

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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONDRES		
4. CNPJ:	07.938.843/0001-82		
5. Tipo ANBIMA:	<p>Renda Fixa Duração Baixa Soberano: Fundos que objetivam buscar retornos investindo em ativos de renda fixa com duration média ponderada da carteira inferior a 21 (vinte e um) dias úteis. Estes fundos buscam minimizar a oscilação nos retornos promovida por alterações nas taxas de juros futuros. Estão nesta categoria também os fundos que buscam retorno investindo em ativos de renda fixa remunerados à taxa flutuante em CDI ou Selic. Fundos que possuem ativos no exterior deverão realizar o hedge cambial da parcela investida no exterior. Excluem-se estratégias que impliquem exposição de moeda estrangeira ou de renda variável (ações, etc.). Fundos que investem 100% (cem por cento) em títulos públicos federais do Brasil.</p>		
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 mundiais. 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; 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; Generais: eventual interferência de órgãos reguladores no mercado, mudanças na legislação e regulamentação aplicáveis aos fundos de investimento, decretação de moratória, fechamento parcial ou total dos mercados, alteração nas políticas monetárias e cambiais, dentre outros eventos, podem impactar as condições de funcionamento do FUNDO, bem como seu respectivo desempenho.			
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.			
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 nacionais estão sujeitos à tributação a seguir, exceto os que, por lei, recebam tratamento específico:(a)IR Fonte: incide no último dia útil de maio e novembro de cada ano (come cotas), ou no resgate que ocorrer em data anterior observando:(a1)FI manterá carteira de longo prazo, sendo títulos com mais de 365 dias, IR Fonte incidirá às alíquotas: I.22,5% em aplicações com até 180 dias; II.20% em aplicações entre 181 e 360 dias; III.17,5%, em aplicações entre 361 e 720 dias; ou IV.15%, em aplicações com mais de 720 dias.(a2)caso o FI esteja na hipótese do item (a1), rendimentos apropriados pelo come cotas serão tributados à alíquota de 15%, sendo que no resgate aplicar-se-á alíquota complementar para aplicação com menos de 720 dias. (b) IOF/Títulos: alíquota 1% ao dia sobre valor do resgate/cessão/repactuação das cotas do FI, limitado ao rendimento da operação em função do prazo conforme tabela anexa ao Dec.nº6.306/07, sendo limite de 0% do rendimento para operações com prazo de ao menos 30 dias. (a3)se por razão estratégica para cumprimento da política de investimento carteira do FI apresentar características de curto prazo, sendo carteira de títulos com prazo médio até 365 dias, IR será cobrado a alíquota de:I.22,5% em aplicações com até 180 dias; ou II.20% em aplicações acima de 180 dias. A Carteira do FI está sujeita ao seguinte tratamento:(a)IR Fonte:isenta; (b) IOF/Títulos:alíquota 0%, exceto:(b1)IOF/Títulos: no caso de cessão de ações negociadas em bolsa de valor Brasileira para lastrear emissão de depositary receipts (DR) negociados no exterior, FI sujeito ao IOF/Títulos DR à alíquota de 1,5%.(b2) aplicações em derivativos cambiais poderão sujeitar-se ao IOF devido em operações com derivativos (IOF/ Derivativos), cobrado sobre operações com derivativos cambiais à alíquota de 1% sobre valor nominal ajustado, na aquisição/venda/vencimento de contratos financeiros derivativos celebrados no Brasil que resultem aumento da exposição cambial vendida ou redução da exposição cambial comprada. IOF/Derivativos não incide caso a contraparte possua exposição cambial líquida comprada ou vendida inferior a 10 milhões.É possível majoração do IOF/Derivativos pelo Poder Executivo até 25%.(c)IOF/Câmbio: alíquota zero em operações de câmbio, transferências do/para o exterior. 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, exclusivamente, aplicações dos recursos provenientes da CITIBANK DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A., investidor profissional.

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 PATRIMONIAIS QUE POSSAM SER INCORRIDAS PELO FUNDO.

"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."

"ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS COTISTAS."

"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 OBEJTIVO E À POLÍTICA DE INVESTIMENTO DO FUNDO, BEM COMO ÀS DISPOSIÇÕES DO FORMULÁRIO E DO REGULAMENTO QUE TRATAM DIS FATORES DE RISCO A QUE O FUNDO ESTÁ EXPOSTO".