

FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

CA INDOSUEZ ICATU PREVIDÊNCIA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
CRÉDITO PRIVADO

CNPJ/MF nº 12.796.193/0001-18

(“Fundo”)

COMPETÊNCIA: DEZEMBRO/2017

DATA DE GERAÇÃO: 15/12/2017

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 DESTES FUNDOS 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 FORMULÁRIOS 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 DESTE 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-ingosuez.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.
- III. Risco de Liquidez.
- IV. Risco Proveniente do Uso de Derivativos.
- 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 (www.creditagricoledtm.com.br), 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**

Atualmente, a carteira de ativos financeiros do Fundo não está sujeita à tributação.

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).

O tratamento tributário do Fundo é o de um fundo de investimento cuja carteira seja composta por títulos com prazo médio superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias.

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

A tributação aplicável ao Fundo respeitará sempre a legislação em vigor, a qual está sujeita a alterações.

- **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



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os fundos de investimento.

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 DA ADMINISTRADORA E GESTOR DO FUNDO**

CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A DTVM, instituição financeira com sede na capital de São Paulo, na Alameda Itu, 852 – 16º andar, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 01.638.542/0001-57, credenciada pela CVM para o exercício da atividade de administração de carteira por meio do Ato Declaratório CVM nº 5.719 de 18 de novembro de 1999 e aderente ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento. A **CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A DTVM** é a responsável pelos serviços de administração, gestão e distribuição do Fundo.

BREVE HISTÓRICO DA CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A. DTVM

A **CA INDOSUEZ WEALTH (BRAZIL) S.A DTVM** dedica-se basicamente à administração de fundos de investimentos e recursos de terceiros, sendo uma sociedade 100% controlada pelo Grupo Crédit 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: ERNST & YOUNG TERCO AUDITORES INDEPENDENTES S.S

Consultor de Investimento: ICATU CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os fundos de investimento.

- **POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO**

O principal distribuidor do Fundo é o Administrador, o qual atua por meio dos seus canais de distribuição internos para diversos segmentos de mercado. 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**

REGRAS DE MOVIMENTAÇÃO

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

Resgate: D+1 (valor de fechamento do 1º (primeiro) dia útil subsequente à respectiva solicitação de resgate – Data de Conversão).

Pagamento de Resgate: D+2 (o resgate de cotas será pago no prazo de 2 (dois) dias uteis, contado da data de conversão de cotas).

Aplicação Inicial: Não há

Movimentação Mínima: Não há

Saldo Mínimo: Não há

REMUNERAÇÃO DO ADMINISTRADOR E DO CUSTODIANTE

Taxa de Administração: 0,80% (oitenta centésimos por cento) ao ano.

Taxa Máxima de Custódia: 0,077% (setenta e sete milésimos por cento) ao ano.

Taxa de Performance: Não há

Taxa de Ingresso: Não há

Taxa de Saída: Não há

Tipo Anbima: Previdência Renda Fixa

Descrição do Tipo Anbima: Fundos que buscam retorno por meio de investimentos em ativos de renda fixa (sendo aceitos títulos sintetizados através do uso de derivativos), admitindo-se estratégias que impliquem em risco de juros e de índice de preços do mercado doméstico. Excluem-se estratégias que impliquem risco de moeda estrangeira ou de renda variável (ações etc.). Não admitem alavancagem.

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: cadtvm@ca-indosuez.com.br

Ouvidoria: 0800 724 2818

e-mail: ouvidoria@ca-indosuez.com.br

site: www.creditagricoledtvm.com.br

CA Indosuez Wealth (Brazil) S.A. DTVM

São Paulo
Alameda Itu, 852
15º andar Jardim Paulista
SP BRASIL 01421-002
T +55 11 3896 6312
F +55 11 3896 6251

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