



BNP PARIBAS OPTIMUM DI FIC FI REFERENCIADO

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO: FEVEREIRO/2017

Renda Fixa

CARACTERÍSTICAS GERAIS

CNPJ: 02.539.893/0001-73
Renda Fixa Duração Baixa
ANBIMA Grau de Invest. (Cód.: 57150)
Público Alvo: Investidores em Geral
Regime de Cotas: Abertura
Início das Atividades: 06/07/1998

Tx. de Administração: 0,50% a.a.
Tx. de Performance: Não há
Tx. de Entrada / Saída: Não há

Aplicação: D+0
Resgate (Conv./Pgto): D+0 / D+0
Horário de Mov.: 16h00min
Aplicação Inicial: R\$ 5.000
Movimentação: R\$ 5.000
Saldo Mínimo: Não há
Tributação: Busca Longo Prazo

Gestão: BNP Paribas Asset Management
Administração: Banco BNP Paribas
Custódia: Banco BNP Paribas
Distribuição: Banco BNP Paribas

LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES
COMPLEMENTARES E O REGULAMENTO ANTES DE
INVESTIR

OBJETIVO E POLÍTICA DE INVESTIMENTO DO FUNDO

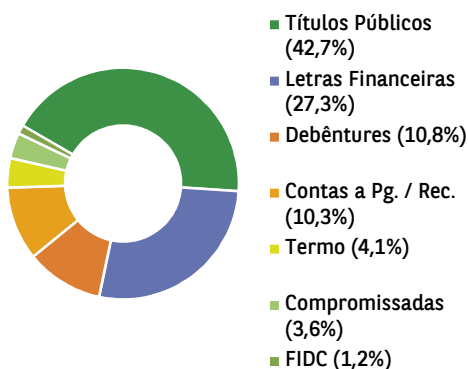
Acompanhar a variação do CDI, investindo no mínimo 95% de sua carteira em cotas do BNP Paribas Master DI FI RF Referenciado, que investe preponderantemente em títulos públicos e privados atrelados direta ou indiretamente ao CDI.

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

Período	2016 (%)			2017 (%)		
	Fundo	CDI	% CDI	Fundo	CDI	% CDI
Janeiro	1,00	1,05	94,67	1,07	1,08	98,46
Fevereiro	0,95	1,00	94,42	0,89	0,86	102,67
Março	1,14	1,16	98,05			
Abril	1,06	1,05	100,86			
Maio	1,11	1,11	100,66			
Junho	1,16	1,16	100,20			
Julho	1,11	1,11	99,79			
Agosto	1,30	1,21	106,81			
Setembro	1,09	1,11	98,44			
Outubro	1,04	1,05	99,48			
Novembro	1,03	1,04	99,28			
Dezembro	1,09	1,12	97,22			
Acum. Ano	13,89	14,00	99,22	1,96	1,96	100,33

Período	Fundo	CDI	% CDI
Últimos 12 Meses	13,90	13,88	100,17
Últimos 24 Meses	29,14	29,35	99,31
Últimos 36 Meses	43,15	43,51	99,17
Desde o início	1230,94	1223,93	100,57

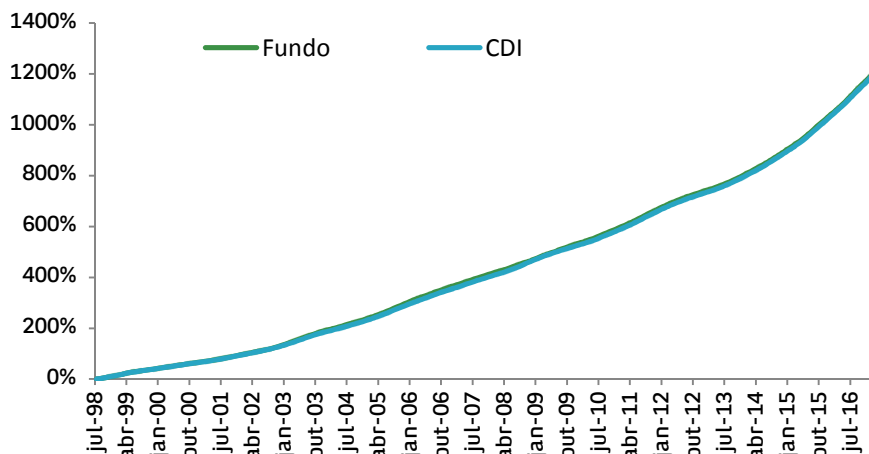
COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA*



*Do fundo BNP Paribas Master DI FI RF Referenciado.

RENTABILIDADE ACUMULADA ATÉ

24/02/2017



Para Investir:

São Paulo

Rio de Janeiro

Curitiba

Belo Horizonte

Brasília

Pessoas Físicas 11 3841-3130
Inv. Institucionais 11 3049-2820

21 3213-8200 41 3071-7250 21 3213-8200 21 3213-8200



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

INDICADORES FINANCEIROS

Patrimônio Líq. em 24/02/2017* 174.134
 PL Médio 12 Meses* 163.022

*R\$ - Mil

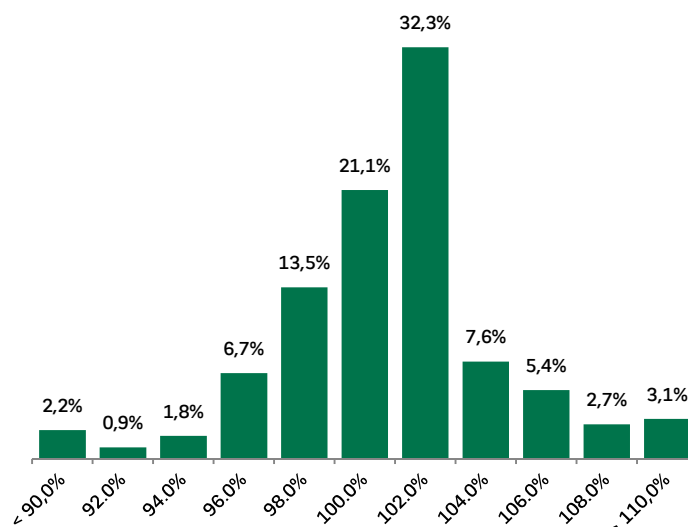
Rentabilidade Máxima Mensal 3,32%
 Rentabilidade Mínima Mensal 0,47%

Meses acima do CDI 120
 Meses abaixo do CDI 103

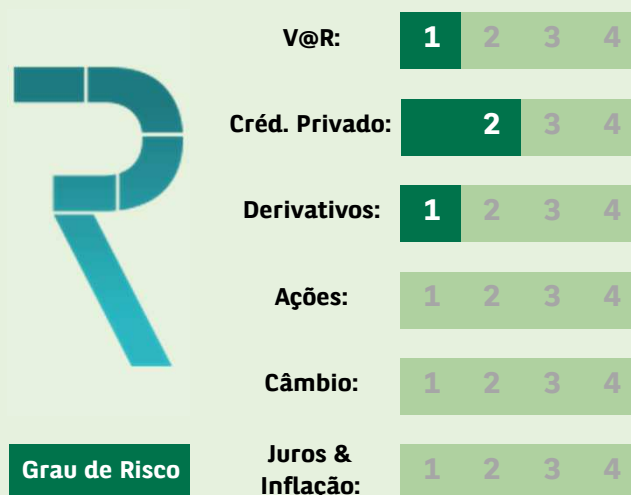
Volatilidade (% a.a.)* 0,31%

*Representa o desvio padrão anualizado dos retornos do fundo, com período de análise de 24 meses.

DISTRIBUIÇÃO DOS RETORNOS MENSAIS RELATIVOS AO CDI (FREQUÊNCIA)



CONHEÇA O RISCO DO PRODUTO*



Grau de Risco

*Mais informações em www.bnpparibas-ip.com.br



BNP PARIBAS
 ASSET MANAGEMENT

The asset manager for a changing world

Este documento foi produzido pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A. ou por suas empresas subsidiárias, coligadas e controladas, em conjunto denominadas "BNP Paribas", com fins meramente informativos não se caracterizando como oferta ou solicitação de investimento ou desinvestimento de ativos. O Banco BNP Paribas Brasil S.A. é instituição financeira regularmente constituída e em funcionamento no país e devidamente autorizada pelo Banco Central do Brasil e habilitada pela Comissão de Valores Mobiliários para administrar fundos de investimentos; Apesar do cuidado utilizado tanto na obtenção quanto no manuseio das informações apresentadas, o BNP Paribas não se responsabiliza pela publicação acidental de informações incorretas, nem tampouco por decisões de investimento tomadas com base nas informações contidas neste documento, as quais podem inclusive ser modificadas sem comunicação. Este fundo utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas; Para avaliação da performance de fundos de investimento, é recomendável uma análise de, no mínimo, doze meses; A rentabilidade divulgada já é líquida das taxas de administração, de performance e dos outros custos pertinentes ao fundo. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos; Fundos de investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos-FGC; A rentabilidade passada não constitui garantia nem promessa de rentabilidade futura; LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES ANTES DE INVESTIR; Esse material não caracteriza nenhuma oferta de investimento. Antes de qualquer decisão de investimento, é obrigatório certificar-se sobre o seu perfil de risco X perfil de risco do produto pretendido, nos termos da regulamentação em vigor. É recomendada a leitura cuidadosa do formulário de informações complementares e regulamento dos fundos de investimento pelo investidor ao aplicar seus recursos. Acesse nosso site: www.bnpparibas.com.br. IMPORTANTE: A notação gráfica dos diversos riscos assumidos pelo fundo é uma forma meramente ilustrativa que não deve servir como indicação para tomada de decisão de investimento ou desinvestimento. Para tanto é recomendada a leitura, análise e entendimento do Regulamento e Prospecto do fundo. As escalas refletem a visão da gestora baseada na Política de Investimento do fundo podendo além de ser dinâmica não refletir diretamente as alocações ocorridas no fundo ao longo do tempo. Adicionalmente informamos que esta notação é propriedade intelectual da BNP Paribas Asset Management Brasil Ltda., não devendo ser usada por outro gestor ou administrador de recursos. Você poderá acessar a Ouvidoria pelo telefone - 0800-7715999 ou através do e-mail: ouvidoria@br.bnpparibas.com. O horário de funcionamento da Ouvidoria é de segunda-feira à sexta-feira, das 09h00 às 18h00. A lâmina de informações essenciais BNP PARIBAS OPTIMUM DI FIC FI REFERENCIADO encontra - se no site www.bnpparibas.com.br.



BNP PARIBAS

**LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS SOBRE O
BNP PARIBAS OPTIMUM DI FIC DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
REFERENCIADO**

CNPJ/MF: 02.539.893/0001-73

Informações referentes a Fevereiro de 2017

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o **BNP PARIBAS OPTIMUM DI FIC DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO**, administrado por **BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.** e gerido por **BNP ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA.** As informações completas sobre esse fundo podem ser obtidas no Regulamento do fundo, disponível no site www.bnpparibas.com.br. As informações contidas neste material são atualizadas mensalmente. Ao realizar aplicações adicionais, consulte a sua versão mais atualizada.

Antes de investir, compare o fundo com outros da mesma classificação.

1. **PÚBLICO-ALVO:** O fundo é destinado a investidores em geral que pretendam buscar investimentos que acompanhem a variação do CDI.
2. **OBJETIVOS DO FUNDO:** O fundo tem por objetivo acompanhar a variação do CDI. Embora a Gestora empregue toda a sua diligência e técnica no sentido de atingir estes objetivos, não há garantia de que o desempenho do fundo seja continuamente próximo a variação do CDI. O FUNDO é um "Fundo Referenciado", tendo como indicador de desempenho o CDI.
3. **POLÍTICA DE INVESTIMENTOS:**
 - a. A política de investimento do Fundo é a de acompanhar a variação do CDI, investindo no mínimo 95% de sua carteira em cotas do BNP Paribas Master DI FI Referenciado, que investe no mínimo 95% de seu patrimônio líquido em títulos de renda fixa com rentabilidade indexada ou correlacionada ao CDI.
 - b. Este fundo aplica em fundos que podem:



Aplicar em ativos no exterior até o limite de	0.00% do Patrimônio líquido
Aplicar em crédito privado até o limite de	50.00% do Patrimônio líquido
Aplicar em um só fundo	10.00% do Patrimônio líquido
Utiliza derivativos apenas para proteção da carteira?	Sim
Alavancar-se até o limite de ⁽¹⁾	0.00% do Patrimônio líquido

(i) No cálculo do limite de alavancagem, deve-se considerar o valor das margens exigidas em operações com garantia somada a "margem potencial" de operações de derivativos sem garantia. O cálculo de "margem potencial" de operações de derivativos sem garantia deve se basear em modelo de cálculo de garantia do administrador e não pode ser compensado com as margens das operações com garantia.

- c. A metodologia utilizada para o cálculo do limite de alavancagem, disposto no item 3.b é o percentual máximo que pode ser depositado pelo fundo em margem de garantia para garantir a liquidação das operações contratadas somado à margem potencial para a liquidação dos derivativos negociados no mercado de balcão.
- d. As estratégias de investimento do fundo podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.

4. CONDIÇÕES DE INVESTIMENTO

Investimento inicial mínimo	R\$ 5,000.00
Investimento adicional mínimo	R\$ 5,000.00
Resgate mínimo	R\$ 5,000.00
Horário para aplicação e resgate	16:00 (horário de Brasília)
Valor mínimo para permanência	Não há
Período de carência	Não há
Conversão das cotas	Na aplicação, o número de cotas compradas será calculado de acordo com o valor das cotas na abertura da data da aplicação. No resgate, o número de cotas canceladas será calculado de acordo com o valor das cotas na abertura da data do pedido de resgate.
Pagamento dos resgates	O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é a mesma data do pedido de resgate.
Taxa de administração	0,50% a.a.
Taxa de entrada	Não há
Taxa de saída	Não há
Taxa de performance	Não há
Taxa total de despesas	As despesas pagas pelo fundo representaram 0.62% do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de 01/03/2016 a 24/02/2017. A taxa de

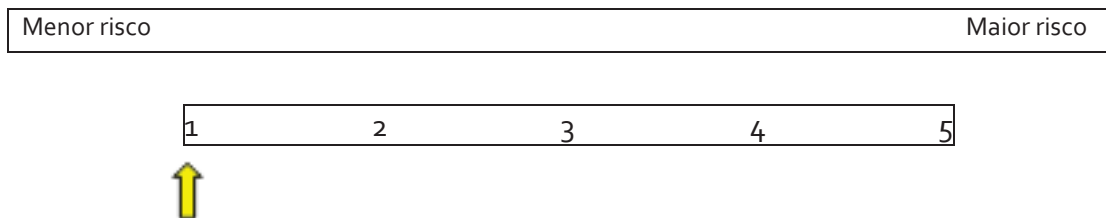


despesas pode variar de período para período e reduz a rentabilidade do fundo. O quadro com a descrição das despesas do fundo pode ser encontrado em www.bnpparibas.com.br

5. **COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA:** o patrimônio líquido do fundo é de **R\$ 173,232,021.68** e as 5 espécies de ativos em que os fundos investidos concentram seus investimentos são:

Títulos públicos federais	43.01% do Patrimônio líquido
Depósitos a prazo e outros títulos de instituições financeiras	27.44% do Patrimônio líquido
Títulos de crédito privado	10.87% do Patrimônio líquido
Derivativos	-8.90% do Patrimônio líquido
Cotas de fundos de investimento 409	4.16% do Patrimônio líquido

6. **RISCO⁽¹⁾:** o BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. classifica os fundos que administra numa escala de 1 a 5 de acordo com o risco envolvido na estratégia de investimento de cada um deles. Nessa escala, a classificação do fundo é:



7. **HISTÓRICO DE RENTABILIDADE⁽²⁾:**

- a. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.
- b. **Rentabilidade acumulada nos últimos 5 anos: 56.84%** no mesmo período o índice CDI variou **57.58%**. A tabela abaixo mostra a rentabilidade do **fundo** a cada ano nos últimos 5 anos.



Ano	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Varição percentual do CDI	Desempenho do fundo como % do CDI
2017	1.97%	1.96%	100.14%
2016	13.90%	14.00%	99.28%
2015	13.12%	13.23%	99.20%
2014	10.69%	10.81%	98.91%
2013	7.85%	8.05%	97.49%

c. **Rentabilidade mensal:** a rentabilidade do **fundo** nos últimos 12 meses foi:

Mês	Rentabilidade do fundo (líquida de despesas, mas não de impostos)	Varição percentual do CDI	Desempenho do fundo como % do CDI
Fevereiro	0.89%	0.87%	102.38%
Janeiro	1.07%	1.09%	98.36%
Dezembro	1.09%	1.12%	97.22%
Novembro	1.03%	1.04%	99.72%
Outubro	1.04%	1.05%	98.98%
Setembro	1.09%	1.11%	98.66%
Agosto	1.29%	1.21%	106.63%
Julho	1.11%	1.11%	99.93%
Junho	1.16%	1.16%	100.36%
Mai	1.11%	1.11%	100.34%
Abril	1.07%	1.05%	101.20%
Março	1.13%	1.16%	97.59%
12 meses	13.90%	13.89%	100.12%

8. **EXEMPLO COMPARATIVO:** utilize a informação do exemplo abaixo para comparar os custos e os benefícios de investir no fundo com os de investir em outros fundos.

a. **Rentabilidade:** Se você tivesse aplicado R\$ 1.000,00 (mil reais) no **fundo** no primeiro dia útil de 2016 e não houvesse realizado outras aplicações, nem solicitado resgates durante o ano, no primeiro dia útil de 2017, você poderia resgatar R\$ 1,114.58 (hum mil e cento e quatorze reais e cinquenta e oito centavos), já deduzidos impostos no valor de R\$ 24.31 (vinte e quatro reais e trinta e um centavos).



b. **Despesas:** As despesas do **fundo**, incluindo a taxa de administração, a taxa de performance (se houver), e as despesas operacionais e de serviços teriam custado R\$ 6.14 (seis reais e quatorze centavos).

9. **SIMULAÇÃO DE DESPESAS:** utilize a informação a seguir para comparar o efeito das despesas em períodos mais longos de investimento entre diversos fundos:

Assumindo que a última taxa total de despesas divulgada se mantenha constante e que o **fundo** tenha rentabilidade bruta hipotética de 10% ao ano nos próximos 3 e 5 anos, o retorno após as despesas terem sido descontadas, considerando a mesma aplicação inicial de R\$ 1.000,00 (mil reais), é apresentado na tabela abaixo:

Simulação das Despesas	+3 anos	+5 anos
Saldo bruto acumulado (hipotético - rentabilidade bruta anual de 10%)	R\$ 1,331.00	R\$ 1,610.51
Despesas previstas (se a TAXA TOTAL DE DESPESAS se mantiver constante)	R\$ 18.43	R\$ 30.72
Retorno bruto hipotético após dedução das despesas e do valor do investimento original (antes da incidência de impostos, de taxas de ingresso e/ou saída, ou de taxa de performance)	R\$ 312.57	R\$ 579.79

Este exemplo tem a finalidade de facilitar a comparação do efeito das despesas no longo prazo. Esta simulação pode ser encontrada na lâmina e na demonstração de desempenho de outros fundos de investimento.

A simulação acima não implica promessa de que os valores reais ou esperados das despesas ou dos retornos serão iguais aos aqui apresentados.

10. **POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO:**

O ADMINISTRADOR é o principal distribuidor das cotas do FUNDO e atua por meio dos seus canais de distribuição internos para os segmentos de investidores institucionais, de acordo com o público alvo. O ADMINISTRADOR e a GESTORA 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.



BNP PARIBAS

A remuneração dos distribuidores é descontada da taxa de administração do fundo.

O principal distribuidor não oferta, para o público alvo do fundo, preponderantemente fundos geridos por um único gestor, ou gestores ligados a um mesmo grupo econômico.

Não há conflito de interesses no esforço de venda.

11. SERVIÇO DE ATENDIMENTO AO COTISTA:

- a. Telefone: 11 3049-2820
- b. Página na rede mundial de computadores: www.bnpparibas.com.br
- c. **Reclamações:** mesadeatendimento@br.bnpparibas.com

12. SUPERVISÃO E FISCALIZAÇÃO:

- a. Comissão de Valores Mobiliários – CVM
- b. Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.

Você poderá acessar a Ouvidoria pelo telefone – 0800-7715999 ou através do e-mail: ouvidoria@br.bnpparibas.com. O horário de funcionamento da Ouvidoria é de segunda-feira a sexta-feira, das 08h00 às 18h00.

12. INFORMAÇÕES IMPORTANTES:

(1) Foram considerados na mensuração da escala de risco do fundo, os riscos de mercado, de liquidez, de crédito e de alavancagem, conforme exposição do FUNDO a estes, constante na política de investimento. Consideramos também a categoria à qual o fundo pertence. Adicionalmente ressaltamos que o risco informado não leva em conta o risco do FUNDO em relação a outros fundos equivalentes disponíveis no mercado, nem eventos econômicos atípicos que possam impactar a rentabilidade do FUNDO.



BNP PARIBAS

(2) A rentabilidade do fundo exposta no item 7, é calculada com base na cota do último dia útil do período de análise. No “Exemplo Comparativo”, este cálculo é realizado com base no primeiro dia útil.