **TRIBUTAÇÃO**

A tributação aplicável à carteira do Fundo e aos seus cotistas é aquela estabelecida pela legislação tributária brasileira, que compreende as leis e demais atos normativos, alteráveis a qualquer tempo.

A tributação discriminada neste Formulário é aquela vigente na data de sua publicação

Os rendimentos auferidos pela carteira do Fundo são isentos do Imposto de Renda (IR) e suas operações se sujeitam à alíquota zero do Imposto sobre Operações Financeiras (IOF).

Os rendimentos auferidos pelos cotistas do Fundo estão sujeitos à incidência do IR, a ser retido na fonte, de acordo com o tipo de evento e disponibilidade sobre tais rendimentos.

No caso de resgate de cotas, os rendimentos auferidos pelos cotistas estarão sujeitos à incidência do IR neste momento, com base nas alíquotas regressivas aplicáveis aos fundos

de longo prazo, as quais variam de acordo com o prazo de permanência da aplicação do cotista, conforme discriminado abaixo:

- (a) 22,5% (vinte dois e meio por cento) em aplicações com prazo de até 180 (cento e oitenta) dias;
- (b) 20,0% (vinte por cento) em aplicações com prazo de 181 (cento e oitenta e um) dias até 360 (trezentos e sessenta) dias;
- (c) 17,5% (dezessete e meio por cento) em aplicações com prazo de 361 (trezentos e sessenta e um) dias até 720 (setecentos e vinte) dias; e
- (d) 15,0% (quinze por cento) em aplicações com prazo acima de 720 (setecentos e vinte) dias.

Independentemente do resgate de cotas, o IR incidirá à alíquota de 15% (quinze por cento) no último dia útil dos meses de maio e novembro de cada ano ("come cotas").

Por ocasião do resgate das cotas será aplicada alíquota complementar de acordo com o tempo de permanência, conforme discriminadas acima.

Caso, por razões estratégicas e/ou operacionais decorrentes da busca do cumprimento da política de investimento, a carteira do Fundo apresentar características de curto prazo, como tal entendendo-se uma carteira de títulos com prazo médio igual ou inferior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias, o IR será cobrado com base nas seguintes alíquotas:

- I. 22,5% em aplicações com prazo de até 180 (cento e oitenta) dias; e
- II. 20% em aplicações com prazo acima de 180 (cento e oitenta) dias.

No caso de enquadramento do Fundo como de curto prazo, a alíquota do IR no caso de come cotas será de 20% (vinte por cento).

O IR retido na fonte mencionado anteriormente será considerado:

- I. como adiantamento do imposto devido no encerramento de cada período de apuração ou na data da extinção, no caso de pessoa jurídica tributada com base no lucro real, presumido ou arbitrado; e
- II. como tributação definitiva, no caso de cotista pessoa física e de pessoa jurídica optante pela inscrição no Simples Nacional.

Não há garantia de que este Fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo.

Os rendimentos auferidos por cotistas do Fundo que efetuarem resgate, cessão ou repactuação das cotas em prazo inferior a 30 (trinta) dias da data da aplicação, estão

sujeitos à incidência do IOF à alíquota de 1% (um por cento) ao dia sobre o valor do resgate, cessão ou repactuação, limitado a uma porcentagem regressiva do rendimento em razão do prazo de aplicação, conforme estabelecido no Anexo ao Decreto nº 6.306, de 14 de dezembro de 2007.

Os cotistas residentes ou domiciliados no exterior estão sujeitos à mesma tributação pelo IR aplicável aos cotistas pessoas físicas residentes no Brasil.

No caso de aplicações registradas de acordo com Resolução CMN nº 4.373, de 29 de setembro de 2014, realizadas por cotista residente ou domiciliado no exterior, em país não definido como de tributação favorecida, sujeitam-se à incidência do IR exclusivamente no resgate das cotas, a ser recolhido na fonte, à alíquota de 15% (quinze por cento).

- **POLÍTICA DE ADMINISTRAÇÃO DE RISCO**

O Administrador utiliza os modelos descritos abaixo para mensuração dos Riscos de Mercado, Crédito e Controle de Liquidez:

- **Value at Risk (VaR):** O Value at Risk (VaR) fornece uma medida da maior (ou pior) perda esperada em uma carteira ou ativo para um determinado período de tempo e um intervalo de confiança previamente especificado.

O modelo utilizado pelo Administrador é o Paramétrico com volatilidade e matriz de correlação calculadas pelo método EWMA com time decay factor, Lambda, de 0,94 (noventa e quatro centésimos), nível de confiança de 95% (noventa e cinco por cento) e horizonte de tempo igual a 1 (um) dia útil, com o objetivo de controlar os limites acordados na Política Interna de Risco.

- **Stress Testing:** o VaR mensura o risco sob condições de normalidade de mercado. O Stress Testing consiste na determinação das potenciais perdas/ganhos sob cenários extremos, nos quais os preços dos ativos tenderiam a ser substancialmente diferentes dos atuais. O Stress Testing permite a avaliação do impacto financeiro que determinados cenários extremos para variáveis macroeconômicas teriam sobre o valor dos ativos que compõem a carteira e, conseqüentemente, sobre a cota do **Fundo**. Pode ser descrito como um processo que visa identificar e gerenciar situações que podem causar perdas extraordinárias, onde há quebras de relações históricas, sejam temporárias ou permanentes. Este teste pode ser efetuado com um conjunto de ferramentas que incluem cenários, simulações de condições anormais para modelos, volatilidades e correlações, e políticas de contingência.

A análise de cenários consiste na avaliação da carteira sob vários estados da natureza. Tipicamente, envolve amplos movimentos de variáveis-chave, o que gera a necessidade de uso de métodos de avaliação plena (reprecificação), também chamado de *full valuation*.

O Administrador utiliza 3 (três) cenários proprietários para o cálculo do Stress Testing, com o objetivo de controlar os limites acordados na Política Interna de Risco.

- **Backtesting** - O processo de modelagem está sujeito a erros provenientes não só do uso inapropriado do modelo, mas também de problemas com os dados, ou até mesmo erros operacionais. Neste sentido, para maior segurança, são realizados periodicamente testes de precisão dos modelos de risco. Um sistema de risco adequado não é garantia de performance ajustada ao risco.

- **Risco de Crédito** - Caso a política de investimento dos fundos investidos permita aplicações em ativos de crédito privado, o Administrador, a fim de mitigar risco de concentração pelo fundo administrado, considerará, como regra, o percentual máximo de aplicação em tais ativos na consolidação de seus limites, salvo se a administradora dos fundos investidos disponibilizar diariamente a composição de suas carteiras.

Além disto, é realizado um controle dos limites gerenciais de concentração estabelecidos previamente nos comitês internos do **Administrador**. Estes limites são analisados através dos seguintes parâmetros: contraparte, tipo de ativo, montante financeiro e vencimento (prazo do ativo).

- **Controle de Liquidez** – com o objetivo monitorar e alertar para o nível de solvência dos fundos administrados pelo **Administrador**, verifica-se, através de um controle diário, um percentual mínimo de ativos em relação ao patrimônio líquido, cuja liquidez seja inferior ao prazo de cotização/resgate do Fundo, de acordo com os limites acordados na Política Interna de Risco. O modelo utilizado para este controle também leva em consideração os percentuais de concentração de posição de cada cotista com relação ao patrimônio total dos fundos de investimentos.

Os métodos utilizados pelo **Administrador** para gerenciar os riscos aos quais o Fundo se sujeita não constituem garantia contra eventuais perdas patrimoniais que o Fundo possa sofrer.

- **AGÊNCIA DE RATING**

Não há

- **APRESENTAÇÃO DO ADMINISTRADOR E GESTOR DO FUNDO**

**CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A. DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS**, instituição financeira com sede na capital de São Paulo, na Avenida Brigadeiro Faria Lima, n.º 4.440, 3º andar, inscrita no CNPJ/MF sob o n.º 01.638.542/0001-57 (“Administrador”), credenciada pela CVM para o exercício da atividade de administração de carteira por meio do Ato Declaratório CVM n.º 5.719 de 18 de novembro de 1999 e aderente ao Código ANBIMA de Administração de Recursos de

Terceiros. A CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A. DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS é a responsável pelos serviços de administração, gestão e distribuição do Fundo.

## **BREVE HISTÓRICO DA CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A. DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS**

A CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A. DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS dedica-se basicamente à administração de fundos de investimentos e recursos de terceiros, sendo uma sociedade 100% controlada pelo Grupo Crédito Agricole - França. A atividade de administração de recursos de terceiros foi iniciada em dezembro de 1998 com o lançamento de seus fundos de investimento tanto de renda fixa como de renda variável.

- **DEMAIS PRESTADORES DE SERVIÇOS DO FUNDO**

Escriturador de Cotas: BANCO BRADESCO S.A

Principal Distribuidor: Administrador

Custodiante/Tesouraria: BANCO BRADESCO S.A

Controladoria e Processamento de Ativos: BANCO BRADESCO S.A

Auditor: KPMG AUDITORES INDEPENDENTES

- **POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO**

O principal distribuidor do Fundo é o Administrador, o qual atua por meio dos seus canais de distribuição internos. O principal distribuidor oferta preponderantemente, fundos geridos por um único gestor, que no caso também é o próprio Administrador. A remuneração paga ao principal distribuidor pela prestação de serviço consiste em um percentual da taxa de administração do Fundo, a qual está prevista no Regulamento do Fundo.

Considerando que o Distribuidor é o próprio Administrador do Fundo, não há conflito de interesses. De qualquer forma, o Administrador possui políticas próprias para evitar potencial conflito de interesses no esforço de venda, bem como para verificar a adequação dos produtos e serviços ao perfil de seus clientes (*suitability*).

- **DEMAIS INFORMAÇÕES RELEVANTES AO INVESTIDOR**

### **TAXAS**

#### Taxa de Administração

A Taxa de Administração é 0,20% (vinte centésimos por cento) ao ano.

Taxa de Custódia

0,077% a.a

Taxa de Performance

Não há

Taxa de Ingresso

Não há

Taxa de Saída

Não há

**REGRAS DE MOVIMENTAÇÃO**

**Aplicação:** D+0 (valor da cota em vigor no dia da efetiva disponibilidade dos recursos).

**Resgate:** D+0 (valor da cota em vigor no dia da respectiva solicitação do resgate – Data de Conversão).

**Pagamento de Resgate:** D+0 (o resgate de cotas será pago na data da conversão de cotas).

**Aplicação Inicial:** R\$ 500,00 (quinhentos reais)

**Movimentação Mínima:** R\$ 500,00 (quinhentos reais)

**Saldo Mínimo:** R\$ 500,00 (quinhentos reais)

**Tipo ANBIMA:** Renda Fixa Simples

**Descrição do Tipo ANBIMA:** Fundos 555 que devem manter 100% (cem por cento) do seu patrimônio líquido em títulos públicos federais, admitindo-se estratégias que impliquem risco de juros e de índice de preços. Excluem-se estratégias que impliquem exposição em renda variável.

**ATENDIMENTO AO COTISTA**

O Administrador coloca-se à disposição para esclarecimentos ou informações referentes ao Fundo, procedimentos para aplicações e resgates ou quaisquer outras desejadas através dos seguintes contatos:

São Paulo: (11) 3896-6336 / (11) 3896-6352 - Fax: (11) 3896-6251;

Rio de Janeiro: (21) 2106-6200 - Fax: (21) 2106-6262;

e-mail: [cadtm@ca-indosuez.com.br](mailto:cadtm@ca-indosuez.com.br)

Ouvidoria: 0800 724 2818

e-mail: [ouvidoria@ca-indosuez.com.br](mailto:ouvidoria@ca-indosuez.com.br)

Site: <https://brazil.ca-indosuez.com/pt>.



**CA Indosuez Wealth (Brazil) S.A. DTVM**

São Paulo  
Avenida Brigadeiro Faria Lima,  
4440, 3º andar - Itaim Bibi  
SP BRASIL 04538-132  
T +55 11 3896 6312  
F +55 11 3896 6251  
<https://brazil.ca-indosuez.com/pt>

Rio de Janeiro  
Avenida Rio Branco,  
1 Sala 1711 Centro  
RJ BRASIL 20090-003  
T +55 21 2106 6200  
F +55 21 2106 6289

Fale com a Ouvidoria  
T 0800 724 2818  
F +11 3896 6412  
e-mail [ouvidoria@ca-indosuez.com.br](mailto:ouvidoria@ca-indosuez.com.br)