

Competência	31/08/2017 ▾	Exibir
Nome do Fundo	BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO AÇÕES	
CNPJ do Fundo	11.108.013/0001-03	
Tipo do Fundo	FDOS DE INVESTIMENTO	
Cód. CVM	129640	
Administrador	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A	
CNPJ do Administrador	01.522.368/0001-82	

Formulário de Informações Complementares

Informações Complementares de código:

24041

CNPJ do fundo:

11.108.013/0001-03

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, Meio ou forma de divulgação

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

Site do ADMINISTRADOR (www.bnpparibas.com.br)

Descrição da forma de Divulgação:

Disponibilizada no site do ADMINISTRADOR

Local, Meio ou forma de divulgação cotista

Tipo do meio de divulgação: Eletrônico

Descrição de texto enviada pela instituição:

ADMINISTRADOR

Descrição do local de divulgação

mesadeatendimentobr.bnpparibas.com

Descrição da forma de divulgação

(11) 3049-2820 / mesadeatendimentobr.bnpparibas.com

Exposição, em ordem de relevância, dos fatores de riscos inerentes à composição da carteira do fundo

Mercado: variação dos preços dos ativos decorrente das condições de mercado quando de sua negociação; Crédito: inadimplência por parte das contrapartes e dos emissores dos títulos componentes da carteira; Liquidez: redução acentuada ou falta de demanda pelos ativos componentes da carteira; Concentração: a concentração em ativos de poucos emissores ou em determinadas modalidades de ativos potencializa o risco de inadimplemento; Restrição de Negociação: restrições de negociação dos ativos financeiros por parte das bolsas de valores e de mercadorias e futuros ou de órgãos reguladores, por conta do volume das operações, participação no volume de negócios e oscilações máximas de preços, entre outras; Precificação: a precificação dos ativos financeiros utiliza critérios e procedimentos para registro e avaliação que poderão ocasionar variações nos valores; Cambial: condições econômicas nacionais e internacionais podem afetar o mercado e resultar em alterações nas taxas de juros e câmbio; Regulatório: alterações nas normas ou leis aplicáveis podem causar um efeito adverso relevante no preço dos ativos e/ou na performance das posições financeiras; Derivativos: a utilização de instrumentos derivativos poderá acarretar variações no valor do patrimônio líquido dos fundos investidos e do FUNDO; Enquadramento Fiscal: alteração da regra tributária, criação de novos tributos, interpretação diversa da atual sobre a incidência de quaisquer tributos ou, ainda, da revogação de isenções Vigentes. Além dos riscos acima, o FUNDO poderá estar sujeito a outros riscos inerentes à aplicação em ativos financeiros em geral que podem afetar adversamente o desempenho do FUNDO e suas características operacionais.

Informações Políticas sobre o gestor

Informar se o gestor vota ou não em assembleias dos ativos que compõem a carteira: Sim

Descrição da política relativa ao exercício de direito do voto:

A GESTORA adota política de exercício de direito de voto em assembleias referentes aos Ativos Financeiros integrantes da carteira do FUNDO. A GESTORA baseará sua análise sobre a relevância da matéria objeto de deliberação, buscando sempre as melhores condições para os fundos, atuando com lealdade em relação aos interesses dos cotistas e do FUNDO, evitando, assim, práticas que possam ferir a relação fiduciária com eles mantida. A Política de Voto ficará disponível na página da GESTORA, na rede mundial de computadores, no site <http://www.bnpparibas.com.br> em "Asset Management". Excepcionalmente, a pedido da GESTORA, o ADMINISTRADOR poderá exercer a Política de Voto do FUNDO, nos termos acima, sob orientação da GESTORA e sob sua responsabilidade. O resumo do teor dos votos proferidos e a justificativa sumária do voto proferido ou as razões sumárias para eventual abstenção ou não exercício do direito de voto deverão ser incluídas no perfil mensal do FUNDO.

Descrição da tributação aplicável ao fundo e a seus cotistas, contemplando a política a ser adotada pelo administrador quanto ao tratamento tributário perseguido

A carteira do FUNDO está enquadrada como de renda variável para fins da legislação tributária em vigor. Cotistas: tendo em vista a composição da carteira do FUNDO, os cotistas estão sujeitos ao Imposto de Renda Fonte (IRF) de 15 nos resgates. IOF/Títulos: resgates em fundos classificados como renda variável nos termos da legislação tributária em vigor estão sujeitos à alíquota zero de IOF/Títulos. Fundo: A atual legislação fiscal estabelece que a carteira do Fundo não está sujeita à incidência de imposto de renda (IR). A atual legislação fiscal estabelece que os recursos do Fundo não estão sujeitos à incidência do IOF/Títulos. O cotista que de acordo com a legislação vigente não estiver sujeito ou estiver sujeito à tributação diferenciada do IR e do IOF, deverá apresentar ao ADMINISTRADOR documentação comprobatória.

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

A GESTORA possui Comitês de Risco por meio dos quais é definida uma carteira-modelo para os objetivos de performance, conforme Política de Investimento. A ADMINISTRADORA é responsável pela Política de Administração de risco do FUNDO, conforme segue: I- Risco de Mercado: A administração deste risco é avaliada, principalmente, através de projeções da perda esperada em cenários de stress (Stress testing), VR (Value at Risk) e Tracking Error para a parcela de Renda Variável, quando aplicável. A perda esperada em cenários de stress é calculada através da simulação dos efeitos produzidos na carteira frente a cenários de mercado adversos. Os referidos cenários estão baseados no modelo de margens da BMF, definidos através dos Comitês de Risco e projetam oscilações máximas e mínimas para os mercados em que o FUNDO atua. A administração de risco é efetuada através da utilização de modelos estatísticos que visam projetar, em condições normais de mercado, a máxima perda provável para o portfolio de investimentos do FUNDO, num dado horizonte de tempo, para um intervalo de confiança definido (VR - Value at Risk). O Tracking Error calcula a aderência do fundo em relação ao benchmark. Estas simulações são efetuadas em base diária, de modo a projetar o risco assumido pelo FUNDO com base em sua carteira atualizada. II- Risco de Crédito: A GESTORA utiliza uma política de atribuição de limites proporcionais à sua avaliação da qualidade do crédito dos títulos e emissores, que contempla: limite (do PL) por emissor ou título; limite (R) por emissor; limite (do PL) por emissor ou títulos na mesma categoria; e limite do montante da emissão ou do patrimônio do emissor. III- Risco de Liquidez: A administração deste risco requer planejamento para a gestão e operação sob condições normais de stress e deve ser consistente nas análises e medidas que permitam a projeção de liquidez dos recursos geridos, considerando-se também a cotização e o perfil do passivo do FUNDO e avaliar as opções sob várias condições de mercado, plano de contingência e manutenção de níveis adequados de liquidez a custos razoáveis. O ADMINISTRADOR e a GESTORA não adotam política específica para administrar os demais riscos. Não há garantia contra eventuais perdas patrimoniais que possam ser incorridas pelo FUNDO.

Informações de Risco

Informação se existe ou não agência de classificação de rating

Não

CNPJ

Nome do Prestador

Classificação obtida pela agência de classificação de risco de crédito contratada

Padronização do disclaimer relativo a advertência da manutenção do serviço pela CVM

Detalhamento do administrador

Apresentação do administrador

Razão Social: BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. CNPJ: 01.522.368/0001-82 Endereço: Av. Presidente Juscelino Kubitschek, nº 510, 1º, 10º a 14º andares, Itaim Bibi, São Paulo/SP
Autorização de Funcionamento: Autorização de Funcionamento nº 96.00639119, datada de 16/10/1996 e autorização a prestar os serviços de administração de carteiras de valores mobiliários por meio do Ato Declaratório CVM nº 4448 de 21 /08/1997. Informações Adicionais: O ADMINISTRADOR é filial do BNP Paribas, instituição financeira internacional, maior banco privado da França e um dos maiores da Europa, presente em mais de 80 países, no Brasil há mais de 50 anos através de um escritório de representação e desde 1996 como banco múltiplo. Em 10 de dezembro de 2008, a Standard Poor's Rating Services, atribuiu em sua escala nacional o rating de

crédito de contraparte 'brAAA' ao Banco BNP Paribas Brasil S.A. Dentre os principais serviços prestados pelo ADMINISTRADOR estão administração fiduciária, custódia, escrituração e distribuição de fundos de investimento. Quanto aos tipos de fundos de investimento administrados pelo ADMINISTRADOR, estes compreendem, em sua maioria, fundos de investimento regidos pela Instrução CVM 555/14. No desempenho das suas atividades, o ADMINISTRADOR emprega altos padrões de fidúcia e adota os mecanismos necessários, tanto físicos quanto eletrônicos, para evitar eventuais conflitos de interesse. O ADMINISTRADOR poderá renunciar à administração do FUNDO, ficando obrigado a convocar imediatamente a assembleia geral de cotistas para eleger o substituto, a se realizar no prazo de até 15 (quinze) dias, devendo o ADMINISTRADOR permanecer no exercício de suas funções até sua efetiva substituição, que deverá ocorrer no prazo máximo de 30 (trinta) dias, sob pena de liquidação do FUNDO pelo ADMINISTRADOR. As aplicações realizadas no FUNDO não contam com garantia do ADMINISTRADOR e/ou da GESTORA, ou, ainda, de qualquer mecanismo de seguro e do Fundo Garantidor de Créditos - FGC.

Apresentação do gestor de recursos

Razão Social: BNP Paribas Asset Management Brasil Ltda. CNPJ: 02.562.663/0001-25 Endereço: Av. Presidente Juscelino Kubitschek, nº 510, 14º andar, Itaim Bibi, São Paulo/SP Autorização de funcionamento: Ato Declaratório CVM nº 5.032, datado de 03 de setembro de 1998 Informações Adicionais: A GESTORA iniciou suas atividades em junho de 1998, é controlada pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A e pelo BNP Paribas Asset Management Group S.A.S., subsidiária do Grupo BNP Paribas para a gestão internacional de ativos. No desempenho de suas atividades, a GESTORA conta com profissionais altamente especializados e com experiência nos mercados financeiro e de capitais. A GESTORA possui uma ampla família de Fundos em diversas categorias, tais como: Fundos Renda Fixa Fundos Multimercados Fundos para Investidores Estrangeiros Fundos de Ações Fundos Previdenciários Fundos de Capital Protegido Fundos de Investimento no Exterior A estrutura da GESTORA divide-se nas seguintes áreas: Risco e Controles Compliance Governança Renda Variável (Long Only, Long Short, High Alpha, Equities Research) Renda Fixa, Multimercado, Pesquisa de Crédito Pesquisa Econômica, Asset Allocation Fundo de Fundos Produtos e Relacionamento com Investidores Alternativos e Estruturados A GESTORA utiliza sistemas de mercado para a administração das carteiras, largamente utilizados por outros gestores para essa finalidade, adequados e confiáveis, cujas atualizações sejam velozes e satisfatórias. Além disso, a equipe de gestão utiliza ferramentas para acompanhamento de mercado e plataformas de negociações, bem como consultorias econômicas. O Processo de Investimento e Análise da GESTORA conta com comitês formais periódicos, dentre eles: Comitê de Investimento, Crédito, Performance, Compliance, Liquidez, Risco e Produtos. A GESTORA adota mecanismos a fim de evitar conflitos de interesse, nos quais os interesses próprios da GESTORA possam ser divergentes ou conflitantes com os interesses dos cotistas.

Detalhamento do Serviço Prestado

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41: CUSTODIANTE

Nome do Prestador:

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

Detalhamento de Distribuição

Indicação se 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: Sim

Descrição detalhada

O serviço de distribuição consiste, basicamente, no agenciamento de clientes, pessoas jurídicas ou físicas, domiciliadas no país ou no exterior, inclusive outros fundos de investimento, de forma direta e/ou através do mecanismo de distribuição por conta e ordem, conforme previstos na regulamentação em vigor. Itaú Unibanco S.A., inscrito no CNPJ nº 60.701.190/0001-04 ("Distribuidor") é o principal distribuidor das cotas do FUNDO, podendo o Distribuidor contratar terceiros para prestar os referidos serviços, sob responsabilidade do Distribuidor. Os funcionários do ADMINISTRADOR, GESTORA e demais prestadores de serviço do FUNDO devem comunicar aos seus superiores imediatos potenciais conflitos de interesse, sejam relativos a análises, investimentos, operações com títulos e valores mobiliários, clientes ou potenciais clientes. O ADMINISTRADOR, a GESTORA e o Distribuidor, se for o caso, 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. O ADMINISTRADOR remunera o Distribuidor por meio de uma percentagem incidente sobre os recursos efetivamente captados por intermédio do Distribuidor, calculada sobre o montante pago pelo FUNDO a título de administração e performance, se houver.

Outras Informações**Informações sobre autorregulação anbima:**

CLASSIFICAÇÃO: Ações Small Caps DESCRIÇÃO: N1:Ações_Fundos que possuem, no mín, 67 da carteira em ações, bônus ou recibos de subscrição, cert de dep de ações, cotas de FIA, cotas dos fundos de índice de ações e BDR, Nível I, II e III, sendo o hedge cambial da parcela de ativos no exterior facultativo ao gestor. N2Ativos_Fundos com objetivo sup um índice referência ou sem referência a nenhum índice. A seleção dos ativos p/ compor a carteira deve ser suportada por um processo de invest que busca atingir os objetivos e exec a pol de investimento definida. Os recursos remanescentes em caixa devem estar investidos em cotas de Fundos RF/Duração Baixa/Grau de Investimento/Soberano ou em ativos permitidos a estes, desde que preservadas as regras que determinam a composição da carteira do Tipo ANBIMA, exceção feita aos fundos classe Livre. N3:Small Caps_Fundos com objetivo investir, no mínimo, 85 em ações que não estejam incluídas entre as 25 maiores do IBrX, ou seja, ações de empresas com relativamente baixa capitalização de mercado. Os 15 remanescentes podem ser investidos em ações de maior liquidez ou capitalização de mercado, desde que não estejam incluídas entre as dez maiores IBrX. ESTE FORMULÁRIO FOI PREPARADO COM AS INF NECESSÁRIAS AO ATENDIMENTO DO CÓDIGO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO, BEM COMO NORMAS CVM. A AUTORIZAÇÃO PARA FUNCIONAMENTO E/OU VENDA DAS COTAS IMPLICA, POR PARTE DA CVM OU ANBIMA, GARANTIA DE VERACIDADE DAS INF PRESTADAS, OU JULGAMENTO SOBRE A QUALIDADE DO FUNDO, DE SEU ADM OU DAS DEMAIS INSTIT PREST DE SERVIÇOS. ESTE FUNDO UTILIZA ESTRAT QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS P/ SEUS COTISTAS, PODENDO ACARRETAR PERDAS SUPERIORES AO CAPITAL APLICADO E A CONSEQUENTE OBRIG DO COTISTA DE APORTAR RECURSOS ADICIONAIS PARA COBRIR PREJUÍZOS DO FUNDO. O INVESTIMENTO DO FUNDO DE QUE TRATA ESTE FORM APRESENTA RISCOS P/ O INVEST. AINDA QUE O GESTOR DA CARTEIRA MANTENHA GERENCIAMENTO DE RISCOS, NÃO HÁ GARANTIA DE ELIMINAÇÃO DA POSSIBILIDADE DE PERDAS P/ O FUNDO E P/ O INVESTIDOR. ESTE FUNDO NÃO CONTA COM GARANTIA DO ADM, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEG, OU, AINDA, DO FGC. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA RENTABILIDADE FUTURA. AS INF CONTIDAS NESSE FORM ESTÃO EM CONSONÂNCIA COM O REGULAMENTO E NÃO O SUBSTITUEM. É RECOMENDADA A LEITURA DESTE FORM E DO REGUL, COM ATENÇÃO PARA AS CLÁUSULAS DO OBJETIVO E À POLÍTICA DE INVESTIMENTO DO FUNDO, BEM COMO ÀS DISP. DO FORM E DO REGUL QUE TRATAM DOS FATORES DE RISCO QUE O FUNDO ESTÁ EXPOSTO.

Demais informações relevantes ao investidor

LIMITES DO FUNDO PARA MOVIMENTAÇÃO Aplicação Inicial Mínima: R 25.000,00
Movimentação Mínima R 1.000,00 Valor Máx. de Aplicações N/A Saldo Mínimo R 1.000,00 Valor
Máx. de Resgates N/A Horário limite de movimentação 14:00 horas