



WARREN BRASIL GESTÃO E ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA

FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

WARREN FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO

CNPJ: 30.271.177/0001-93

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA: RENDA FIXA - ALTA DURAÇÃO - CRÉDITO LIVRE

ESTE FORMULÁRIO FOI PREPARADO COM AS INFORMAÇÕES NECESSÁRIAS AO ATENDIMENTO DAS NORMAS EMANADAS DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS. A AUTORIZAÇÃO PARA FUNCIONAMENTO E/OU VENDA DAS COTAS DESTES FUNDOS NÃO IMPLICA, POR PARTE DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS, GARANTIA DE VERACIDADE DAS INFORMAÇÕES PRESTADAS OU JULGAMENTO SOBRE A QUALIDADE DO FUNDO, DE SEU ADMINISTRADOR OU DAS DEMAIS INSTITUIÇÕES PRESTADORAS DE SERVIÇO.

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.

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

AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESTE FORMULÁRIO ESTÃO EM CONSONÂNCIA COM O REGULAMENTO DO FUNDO, MAS NÃO O SUBSTITUEM. É RECOMENDADA A LEITURA CUIDADOSA TANTO DESTES FORMULÁRIOS QUANTO DO REGULAMENTO, COM ESPECIAL ATENÇÃO PARA AS CLÁUSULAS RELATIVAS AO OBJETIVO E À POLÍTICA DE INVESTIMENTO DO FUNDO, BEM COMO AS DISPOSIÇÕES DO FORMULÁRIO E DO REGULAMENTO QUE TRATAM DOS FATORES DE RISCO A QUE O FUNDO ESTÁ EXPOSTO.

1. PERIODICIDADE MÍNIMA PARA DIVULGAÇÃO DA COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DO FUNDO:

Até 10 (dez) dias contados do encerramento do mês a que se referirem.

2. LOCAL, MEIO E FORMA DE DIVULGAÇÃO DAS INFORMAÇÕES RELATIVAS AO FUNDO:

Através do site www.oiiwarren.com e dos aplicativos móveis do Warren são divulgadas todas as informações relativas aos fundos. As Demonstrações Contábeis são divulgadas no prazo de até 90 dias após o encerramento do exercício social.

3. LOCAL, MEIO E FORMA DE SOLICITAÇÃO DE INFORMAÇÕES PELO COTISTA:

Solicitações nos canais de atendimento 24 horas, 7 dias por semana. Disponíveis no site www.oiiwarren.com ou através do e-mail oi@oiiwarren.com

Contato com ouvidoria em dias úteis das 9h as 17h através do fone (11) 4950 8124

4. FATORES DE RISCOS INERENTES AO FUNDO EM ORDEM DE RELEVÂNCIA:

Os ativos que compõem a carteira do Fundo sujeitam-se, em especial, aos seguintes riscos:

Risco de Juros Pos fixados (CDI, TMS) - Os preços dos ativos podem variar em virtude dos spreads praticados nos ativos indexados ao CDI ou à TMS.

Risco de Taxa de Juros – Os preços dos ativos financeiros podem sofrer oscilações de acordo com as taxas de juros praticadas no mercado.

Risco Proveniente do uso de Derivativos – O preço dos derivativos está sempre vinculado ao de um ativo. Variações no preço, ou na expectativa de preço futuro deste ativo, podem ocasionar perdas para o Fundo.

Risco de Liquidez – O Fundo pode não apresentar a disponibilidade imediata de recursos para honrar o pagamento de resgates e/ou despesas, sem afetar suas operações diárias e sem incorrer em perdas significativas na venda de ativos.

Risco de Conjuntura - Possibilidade de perdas decorrentes de mudanças verificadas nas condições políticas, culturais, sociais, econômicas ou financeiras do Brasil ou de outros países.

Risco de Bolsa - Risco de variação dos preços das ações.

Risco Regulatório - A eventual interferência de órgãos reguladores no mercado, como o Banco Central do Brasil e a Comissão de Valores Mobiliários - CVM, podem impactar os preços dos ativos ou os resultados das posições assumidas.

Risco Sistêmico - Possibilidade de perdas em virtude de dificuldades financeiras de uma ou mais instituições que provoquem danos substanciais a outras, ou ruptura na condução operacional de normalidade do Sistema Financeiro Nacional - SFN.

5. POLÍTICA RELATIVA AO EXERCÍCIO DE DIREITO DE VOTO DECORRENTE DOS

ATIVOS FINANCEIROS DETIDOS PELO FUNDO:

Ao adotar Política de Exercício de Direito de Voto, conforme indicado no endereço eletrônico www.oiiwarren.com, a Gestora comparecerá às assembleias em que o Fundo seja detentor de ativos financeiros, sempre que identificar tal necessidade, a fim de resguardar os direitos e interesses dos cotistas.

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.

6. TRIBUTAÇÃO APLICÁVEL AO FUNDO:

As operações da carteira do Fundo não estão sujeitas à tributação pelo Imposto de Renda – IR e Imposto sobre Operações Financeiras – IOF, exceto:

- (i) IOF sobre operações de derivativos, nos termos do Decreto 6.306/2007, conforme alterado de tempos em tempos; e
- (ii) IR sobre operações de empréstimo de ações quando enquadradas nos termos do art. 8º da Lei 13.043/2014.

Os rendimentos dos cotistas estão sujeitos a:

a) IOF: de 1% ao dia sobre o resgate, mas como o imposto é limitado ao rendimento da aplicação em função do prazo, a legislação usa tabela regressiva para apurar o valor a pagar, começando com alíquota de 96% sobre o rendimento para resgates no 1º dia útil após a aplicação e reduzindo a zero para resgates a partir do 30º dia;

b) IR na Fonte: incide no último dia útil de maio e novembro de cada ano ("come cotas") ou no resgate, se ocorrido em data anterior, observando-se, ainda, que:

(i) enquanto o FUNDO mantiver carteira de longo prazo (de títulos com prazo médio superior a 365 dias), o IR será cobrado à alíquota de: alíquota de 22,5% com prazo de permanência de 180 dias; alíquota de 20% com prazo de permanência de 181 a 360 dias; alíquota de 17,5% com prazo de permanência de 361 a 720 dias; alíquota de 15% com prazo de permanência acima de 720 dias;

(ii) caso o FUNDO se insira na hipótese do item (i) quando do "come cotas", o IR será retido pela alíquota de 15%. A cada resgate será apurado e cobrado eventual complemento de alíquota entre a utilizada no "come cotas" e a aplicável conforme acima.

(iii) caso, por razões estratégicas/operacionais decorrentes da busca do cumprimento da política de investimento, o FUNDO mantiver carteira de curto prazo (de títulos com prazo médio igual ou inferior a 365 dias), o IR será cobrado à alíquota de: 22,5% em aplicações com prazo de até 180 dias; 20% em aplicações com prazo acima de 180 dias.

(iv) caso o FUNDO se insira na hipótese do item (iii) quando do "come cotas", o IR será retido pela alíquota de 20%. A cada resgate será apurado e cobrado eventual complemento de alíquota entre a utilizada no "come cotas" e a aplicável conforme acima.

Alterações na legislação fiscal vigente acarretarão modificações nos procedimentos tributários aplicáveis

ao Fundo e aos cotistas.

7. POLÍTICA DE ADMINISTRAÇÃO DE RISCO:

Para o gerenciamento do risco de mercado, utiliza-se o Valor em Risco (Value-at-Risk – VaR), objetivando-se estimar a perda potencial máxima dentro de dado horizonte temporal e determinado intervalo de confiança. Dado que a métrica de VaR é aplicável somente em condições normais de mercado são realizados testes de estresse que possibilitam avaliar as carteiras sob condições extremas de mercado, tais como crises e choques econômicos, utilizando-se cenários retrospectivos e/ou prospectivos. As métricas acima são calculadas para todos os fundos.

No gerenciamento do risco de liquidez, aplicamos metodologia para avaliação da liquidez de cada ativo do Fundo e da carteira como um todo. Para tanto utilizamos séries históricas obtidas junto às instituições públicas e/ou privadas, que possibilitem a estimação consistente de seus históricos diários de negociação. No caso do passivo (resgates líquidos) utilizamos a métrica LVaR que, semelhante ao VaR, estima uma probabilidade de resgate líquido, considerando-se um intervalo de tempo, uma série histórica móvel e um intervalo de confiança. A avaliação do risco de liquidez do ativo e do passivo é efetuada diariamente, em condições normais e de estresse.

Como forma de reduzir o risco de liquidez são mantidas posições em títulos públicos federais e fundos que investem em títulos públicos federais que são os ativos com maior volume de negociação no mercado.

A política utilizada pela Warren Brasil Gestão e Administração de Recursos LTDA para gerenciar os riscos a que o Fundo e seus cotistas estão sujeitos, não constitui garantia contra eventuais perdas patrimoniais que possam ser incorridas pelo Fundo e/ou pelos seus cotistas, especialmente em situações anormais de mercado, quando a referida política de gerenciamento de risco pode ter sua eficiência reduzida.

8. AGÊNCIA DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO DE CRÉDITO CONTRATADA PELO FUNDO:

Não existe.

9. APRESENTAÇÃO DO GESTOR:

Com sede em Porto Alegre, a Warren Brasil Gestão e Administração de Recursos LTDA foi criada em 2016 e é autorizada pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM a prestar serviços de gestão e administração de carteiras. Ato Declaratório No 15.269, de 21 de setembro de 2016.

O Warren é uma solução online de investimentos que, fundamentado em tecnologia e usabilidade, busca tornar o mundo de investimentos mais eficiente, simples e transparente.

A gestão dos recursos dos Fundos do Warren é realizada por uma equipe especializada em investimentos, macroeconomia, pesquisa e análise e que utiliza metodologias renomadas mundialmente na composição das carteiras dos fundos.

A administração dos Fundos é realizada por uma equipe com larga experiência no mercado financeiro e é responsável pelo seu funcionamento, pelo controle de todos os prestadores de serviços, pelo monitoramento das operações, pela defesa dos interesses dos cotistas e pela representação dos Fundos perante os órgãos reguladores.

10. RELAÇÃO DOS DEMAIS PRESTADORES DE SERVIÇOS:

Administração

PILLA CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS E CÂMBIO LTDA CNPJ: 92.875.780/0001-31

Custódia

SANTANDER SECURITIES SERVICES BRASIL DTVM S.A. CNPJ: 62.318.407/0001-19

Controle e Processamento de Ativos Financeiros

PILLA CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS E CÂMBIO LTDA CNPJ: 92.875.780/0001-31

Distribuição

WARREN BRASIL GESTÃO E ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA CNPJ: 24.176.946/0001-71

Registro escritural de cotas e Tesouraria

PILLA CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS E CÂMBIO LTDA CNPJ: 92.875.780/0001-31

Auditor Independente

RAMIRES AUDITORES INDEPENDENTES S/S. CNPJ: 05.465.151/0001-39

11. POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO DE COTAS:

A distribuição é realizada totalmente online via o website www.ojwarren.com ou aplicativos de celular do Warren.

O Warren é um algoritmo que classifica os usuários em 8 perfis comportamentais com relação a investimentos, além de 30 níveis de risco e 3 variáveis de tempo. Quando os usuários criam Objetivos de Investimentos dentro do Warren, recebem uma sugestão de fundo de investimentos que vai de acordo com o seu perfil e prazo.

Todos os fundos geridos e administrados pelo Warren cobram o mesmo valor de taxa de administração e não existe nenhum custo extra de distribuição.

12. OUTRAS INFORMAÇÕES:

O recebimento de pedidos de aplicações e de resgates serão aceitos até às 12:00 horas, observando os seguintes limites:

Aplicação inicial: R\$ 1,00

Aplicações subsequentes: R\$ 1,00

Resgate: R\$ 1,00

Saldo mínimo: R\$ 1,00

Classificação CVM: Renda fixa – Crédito Privado

