

Competência:	02/07/2018	Data de Elaboração:	02/07/2018																						
Fundo:	CAPTALYS ORION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO – CRÉDITO PRIVADO																								
CNPJ:	05.583.449/0001-43																								
Tipo ANBIMA:	MULTIMERCADO - ESTRATÉGIA - LIVRE - Fundos que não possuem obrigatoriamente o compromisso de concentração em nenhuma estratégia específica.																								
Informações de Autorregulação:	<p>ESTE FORMULÁRIO FOI PREPARADO COM AS INFORMAÇÕES NECESSÁRIAS AO ATENDIMENTO DAS DISPOSIÇÕES DO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO, BEM COMO DAS NORMAS EMANADAS DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS. A AUTORIZAÇÃO PARA FUNCIONAMENTO E/OU VENDA DAS COTAS DESTE 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 SERVIÇO.</p> <p>ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA OS SEUS COTISTAS, PODENDO INCLUSIVE ACARREJAR PERDAS SUPERIORES AO CAPITAL APLICADO E A CONSEQUENTE OBRIGAÇÃO DO COTISTA DE APORTAR RECURSOS ADICIONAIS PARA COBRIR O PREJUÍZO DO FUNDO.</p> <p>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.</p> <p>ESTE FUNDO NÃO CONTA COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU, AINDA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS – FGC.</p> <p>A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA.</p> <p>AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESSE FORMULÁRIO ESTÃO EM CONSONÂNCIA COM O REGULAMENTO DO FUNDO, MAS NÃO O SUBSTITUEM. É RECOMENDADA A LEITURA CUIDADOSA TANTO DESTE 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 DIS FATORES DE RISCO A QUE O FUNDO ESTÁ EXPOSTO.</p>																								
Apresentação detalhada do Administrador:	<p>SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A., inscrita no CNPJ sob o n.º 62.318.407/001-19, com sede na Rua Amador Bueno nº 474, 1º andar – Bloco D, Santo Amaro, CEP 04.752-005 ("Santander Securities"), habilitada para atuação de Administrador Fiduciário, conforme Ato Declaratório n. 11.015, de 29 de abril de 2010. A atuação do Santander Securities tem como objetivo a prestação de serviços de administração fiduciária para gestores terceiros, possuindo para tanto equipe técnica especializada na análise de riscos de mercado, entre eles liquidez de mercado, enquadramento e monitoramento dos prestadores de serviços.</p>																								
Apresentação detalhada do Gestor:	<p>CAPTALYS GESTÃO LTDA, inscrita no CNPJ sob o nº 13.703.306/0001-56, com sede na Rua Doutor Renato Paes de Barros, 1017, 10º andar, Itaim Bibi, São Paulo, SP, autorizada pela CVM para o exercício profissional de administração de carteiras de valores mobiliários, por meio do Ato Declaratório nº 11.865 de 04 de Agosto de 2011. A atuação da Captalys tem como objetivo realizar a gestão dos ativos financeiros integrantes da carteira do Fundo, negociar e contratar em nome do Fundo os ativos financeiros e os intermediários para realizar operações em nome do Fundo, bem como firmar, quando necessário, todo e qualquer contrato ou documento relativo à negociação e contratação dos ativos financeiros e de seus referidos intermediários, representando o Fundo para todos os fins de direito para essa finalidade.</p>																								
Demaís Prestadores de Serviços do Fundo:	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Serviço:</th> <th>Prestador:</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Custódia</td> <td>SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A.</td> </tr> <tr> <td>Escrituração</td> <td>SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A.</td> </tr> <tr> <td>Controladoria</td> <td>SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A.</td> </tr> <tr> <td>Distribuição</td> <td>ATIVA INVESTIMENTOS S.A. CORRETORA DE TÍTULOS, CÂMBIO E VALORES</td> </tr> <tr> <td>Distribuição</td> <td>CAPTALYS GESTAO LTDA</td> </tr> <tr> <td>Distribuição</td> <td>FUTURAINVEST DTVM LTDA</td> </tr> <tr> <td>Distribuição</td> <td>BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A</td> </tr> <tr> <td>Distribuição</td> <td>SANTANDER SECURITIES SERVICE BRASIL DTVM S/A</td> </tr> <tr> <td>Consultoria de Investimentos</td> <td>N/A</td> </tr> <tr> <td>Auditoria</td> <td>KPMG</td> </tr> </tbody> </table>			Serviço:	Prestador:	Custódia	SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A.	Escrituração	SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A.	Controladoria	SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A.	Distribuição	ATIVA INVESTIMENTOS S.A. CORRETORA DE TÍTULOS, CÂMBIO E VALORES	Distribuição	CAPTALYS GESTAO LTDA	Distribuição	FUTURAINVEST DTVM LTDA	Distribuição	BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	Distribuição	SANTANDER SECURITIES SERVICE BRASIL DTVM S/A	Consultoria de Investimentos	N/A	Auditoria	KPMG
Serviço:	Prestador:																								
Custódia	SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A.																								
Escrituração	SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A.																								
Controladoria	SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A.																								
Distribuição	ATIVA INVESTIMENTOS S.A. CORRETORA DE TÍTULOS, CÂMBIO E VALORES																								
Distribuição	CAPTALYS GESTAO LTDA																								
Distribuição	FUTURAINVEST DTVM LTDA																								
Distribuição	BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A																								
Distribuição	SANTANDER SECURITIES SERVICE BRASIL DTVM S/A																								
Consultoria de Investimentos	N/A																								
Auditoria	KPMG																								
O Gestor vota em assembleia dos ativos que compõem a carteira do FUNDO (1 - Sim ou 2 - Não)	2																								

<p>Em caso positivo, descrever ao lado a política relativa ao exercício de direito de voto e indicar o sítio da rede mundial de computadores onde pode ser encontrada a versão integral da política de exercício de voto do Gestor:</p>	
<p>O Distribuidor oferta para o público alvo do FUNDO, preponderantemente, fundos geridos por um único gestor ou por gestoras ligadas a um mesmo grupo econômico (1 - Sim ou 2 - Não)</p>	1
<p>Descrição detalhada da forma de distribuição de cotas</p>	<p>A Captalys irá distribuir as cotas do Fundo através de sua área de distribuição, não utilizando para esse fim agentes autônomos. A distribuição se dará através de prospecção de clientes/investidores, identificação do perfil de investimento, aprovação e abertura do relacionamento e oferta de fundos.</p>
<p>O FUNDO possui agência de classificação de rating (1 - Sim ou 2 - Não) Em caso positivo, preencher as informações abaixo:</p>	2
<p>Denominação da Agência de Classificação de Risco:</p>	N/A
<p>Indicar CNPJ da Agência de Classificação de Risco:</p>	N/A
<p>Informar classificação obtida pela Agência de Classificação de Rating contratada:</p>	N/A
<p>Inserir o disclaimer sobre a manutenção do serviço:</p>	N/A
<p>Local, meio e forma de divulgação de informações:</p>	
<p>Meio de Divulgação (1 - Eletrônico ou 2 - Físico)</p>	1
<p>Local de Divulgação de Informações</p>	Correio eletrônico do cotista cadastrado e site do ADMINISTRADOR: www.s3dtvm.com.br
<p>Forma de Solicitação de Informações</p>	Por meio do correio eletrônico: admfiduciaria@santander.com.br
<p>Indicar periodicidade mínima para divulgação da composição da Carteira do FUNDO (Art. 59)</p>	Mensalmente, até 10 (dez) dias após o encerramento do mês
<p>Responsável pela divulgação da Carteira do FUNDO</p>	ADMINISTRADOR
<p>Exposição, em ordem de relevância, dos fatores de risco inerentes à composição da carteira do FUNDO:</p>	

- (i) Risco de Mercado
- (ii) Risco de Crédito
- (iii) Risco de Liquidez
- (iv) Risco Decorrente de Operações nos Mercados de Derivativos
- (v) Risco de Perdas Patrimoniais
- (vi) Risco Relacionado ao Resgate de Cotas nos Fundos de Investimento Investidos
- (vii) Risco de Concentração
- (viii) Risco Cambial
- (ix) Risco Relacionados aos Fundos de Investimento Investidos
- (x) Risco Para ativos registrados na Cetip S.A. – Mercados Organizados (“Cetip”)
- (xi) Riscos Gerais

Descrição da política de administração de risco, em especial dos métodos utilizados pelo Administrador para gerenciar os riscos a que o FUNDO se encontra sujeito, inclusive risco de liquidez:

Compete ao GESTOR o processo de análise/seleção de ativos a compor a carteira do fundo, a qual sempre seguirá as normas e o Regulamento do Fundo. Em busca do melhor desempenho do fundo, o GESTOR definirá o grau de concentração da carteira do Fundo. Independente da diligência do GESTOR na seleção dos ativos, as alocações estão sujeitas a flutuações de mercado e riscos de crédito, que podem gerar depreciação dos ativos, não atribuíveis à atuação do GESTOR. Eventual concentração de investimentos do FUNDO em algum(s) emissores pode aumentar a exposição da carteira aos riscos mencionados aumentando a volatilidade das cotas.

A área de Riscos do GESTOR e do ADMINISTRADOR são responsáveis pelo controle do risco e pelo cumprimento da política de investimento do FUNDO. Tais áreas encontram-se separadas das áreas Comercial e de Gestão e utilizam modelos internacionalmente aceitos para controle de risco. Cabe ao GESTOR escolher o método aplicável para fins de monitoramento do risco de mercado quando da alocação dos ativos, sendo o ADMINISTRADOR responsável ter limites próprios para controle do risco ex-post, (pós-alocação), de modo a questionar o GESTOR caso necessário.

Políticas de Controle de Riscos Provenientes de:

Mercado: o risco de mercado pode ser monitorado pelo V@R (Value at Risk) ou Valor em Risco, Teste de Estresse entre outros equivalentes. O VaR é um método estatístico amplamente utilizado para determinação de perdas potenciais de uma carteira em condições normais de mercado.

Crédito: para ativos de crédito privado, o GESTOR enviará ao ADMINISTRADOR uma “Carta de Ciência para Aquisição de Ativos de Crédito Privado”, a qual atesta sua ciência quanto aos riscos no investimento, sem prejuízo da solicitação pelo ADM, CONTROLADOR ou AUDITOR maiores detalhes da operação;

Liquidez: considera os perfis de liquidez dos ativos investidos. O fundo deve ter liquidez suficiente para atender às necessidades de resgate dos clientes de acordo com o seu histórico de resgates, sem prejuízo dos níveis de rentabilidade do fundo.

Derivativos: análogos aos de mensuração do risco de mercado.

Mercado Externo: os requisitos legais, tributários e/ou regulatórios dos países nos quais os ativos financeiros são negociados poderão afetar a performance dos fundos, bem como a variação cambial aliada às conjunturas políticas e macroeconômicas destes países, contudo, mesmo com toda diligência descrita, outros fatores de risco podem ocasionar perdas ao fundo e assim, aos cotistas.

Descrição da tributação aplicável ao FUNDO e a seus cotistas, contemplando a política a ser adotada pelo Administrador quanto ao tratamento tributário perseguido:

Imposto de Renda (“IR”): Os rendimentos das aplicações dos Cotistas em fundos de investimento de longo prazo estarão sujeitos às tributações: (i) no resgate, a contar da aplicação, o rendimento produzido sofrerá a incidência do IR às alíquotas de: (a) 22,5% quando efetuado até 180 (cento e oitenta) dias; (b) 20% quando efetuado após 180 (cento e oitenta) dias até 360 (trezentos e sessenta) dias; (c) 17,5% quando efetuado após 360 (trezentos e sessenta) dias até 720 (setecentos e vinte) dias; e (d) 15% quando efetuado após 720 (setecentos e vinte) dias.

Nessa ocasião, somente para os fundos abertos, os valores adiantados quando da ocorrência dos come-cotas semestrais serão descontados para fins de determinação do montante a ser efetivamente recolhido aos cofres públicos; e semestral, com a incidência adicional e periódica de IR nos meses de maio e novembro, à alíquota de 15% (come-cotas) sobre os rendimentos produzidos no período.

Na hipótese do prazo médio da carteira do Fundo permanecer igual ou inferior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias por mais de 3 (três) vezes ou por mais de 45 (quarenta e cinco) dias no ano, o Cotista passará a ser tributado conforme tributações aplicáveis aos fundos de investimento de curto prazo, quais sejam: (i) no resgate, a contar da aplicação, o rendimento produzido sofrerá a incidência do IR às alíquotas de: (a) 22,5% quando efetuado até 180 (cento e oitenta) dias; e (b) 20% quando efetuado após 180 (cento e oitenta) dias.

Nessa ocasião, somente para os fundos abertos, os valores adiantados quando da ocorrência dos come-cotas semestrais serão descontados para fins de determinação do montante a ser efetivamente recolhido aos cofres públicos; e semestral, com a incidência adicional e periódica de IR, nos meses de maio e novembro, à alíquota de 20% (come-cotas) sobre os rendimentos produzidos no período.

IOF/Títulos: resgates ocorridos nos primeiros 30 (trinta) dias a contar da data da aplicação estão sujeitos a incidência de IOF, conforme Anexo do Decreto 6306/2007. Caso o resgate ocorra após a 30 (trinta) dias a alíquota do IOF estará zerada.

Demais informações relevantes ao investidor:

PARA MAIS INFORMAÇÕES SOBRE OS FATORES DE RISCO, O INVESTIDOR DEVE CONSULTAR O REGULAMENTO DO FUNDO. OS MÉTODOS UTILIZADOS PELO ADMINISTRADOR PARA GERENCIAR OS RISCOS A QUE O FUNDO ESTÁ SUJEITO NÃO CONSTITUEM GARANTIA CONTRA EVENTUAIS PERDAS PATRIMONIAIS QUE POSSAM SER INCORRIDAS PELO FUNDO.

APLICAÇÃO INICIAL: R\$5.000,00

APLICAÇÃO ADICIONAL: R\$5.000,00

RESGATE: Sem carência. O pagamento será efetuado em D+1 após a conversão de cotas.

SALDO MÍNIMO: R\$5.000,00

SAC/OUVIDORIA

SAC - Para reclamações, cancelamentos, sugestões e informações gerais, o cotista poderá entrar em contato todos os dias da semana, durante 24 horas do dia, no telefone: 0800.762.7777. Caso o cotista encontre-se no exterior, o telefone para contato será: (+55) (11) 3012.3336.

OUVIDORIA – Caso o cotista não fique satisfeito com a solução apresentada, poderá entrar em contato no telefone: 0800.726.0322, apenas de segunda à sexta feira, das 9h às 18horas, exceto feriados. O cotista pode, ainda, encaminhar correspondência para o seguinte endereço: Rua Domingos Marchetti n. 77, Térreo B, CEP n. 02712-150.

SAC e Ouvidoria atendem deficientes auditivos e de fala.

[Maiores informações relevantes ao investidor podem ser inseridas neste espaço]