ANEXO I – FUNDOS DE INVESTIMENTO

# 1. Alterações desde a última atualização

|  |  |
| --- | --- |
| **1.1** | Nome do fundo |
|  |
| **1.2** | CNPJ |
|  |
| **1.3** | Data de início |
|  |
| **1.4** | Classificação ANBIMA |
|  |
| **1.5** | Código ANBIMA |
|  |
| **1.6** | O fundo já sofreu alteração com perda de histórico de informação do mesmo? |
|  |
| **1.7** | Classificação tributária (CP/LP/Ações) |
|  |
| **1.8** | Descreva o público-alvo. |
|  |
| **1.9** | O regulamento prevê, explicitamente, adequação a alguma legislação específica aplicável ao cotista, p. ex., Resolução do CMN? |
|  |
| **1.10** | Conta corrente (banco, agência, nº) |
|  |
| **1.11** | Conta CETIP (nº) |
|  |
| **1.12** | Administração (indique contato para informações). |
|  |
| **1.13** | Custódia (indique contato para informações). |
|  |
| **1.14** | Auditoria externa |
|  |
| **1.15** | **Caso se aplique, informar:** |
| Escriturador |  |
| Custodiante |  |
| Consultor Especializado |  |
| Assessor Jurídico |  |
| Co-gestor |  |
| Distribuidor |  |
| Outros |  |
|  |
| **1.16** | Cotização: abertura ou fechamento? |
|  |
| **1.17** | **Regras para aplicação e resgate:** |  |
| Aplicação (datas, horários, cotização e liquidação) |  |
| Carência/Tempo mínimo para permanência (lock-up period) e eventuais penalidades para resgates antes do término desse período. |  |
| Resgate (datas, horários, cotização e liquidação) |  |
| Aplicação inicial mínima |  |
| Aplicação máxima por cotista |  |
| Aplicação adicional mínima |  |
| Resgate mínimo |  |
|  |
| **1.18** | Taxa de Entrada (upfront fee) |
|  |
| **1.19** | Taxa de Saída (redemption fee) |
|  |
| **1.20** | Taxa de administração |
|  |
| **1.21** | Taxa de administração máxima |
|  |
| **1.22** | Taxa de custódia máxima |
|  |
| **1.23** | Taxa de Performance |
| % (Percentual) |  |
| Benchmark |  |
| Frequência |  |
| Linha-d’água (sim ou não) |  |
| Método de cálculo (ativo/passivo/ajuste) |  |
|  |
| **1.24** | Despesas do fundo pagas ao grupo econômico do administrador (e da gestora, se este for diferente) excluindo-se as taxas de Administração e de Performance. |
|  |
| **1.25** | Há acordo de remuneração com cláusula de reversão de rebate para o fundo? (pagamento e/ou recebimento). |
|  |

# 2. Perfil

|  |  |
| --- | --- |
| **2.1** | Descreva o fundo no que tange à estratégia, ao objetivo de rentabilidade e à política de investimento. |
|  |
| **2.2** | Descreva as alterações significativas na estratégia ou na política de investimento no histórico do fundo. |
|  |
| **2.3** | Descreva o processo decisório de investimento deste fundo de investimento. |
|  |
| **2.4** | Cite as premiações, ratings e rankings dos últimos 05 anos. |
|  |

# 3. Equipe de gestão do fundo

|  |  |
| --- | --- |
| **3.1** | Cite os profissionais envolvidos na gestão |
|  |
| **3.2** | Cite o histórico de alterações significativas na equipe nos últimos 05 anos. |
|  |

# 4. Estratégias e carteiras

|  |  |
| --- | --- |
| **4.1** | Descreva as regras, procedimentos e limites específicos de gestão para o fundo, em cenários de stress. |
|  |
| **4.2** | O fundo pode realizar operações de day trade? |
|  |

# 5. Uso de derivativos

|  |  |
| --- | --- |
| **5.1** | Com que objetivo(s) são utilizados derivativos: |
| Proteção de carteira ou de posição | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Mudança de remuneração/indexador | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Estratégias combinadas (floors, caps, collars, spreads, straddles, box, financiamentos com termo etc.) | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Alavancagem | SIM ( ) NÃO ( ) |
|  |
| **5.2** | Mercados em que são utilizados derivativos: |
| Juros | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Câmbio | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Ações | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Commodities | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Em Bolsas: |
| Com garantia | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Sem garantia | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Em Balcão |
| Com garantia | SIM ( ) NÃO ( ) |
| Sem garantia | SIM ( ) NÃO ( ) |
|  |
| **5.3** | Qual a abordagem da gestora no investimento em ativos de crédito privado? |
|  |

# 6. Compra de cotas de fundos de investimento

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **6.1** | De fundos de terceiros? | SIM ( ) NÃO ( ) |
|  |
| **6.2** | De fundos da gestora? | SIM ( ) NÃO ( ) |
|  |

# 7. Informações adicionais

|  |  |
| --- | --- |
| **7.1** | PL atual. |
|  |
| **7.2** | PL médio em 12 (doze) meses. |
|  |
| **7.3** | PL atual da mesma estratégia sob gestão da gestora. |
|  |
| **7.4** | Qual a capacidade máxima estimada de captação de recursos do fundo e de sua estratégia? Quais são os critérios de definição? |
|  |
| **7.5** | Número de cotistas. |
|  |
| **7.6** | Qual percentual do passivo do fundo representa aplicações da gestora, controladores, coligadas, subsidiárias, de seus sócios e principais executivos? |
|  |
| **7.7** | Descreva as regras de concentração de passivo. |
|  |
| **7.8** | Percentuais detidos pelos dez maiores cotistas. |
|  |
| **7.9** | Houve alguma mudança de prestadores de serviços de administração fiduciária e/ou de custódia nos últimos 05 anos da operação do fundo? Quando?  |
|  |
| **7.10** | A última demonstração financeira foi emitida com obteve algum parecer modificado (com ressalva, com abstenção de opinião, ênfase, parecer adverso opinião) pelo auditor independente? |
|  |

# 8. Gestão de risco

|  |  |
| --- | --- |
| **8.1** | Descreva as regras de exposição a risco de crédito específicas do fundo. |
|  |
| **8.2** | Descreva as regras de liquidez para ativos específicas do fundo. |
|  |
| **8.3** | Caso o Fundo opere derivativos sem garantia, descreva como é realizado o controle. |
|  |
| **8.4** | Se houver na carteira do fundo, ativos/derivativos ilíquidos/exóticos, como a gestora realiza o acompanhamento? |
|  |
| **8.5** | Qual(is) a(s) metodologia(s) de controle de risco utilizada(s) (por ex.: VaR, Tracking Error e Expected Shortfall)? |
|  |
| **8.6** | Existem limites adicionais àqueles que constam no regulamento/regulação (por ex: concentração por setor, emissor, contraparte, tipo de risco)? Quais? |
|  |
| **8.7** | Descreva o processo decisório utilizado em caso de violação dos limites citados no item 8.5 |
|  |
| **8.8** | Qual o limite da(s) metodologia(s) citada no item 8.5? |
|  |
| **8.9** | De que forma é apurado o consumo dos limites dados pela(s) metodologia(s) citada(s) no item 8.5? |
|  |
| **8.10** | Considerando o período dos últimos 24 (vinte e quatro) meses, quando o limite da(s) metodologia(s) citadas no item 8.5 foi excedido, por qual motivo e qual o máximo atingido? Comente. |
|  |
| **8.11** | Qual o VaR/B-VaR/TE médio do Fundo nos últimos: |
| 3 meses? |  |
| 6 meses? |  |
| 12 meses? |  |
| 24 meses? |  |
|  |
| **8.12** | Qual a alavancagem nocional máxima (exposição bruta) atingida pelo fundo e em qual(is) ativo(s) nos últimos 24 (vinte e quatro) meses? |
|  |
| **8.13** | Qual o limite para perdas em cenário de stress? Como são definidos os cenários (ex. Utiliza o cenário elaborado pela B³ ou o próprio)? |
|  |
| **8.14** | Considerando o período dos últimos 24 (vinte e quatro) meses, quando o limite de stress foi excedido e por quê? |
|  |
| **8.15** | Qual o stress médio do fundo nos últimos |
| 3 (três) meses? |  |
| 6 (seis) meses? |  |
| 12 (doze) meses? |  |
| 24 (vinte e quatro) meses? |  |
|  |
| **8.16** | Comente o último stop loss relevante do fundo. |
|  |

# 9. Comportamento do fundo em crises

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Período\*** | **Evento** | **Comportamento (variação do fundo)** | Explicação |
| Mai/06 | Crise das Bolsas norte-americanas |  |  |
| Jul – Ago/07 | Crise das hipotecas |  |  |
| Out/08 – Mar/09 | Crise no Sistema Financeiro norte-americano |  |  |
| Jan/10 – Jun/10 | Crise de endividamento dos PIGS |  |  |
| Abril/11 – Set/11 | Segunda crise da dívida na Europa |  |  |
| Abril/15 – Ago/16 | Crise política / recessão no Brasil |  |  |
| \* Para o período solicitado deve ser informado o comportamento (variação do fundo) de acordo com o mês fechado (ex. 01/01 a 31/01). |

# 10. Três períodos de maior perda do fundo

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **Período** | **Evento** | **Perda** | **Explicação** | **Tempo para recuperação** |
| **1** |  |  |  |  |  |
| **2** |  |  |  |  |  |
| **3** |  |  |  |  |  |

# 11. Atribuição de performance do fundo nos últimos 5 (cinco) anos

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **11.1** | Atribuição: | Contribuição: |
|  |  |
|  |
| **11.2** | Comente as mudanças em estratégias em razão de fluxo de recursos (aplicações ou resgates). |
|  |
| **11.3** | O fundo já esteve fechado temporariamente para aplicação por deliberação da gestora, do administrador fiduciário ou órgão regulador? Quando? Por quê? |
|  |

# 12. Relacionamento com distribuidores/alocadores

|  |  |
| --- | --- |
| **12.1** | Com que grau de detalhamento e com que frequência a carteira pode ser disponibilizada para distribuidores/alocadores? |
|  |
| **12.2** | Com que frequência é possível realizar conference calls com a gestora dos fundos? |
|  |
| **12.3** | Por quais canais o fundo é distribuído? |
|  |
| **12.4** | Considerando o montante total de ativos sob gestão, qual o percentual detido pelos cinco maiores distribuidores ou alocadores, individualmente? |
|  |

# 13. Atendimento aos cotistas

|  |  |
| --- | --- |
| **13.1** | Quais os relatórios disponíveis aos cotistas do fundo? Fornecer detalhes. Qual sua periodicidade? Com que defasagem? |
|  |
| **13.2** | Qual (is) é (são) o(s) veículo(s) disponível(is) para acessar informações sobre o Fundo e com qual frequência seu conteúdo é atualizado? |
|  |
| **13.3** | Existe algum canal de atendimento dedicado ao cotista? De que forma pode ser acessado e qual o horário para atendimento? |
|  |

# 14. Investimento no exterior

|  |  |
| --- | --- |
| **14.1** | Qual o produto (tipo de ativo ou fundo investido) e sua estrutura, incluindo os veículos utilizados (se houver)? Descreva a estratégia, os principais ativos e instrumentos utilizados. |
|  |
| **14.2** | Quais os riscos envolvidos? |
|  |
| **14.3** | Quais são os mercados em que o fundo opera? |
|  |
| **14.4** | Em relação ao veículo local, o fundo utiliza estratégias para proteção cambial? |
|  |
| **14.5** | Caso o fundo de investimento local tenha por objetivo o investimento em único fundo de investimento ou veículo no exterior (fundo espelho), enumerar os prestadores de serviços e demais informações dos fundo de investimento ou veículo no exterior (administrador, custodiante, RTA, prime broker, entre outros). |
| Administrador Fiduciário |  |
| Custodiante |  |
| Auditor |  |
| RTA |  |
| Prime Brokers |  |
| NAV Calculator |  |
| Domicílio do fundo |  |
| Taxa de administração |  |
| Código ISIN do fundo |  |
| Moeda do domicilio fundo no exterior |  |
| Outros prestadores de serviço, dos investimentos no exterior, caso exista. |  |
|  |
| **14.6** | Caso o investimento no exterior possua subclasses, favor descrever os riscos de contaminação entre elas. |
|  |
| **14.7** | Caso a gestora tenha influência direta/indireta na gestão do fundo no exterior, descreva como foi constituída a diretoria do fundo. |
|  |

# 15. Anexos (quando aplicável)

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **15** | Anexos (quando aplicável) | Marcar Anexos ou link para acesso ao documento |
| **15.1** | Regulamento |  |
| **15.2** | Formulário de informações complementares |  |
| **15.3** | Última lâmina de informações essenciais |  |
| **15.4** | Relatório de Gestão e/ou materiais de divulgação |  |

[LOCAL, DATA]

|  |  |
| --- | --- |
| [ASSINATURA DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O QUESTIONÁRIO] | [ASSINATURA DO(S) REPRESENTANTE(S) LEGAL(IS) DA INSTITUIÇÃO] |
| [NOME DO PROFISSIONAL QUE PREENCHEU O QUESTIONÁRIO] | [NOME DO(S) REPRESENTANTE(S) LEGAL(IS) DA INSTITUIÇÃO] |
| [CARGO] | [CARGO] |
| [TELEFONE] | [TELEFONE] |
| [E-MAIL CORPORATIVO] | [E-MAIL CORPORATIVO] |