

FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

CA INDOSUEZ ALLOCATION ACTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES

CNPJ/MF nº 11.888.706/0001-58

(“Fundo”)

COMPETÊNCIA: Fevereiro/2020

DATA DE GERAÇÃO: 28/02/2020

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 DESTA 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 APLICA EM FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE UTILIZAM ESTRATÉGIAS QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA 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.

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 DESTA 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 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 cadvvm@ca-indsuez.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.

I. Risco relacionado a fatores macroeconômicos e regulatórios: relativo aos efeitos da política econômica praticada pelo Governo e demais variáveis exógenas, tais como a ocorrência, no Brasil ou no exterior, de fatos extraordinários ou de situações especiais de mercado ou, ainda, de eventos de natureza política, econômica, financeira ou regulatória que influenciem de forma relevante o mercado financeiro brasileiro. Medidas do Governo brasileiro para controlar a inflação e implementar as políticas econômica e monetária envolveram, no passado recente, alterações nas taxas de juros, desvalorização da moeda, controle de câmbio, controle de tarifas, controles do setor, mudanças legislativas, entre outras. Tais políticas, bem como outras condições macroeconômicas, têm impactado significativamente a economia e o mercado de capitais nacional. A adoção de medidas que possam resultar na flutuação da moeda, indexação da economia, instabilidade de preços, elevação de taxas de juros ou influenciar a política fiscal vigente poderão impactar nos negócios do Fundo. Além disso, o Governo Federal, o Banco Central do Brasil e demais órgãos competentes poderão realizar alterações na regulamentação dos setores de atuação do Fundo, o que poderá dificultar e/ou diminuir a sua performance;

II. Risco de mercado: os ativos financeiros do Fundo, bem como os ativos dos fundos em que o Fundo investe, são contabilizados a valor de mercado ou da forma estabelecida pelos respectivos regulamentos, o que é afetado por fatores econômicos gerais e específicos como, por exemplo, ciclos econômicos, alteração de legislação e de política econômica, situação econômico-financeira dos emissores dos títulos, podendo, dessa forma, causar oscilações nos preços dos ativos financeiros que compõem a carteira, podendo levar a uma depreciação do valor da cota do Fundo;

III. Risco de crédito: caracteriza-se principalmente pela possibilidade de inadimplemento das contrapartes em operações realizadas com o Fundo ou dos emissores de ativos financeiros integrantes da carteira, podendo ocorrer, conforme o caso, perdas financeiras até o montante das operações contratadas e não liquidadas, assim como o valor dos rendimentos e/ou do principal dos ativos financeiros.

IV. Risco de Liquidez: as aplicações no Fundo estão sujeitas a riscos de liquidez no tocante ao resgate de cotas. Tendo em vista as características dos ativos financeiros que podem compor a carteira do Fundo, este pode não apresentar liquidez para efetuar pagamentos em dinheiro relativos ao resgate de cotas no caso de (i) falta de liquidez dos mercados nos quais os ativos financeiros integrantes da carteira são negociados, e/ou (ii) condições atípicas de mercado. Caso o Fundo precise vender ativos financeiros ou caso os cotistas recebam tais ativos como pagamento de resgate, (i) poderá não haver mercado comprador ou o preço de alienação de tais direitos poderá resultar em perda para o Fundo

ou, conforme o caso, (ii) o cotista poderá enfrentar demora no recebimento dos recursos investidos. Não há, portanto, qualquer garantia ou certeza de que será possível ao Fundo e aos cotistas, conforme o caso, liquidar posições ou realizar os ativos financeiros, respectivamente, de sua carteira ou propriedade, pelo preço e no momento desejados;

V. Risco pela utilização de derivativos: as estratégias com derivativos utilizadas pelo Fundo podem aumentar a volatilidade da sua carteira. O preço dos derivativos depende, além do preço do ativo base no mercado à vista, de outros parâmetros de precificação, baseados em expectativas futuras. Mesmo que o preço do ativo base permaneça inalterado, pode ocorrer variação nos preços dos derivativos e conseqüentemente, ganhos ou perdas. Os preços dos ativos e dos derivativos podem sofrer descontinuidades substanciais afetados por eventos isolados.

VI - Risco de resgate em ativos financeiros do Fundo: poderá haver pagamento de resgates em ativos financeiros integrantes da carteira do Fundo e os cotistas poderão encontrar dificuldades para negociar os ativos recebidos do Fundo no mercado secundário;

VII - Risco de concentração: a eventual concentração de investimentos em determinado(s) ativo(s) financeiro(s) em que o Fundo investe, pode aumentar a exposição da carteira aos riscos mencionados acima e conseqüentemente, aumentar a volatilidade do Fundo, uma vez que, independentemente da diversificação da carteira do Fundo, sua política de investimento permite a concentração das aplicações, sendo que o risco é diretamente proporcional à concentração das aplicações do Fundo;

VIII - Risco de investimento em ações: o Fundo poderá investir em fundos de investimento que detenham em suas carteiras, ativos financeiros de companhias fechadas e abertas, cujos preços são negociados em bolsa de valores, ou não, conforme o caso, variando de acordo com os diferentes cenários macro e micro-econômicos. Mudanças nas políticas monetária e cambial, medidas fiscais, assim como modificações nas projeções de lucro e outras situações específicas de cada empresa, poderão causar impacto no preço das ações;

IX - Risco de aplicação em fundos de investimento: tendo em vista a natureza do Fundo, o Fundo está sujeito a todos os riscos referentes às políticas de investimento de cada fundo em que o Fundo eventualmente investir;

X - Risco de mercado externo: O Fundo poderá aplicar em fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros negociados no exterior e, conseqüentemente, sua performance pode ser afetada por requisitos legais ou regulatórios, por exigências tributárias relativas a todos os países nos quais haja investimento ou, ainda, pela variação do Real em relação a outras moedas. Tais investimentos estarão expostos a alterações nas condições política, econômica ou social nos países onde investe, o que pode afetar negativamente o valor de seus ativos financeiros. Podem ocorrer atrasos na transferência

de juros, dividendos, ganhos de capital ou principal, entre países onde haja o investimento e o Brasil, o que pode interferir na liquidez e no desempenho do fundo investido, e conseqüentemente para o Fundo; e

XI - Inexistência de garantia de eliminação de riscos: a realização de investimentos no Fundo expõe o investidor aos diversos riscos a que os ativos financeiros do Fundo estão sujeitos, que poderão acarretar perdas para os cotistas. Em condições adversas de mercado, as rotinas e procedimentos de gerenciamento de riscos das aplicações do Fundo mantido pelo Administrador poderá ter sua eficiência reduzida, de forma que não há qualquer garantia de eliminação da possibilidade de perdas para o Fundo e para os cotistas.

- **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.

Os rendimentos auferidos pelos Cotistas nas aplicações efetuadas no Fundo estão sujeitos ao Imposto de Renda retido na Fonte (“IRF”), no resgate das cotas, à alíquota de 15% (quinze por cento), conforme a legislação vigente.

O resgate de cotas está sujeito a alíquota zero do IOF regressivo, quando do resgate e cessão de cotas em prazo inferior a 30 (trinta) dias contados das aplicações.

- **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 o administrador 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 DTVM, 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 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: 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 composta por uma taxa de administração mínima de 1,00% a.a (um por cento), que não inclui a taxa de administração dos fundos em que o Fundo investe, e uma taxa de administração máxima de 4,0% a.a (quatro por cento), compreendendo, além da taxa mínima anteriormente mencionada, a taxa de administração dos fundos em que o Fundo investe.

Taxa de Custódia

0,077% a.a

Taxa de Performance

20% do que exceder o 100% da variação do IBOVESPA no período, calculada diariamente, provisionada diariamente por dia útil, e paga a cada período de 6 (seis) meses, até o 5º (quinto) dia útil subsequente à data do término de cada período de apuração ou, ainda, antecipadamente, por ocasião do resgate de cotas.

Taxa de Ingresso

Não há

Taxa de Saída

Não há

REGRAS DE MOVIMENTAÇÃO

Aplicação: D+1 (valor da cota em vigor no 1º (primeiro) dia útil subsequente à efetiva disponibilidade dos recursos).

Resgate: D+31 (valor de fechamento do 31º (trigésimo primeiro) dia corrido 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 úteis, contado da data de conversão de cotas).

Tipo de Cota: Cota de Fechamento

Aplicação Inicial: R\$ 1.000,00 (mil reais)

Movimentação Mínima: R\$ 1.000,00 (mil reais)

Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00 (mil reais)

Tipo Anbima: Ações Índice Ativo

Descrição do Tipo Anbima: Fundos que têm como objetivo superar o índice de referência do mercado acionário. Estes Fundos se utilizam de deslocamentos táticos em relação à carteira de referência para atingir seu objetivo.

- **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-ingosuez.com.br

Ouvidoria: 0800 724 2818

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

site: <https://brazil.ca-ingosuez.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-ingosuez.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-ingosuez.com.br

