FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

CA INDOSUEZ DEBÊNTURES INCENTIVADAS CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

CNPJ/MF n° 18.623.722/0001-68

("Fundo")

COMPETÊNCIA: Agosto/2019
DATA DE GERAÇÃO: 13/08/2019

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 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 SERVIÇOS.

ESTE FUNDO APLICA EM FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE UTILIZAM ESTRATÉGIAS QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS COTISTAS, PODENDO INCLUSIVE ACARRETAR 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 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 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 cadtvm@ca-indosuez.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, consequentemente, seus Cotistas, estarão sujeitos, principalmente, aos riscos abaixo relacionados.

I - 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;

II - 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;

III - 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;

IV - 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 consequentemente, ganhos ou perdas. Os preços dos ativos e dos derivativos podem sofrer descontinuidades substanciais afetados por eventos isolados.

V - Risco Regulatório: As eventuais alterações nas normas ou leis aplicáveis ao Fundo e seus ativos financeiros, incluindo, mas não se limitando àquelas referentes a tributos, podem causar um efeito adverso relevante no preço dos ativos e/ou na performance do Fundo.

VI - Risco de resgate em ativos financeiros do Fundo: conforme previsto no Regulamento 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 consequentemente, 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 aplicação em fundos de investimento: tendo em vista a natureza do Fundo, este está sujeito a todos os riscos referentes às políticas de investimento de cada fundo em que o Fundo eventualmente investir;

IX - 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 (www.creditagricoledtvm.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 confiram 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).

Nos termos da Lei 12.431/11, os rendimentos auferidos pelos cotistas do Fundo por ocasião do resgate ou da alienação de cotas estarão sujeitos as seguintes alíquotas:

I – 0% (zero por cento), quando:

a) pagos, creditados, entregues ou remetidos a beneficiário residente ou domiciliado no exterior, que realizar operações financeiras no País de acordo com as normas e condições estabelecidas pelo Conselho Monetário Nacional, exceto em país que não tribute a renda ou que a tribute à alíquota máxima inferior a 20% (vinte por cento); e

b) auferidos por pessoa física

II – 15% (quinze por cento), quando se tratar de investidor pessoa jurídica.

Os cotistas dispostos na alínea "b" do inciso I e no inciso II sujeitam-se à incidência do imposto sobre a renda exclusivamente na fonte (IRRF).

Na hipótese de descumprimento dos limites estabelecidos para o Fundo e os fundos investidos, conforme a política de investimento, em um mesmo ano-calendário, (i) por período superior a 90 (noventa) dias consecutivos ou alternados, ou (ii) em mais de 3 (três) ocasiões distintas, os rendimentos auferidos pelos Cotistas a partir do dia útil imediatamente posterior à data do referido descumprimento estarão sujeitos as seguintes alíquotas:

I. 22,5% (vinte e dois inteiros e cinco décimos por cento), em aplicações com prazo de até 180 (cento e oitenta) dias;

II. 20% (vinte por cento), em aplicações com prazo de 181 (cento e oitenta e um) dias até 360 (trezentos e sessenta) dias;

III. 17,5% (dezessete inteiros e cinco décimos por cento), em aplicações com prazo de 361 (trezentos e sessenta e um dias) até 720 (setecentos e vinte) dias;

IV. 15% (quinze por cento), em aplicações com prazo acima de 720 (setecentos e vinte) dias.

Os rendimentos obtidos pelos cotistas em razão das aplicações no Fundo estão sujeitos à incidência do Imposto sobre Operações Financeiras - IOF incidente de forma decrescente em resgates efetuados até o 29º (vigésimo nono) dia contado da aplicação, nos termos do Decreto nº 4.494, de 03.12.2002.

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.

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

Não obstante os esforços do Administrador, não há garantia de que o Fundo receberá o tratamento tributário previsto na Lei 12.431/11.

- **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, consequentemente, 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 Alameda Itu, 852 – 16° andar, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 01.638.542/0001-57 ("Administrador"), 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 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: ERNST & YOUNG TERCO AUDITORES INDEPENDENTES S.S

- **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 0,80% (oitenta centésimos por cento), que não inclui a taxa de administração dos fundos em que o Fundo investe, e uma taxa de administração máxima de 1,20% (um virgula vinte 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 IMA-B5 (Índice de Mercado ANBIMA – Índice de Referência) 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
5% sobre o total resgatado, caso o cotista venha a solicitar a conversão do valor do resgate em um prazo inferior ao estabelecido no regulamento do Fundo.

REGRAS DE MOVIMENTAÇÃO

COM ISENÇÃO DA TAXA DE SAÍDA

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

Resgate: D+30 (valor da cota do 30º (trigésimo) dia corrido subsequente ao pedido de resgate – Data de Conversão).

Pagamento de Resgate: D+1 (o resgate de cotas será pago no prazo de um dia útil a partir da Data da Conversão).

Alternativamente, mediante o pagamento de taxa de saída de 5% (cinco por cento) sobre o valor total resgatado, o cotista poderá solicitar a conversão do valor do resgate em um prazo inferior ao estabelecido anteriormente.

MEDIANTE A COBRANÇA DA TAXA DE SAÍDA

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

Resgate: D+0 (valor da cota em vigor no dia da respectiva solicitação do resgate – Data de Conversão).

Pagamento de Resgate: D+1 (o resgate de cotas será pago no prazo de um dia útil a partir da Data da Conversão).

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: Multimercados Estratégia Específica.

Descrição do Tipo Anbima: Fundos que adotam estratégia de investimento que implique riscos específicos, tais como commodities, futuro de índice.

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