

Formulário de Informações Complementares



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

1. Competência:	01/10/2018		
2. Data de elaboração:	01/10/2018		
3. FUNDO:	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CAPITAL		
4. CNPJ:	01.091.638/0001-48		
5. Tipo ANBIMA:	Multimercados Livre: Fundos que não possuem obrigatoriamente o compromisso de concentração em nenhuma estratégia específica.		
6. Apresentação detalhada do Administrador:	BANCO CITIBANK S.A.		
<p>O BANCO CITIBANK S.A. é uma instituição financeira com sede na Cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, na Avenida Paulista, nº 1.111, 2º andar - parte, inscrita no CNPJ sob nº 33.479.023/0001-80, autorizada pela CVM para o exercício profissional da administração fiduciária por meio do Ofício nº 185/2018/CVM/SIN/GIR, de 02 de março de 2018.</p> <p>O Citi é um Banco global, com mais de 200 anos de atuação e maior presença no mundo. A Organização faz negócios em 160 países, conta com 200 milhões de contas de clientes e um total de 219 mil funcionários. No Brasil são 102 anos conectando o País com o mundo.</p>			
7. Apresentação detalhada do Gestor de Recursos:	BANCO CITIBANK S.A.		
Os serviços de gestão são prestados pelo Administrador.			
8. O Gestor vota ou não em assembleia dos ativos que compõem a carteira do FUNDO (1-Sim / 2-Não)			2
8.1. Caso a resposta ao item 8 seja positiva, descrever a política relativa ao exercício de direito de voto e indicar o sítio da rede mundial de computadores onde pode ser encontrada a versão integral da política de exercício de voto do Gestor:			
9. Descrever os demais serviços prestados ao FUNDO:	10. Nome dos prestadores de serviços:		
Custódia	BANCO CITIBANK S.A.		
Escrituração	BANCO CITIBANK S.A.		
Controladoria	BANCO CITIBANK S.A.		
Distribuição	BANCO CITIBANK S.A.		
Consultoria de Investimentos	n/a		
11. Indicar 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 (1-Sim / 2-Não)			2
12. Descrição detalhada da forma de distribuição de cotas:	As cotas do FUNDO são distribuídas exclusivamente pelo Administrador na modalidade direta.		
13. Existe agência de classificação de rating. (1-Sim / 2-Não)	2	14. Caso a resposta ao item 13 seja positiva, indicar o CNPJ da Agência de Classificação de Rating	00.000.000/0000-00
15. Caso a resposta ao item 13 seja positiva, indicar a denominação da Agência de Classificação de Rating:	n/a		
16. Caso a resposta ao item 13 seja positiva, informar classificação obtida pela Agência de Classificação de Rating contratada:	n/a		
17. Caso a resposta ao item 13 seja positiva, inserir o disclaimer sobre a manutenção do serviço:	n/a		
Local, meio e forma de divulgação de informações:			
18. Meio de Divulgação (1-Eletrônico/ 2-Físico)	1		
19. Local de Divulgação de Informações: Descrição do local de divulgação.	Endereço eletrônico na rede mundial de computadores do administrador e do distribuidor: https://www.brasil.citibank.com/corporate/servicos.html		
20. Forma de Solicitação de Informações: Descrição da forma de divulgação.	Por meio do correio eletrônico: atendimento.fundos@citi.com		
21. Periodicidade mínima para divulgação da composição da Carteira do FUNDO (Art. 59):	Mensal	22. Responsável pela divulgação da Carteira do FUNDO:	BANCO CITIBANK S.A.

23. Exposição, em ordem de relevância, dos fatores de risco inerentes à composição da carteira do FUNDO:

Mercado: o valor dos ativos que integram a Carteira pode variar em função de oscilações nas taxas de juros, taxas de câmbio, preços e cotações de mercado, bem como em razão de quaisquer alterações nas condições econômicas e/ou políticas, nacionais ou internacionais. Tais fatos podem afetar negativamente os preços dos ativos integrantes da Carteira do FUNDO resultando em perdas patrimoniais aos cotistas;

Crédito: o inadimplemento ou atraso no pagamento pelos emissores dos ativos da Carteira ou contrapartes das operações do FUNDO, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial de tais emissores e/ou contrapartes, pode ocasionar a redução de ganhos ou perda substancial do patrimônio líquido do FUNDO e dos cotistas. Pode haver, também, custos adicionais caso FUNDO tente recuperar tais créditos via ações judiciais, acordos extrajudiciais, entre outros;

Liquidez: a possibilidade de redução ou inexistência de demanda pelos ativos da Carteira pode fazer com que o FUNDO não esteja apto a realizar pagamentos de resgate, inclusive em decorrência de dificuldades para liquidar posições ou negociar tais ativos pelo preço e no tempo desejados. O monitoramento do risco de liquidez não é garantia de que os ativos da Carteira terão liquidez suficiente para honrar as solicitações de resgates dos cotistas;

Concentração: a eventual concentração de investimentos do FUNDO em um mesmo emissor, setor, ativo financeiro ou, ainda, prazo de vencimento, pode potencializar a exposição da Carteira aos riscos mencionados nos itens anteriores, ocasionando a volatilidade no valor das cotas;

Perdas Patrimoniais: o FUNDO utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais aos cotistas, podendo acarretar em perdas superiores ao capital aplicado e eventual aporte de recursos para cobrir o patrimônio líquido do FUNDO.

24. 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:

Mercado: o ADMINISTRADOR pode utilizar várias técnicas, dependendo da natureza do FUNDO, dentre as quais destacam-se:

V@R (Value at Risk): Mede estatisticamente a 4 perda máxima do FUNDO, dado um nível de confiança estatística. A perda real do FUNDO pode ultrapassar a perda máxima prevista pelo V@R. Cenário de estresse: mede a perda de um FUNDO em um cenário de estresse. Este cenário é baseado no histórico de cada mercado em que o FUNDO atua.

Tracking Error: mede estatisticamente o potencial descolamento entre a rentabilidade do FUNDO e de seu benchmark dado um nível de confiança estatística.

Crédito: o ADMINISTRADOR analisa tecnicamente e em comitê próprio o risco de inadimplemento dos emissores dos títulos da carteira do FUNDO. Define limites para compra desses títulos como concentração no FUNDO e participação do ADMINISTRADOR na emissão. Para os títulos de instituições financeiras, estabelece um limite por conglomerado financeiro.

Liquidez: o ADMINISTRADOR analisa em comitê próprio indicadores de liquidez que medem a capacidade do FUNDO cumprir os prazos de pagamento de resgates previstos em seu regulamento além de suas obrigações.

Derivativos: como os derivativos podem, por vezes, ampliar o risco de mercado, o seu monitoramento faz parte integral do monitoramento do risco de mercado.

Evento: equivale a um cenário de estresse. Logo é monitorado via técnica de "cenário de estresse".

Concentração: limitação de concentração do FUNDO em ativos de um mesmo emissor ou grupo econômico.

Sistêmico: parte do monitoramento do risco de mercado.

Tributário: diariamente, qualquer desenquadramento é reportado, para que o reenquadramento às regras de tributação seja feito nos prazos legais.

Investimento no Exterior: o ADMINISTRADOR procura mitigar o risco de investimento no exterior através da verificação dos veículos de investimento em que o FUNDO aplica, e da adoção de um robusto conjunto de procedimentos operacionais.

25. Descrição da tributação aplicável ao FUNDO e a seus cotistas, contemplando a política a ser adotada pelo Administrador quanto ao tratamento tributário perseguido:

Os cotistas do FI estão sujeitos a tributação abaixo, salvo aqueles que, por legislação própria, recebam tratamento específico: (i) IR Fonte: incidirá no último dia útil dos meses de maio e novembro de cada ano (come cotas), ou no resgate, se ocorrido anteriormente, incluindo, o seguinte: (i.1) enquanto o FI mantiver uma Carteira de longo prazo, ou seja, uma carteira de títulos com prazo médio superior a 365 dias, o IR será cobrado às alíquotas de: I. 22,5% em aplicações com até 180 dias; II. 20% em aplicações entre 181 dias até 360 dias; III. 17,5% em aplicações entre 361 até 720 dias; ou IV. 15%, em aplicações com mais de 720 dias; (i.2) caso o FI esteja inserido na hipótese do item (i.1), quando da incidência da tributação "come cotas", o IR Fonte será de 15%. Em cada resgate de cotas, será apurado e cobrado eventual complemento de alíquota entre aquela utilizada no come cotas e a aplicável segundo o inciso acima; (i. 3) caso, por razões estratégicas e/ou operacionais decorrentes da busca do cumprimento da política de investimento, a Carteira do FI apresentar características de curto prazo, sendo isto uma carteira de títulos com prazo médio igual ou inferior a 365 dias, o IR será cobrados às seguintes alíquotas: I. 22,5% em aplicações com até 180 dias; ou II. 20% em aplicações com mais de 180 dias; (i.4) caso o FI esteja incluído na hipótese do inciso (i.3), o IR Fonte será de 20%. Em cada resgate de cotas, será apurado e cobrado eventual complemento de alíquota entre aquela utilizada no "come cotas" e a aplicável segundo o inciso acima; (i.5) caso o FI tenha sua Carteira constituída por, no mínimo, 67% de ações ou em cotas de FIAs, a alíquota do IR Fonte devida exclusivamente no resgate será de 15%; (ii) IOF/Títulos: Os resgates ocorridos em um prazo inferior a 30 dias da data de aplicação no FI sofrerão incidência do IOF/Títulos à alíquota de 1% ao dia sobre o valor do resgate, limitado ao rendimento da operação, conforme tabela regressiva em função do prazo prevista na regulamentação em vigor. A partir do 30º dia de aplicação, a alíquota passa a zero. Não há garantia de que o FI terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. A carteira do FI está sujeita ao seguinte tratamento tributário: (i) IR Fonte: isenta; e (ii) IOF/Títulos: alíquota zero. Estas são as regras gerais de tributação do FI e seus cotistas, com base na legislação tributária vigente. O tratamento tributário aqui descrito pode ser alterado a qualquer tempo.

26. Demais informações relevantes ao investidor:

Público Alvo: O FUNDO destina-se a receber aplicações de recursos provenientes de um único cotista, caracterizado como investidor profissional, sendo vedada a aplicação de recursos pelo público em geral.

Limites de Movimentação:

Aplicação Inicial: Não Há

Saldo Mínimo: Não Há

Movimentações Posteriores: Não Há

PARA MAIS INFORMAÇÕES SOBRE OS FATORES DE RISCO, O INVESTIDOR DEVE CONSULTAR O REGULAMENTO DO FUNDO. OS MÉTODOS UTILIZADOS PELO ADMINISTRADOR PARA GERENCIAR OS RISCOS A QUE O FUNDO ESTÁ SUJEITO NÃO CONSTITUEM GARANTIA CONTRA EVENTUAIS PERDAS

"ESTE FORMULÁRIO FOI PREPARADO COM AS INFORMAÇÕES NECESSÁRIAS AO ATENDIMENTO DAS DISPOSIÇÕES DO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO, 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 SERVIÇO."

"O FUNDO APLICA EM FUNDOS DE INVESTIMENTO QUE UTILIZAM ESTRATÉGIAS, INCLUSIVE COM DERIVATIVOS, QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS COTISTAS, PODENDO INCLUSIVE ACARRETER PERDAS SUPERIORES AO CAPITAL APLICADO E CONSEQUENTE OBRIGAÇÃO DO FUNDO, E CONSEQUENTEMENTE DOS COTISTAS, 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".