

FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

**DAYCOVAL CLASSIC FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO
CNPJ: 10.783.480/0001-68**

Versão: 1.0

Competência: 18/04/2016

Data de Geração: 18/05/2016

CNPJ/MF do FUNDO: 10.783.480/0001-68

Periodicidade mínima para divulgação da carteira do FUNDO

Mensalmente, até 10 (dez) dias após o encerramento do mês a que se referir, observada a possibilidade de omissão de ativos financeiros nos termos da regulamentação em vigor.

Local de Divulgação

Via de regra, por meio eletrônico, através de publicação na página do ADMINISTRADOR ou por outros meios expressamente previstos na regulamentação em vigor e utilizados pelo ADMINISTRADOR, incluindo a rede mundial de computadores.

Código do meio de divulgação

1- eletrônico

Forma de Solicitação

Como regra geral, realizada ao Serviço de Atendimento ao Cotista.

Responsável pela divulgação das informações

Administrador

Local de solicitação de informações pelo cotista

Via de regra, na Central de Atendimento do Administrador.

Meio de solicitação de informações pelo cotista

1- eletrônico

Forma de solicitação de informações pelo cotista

Via de regra, por intermédio do **Distribuidor**.

Riscos

Mercado: oscilações nos preços dos ativos financeiros em função de notícias econômicas/ políticas

Crédito: capacidade dos emissores dos ativos financeiros em honrar os compromissos de pagamento

Taxa de Juros: Risco de variação dos preços dos ativos devido à mudança de valor da taxa básica de juros da economia brasileira.

Liquidez: impossibilidade de efetuar, dentro do prazo estabelecido no regulamento, pagamentos de resgates

Concentração: a concentração em emissores pode aumentar a exposição aos riscos

Concentração em Créditos Privados: risco de perda substancial de seu patrimônio líquido em caso de eventos que acarretem o não pagamento dos ativos financeiros integrantes da carteira do FUNDO ou dos fundos investidos

Precificação: critérios e procedimentos de registro e avaliação que poderão ocasionar variações nos valores

Não Obtenção do Tratamento Tributário: ainda que o FUNDO busque manter a carteira como longo prazo, não há garantia de que receberá tal tratamento

Regulatório: alterações nas normas aplicáveis podem causar um efeito adverso relevante no preço dos ativos financeiros

Renda Variável: o mercado de bolsa de valores é considerado um mercado de alto risco devido às grandes variações de rendimentos a que está sujeito

Derivativos: a realização de operações no mercado de derivativos poderá acarretar variações no valor do patrimônio líquido

Oscilação de Mercados Futuros: ativos componentes da CARTEIRA do FUNDO podem estar sujeitos a restrições de negociação e a precificação dos ativos ser prejudicada

Cambial: condições econômicas nacionais/internacionais podem afetar o mercado e resultar em alterações nas taxas de juros e câmbio

Natureza Jurídica: fundos de investimento no Brasil são condomínios, de forma que os cotistas respondem por eventual patrimônio líquido negativo do FUNDO

Sistêmicos e Operacionais: perdas resultantes de falha/deficiência/inadequação de processos internos, pessoas e sistemas

FATCA: pagamentos recebidos pelo FUNDO aos quais possa se atribuir fonte de renda americana poderão se sujeitar à tributação pelo imposto de renda americano na fonte, à alíquota de 30%

Exercício de direito de voto pelo gestor em assembleias dos ativos da carteira do fundo

1- Sim

Política de Voto

A política de exercício de direito de voto em assembleias disciplina os princípios gerais, o processo decisório, matérias relevantes obrigatórias para o exercício do direito de voto e orienta as decisões do GESTOR em assembleias de detentores de títulos e valores mobiliários que confirmam aos seus titulares o direito de voto. Na hipótese de comparecimento e de efetivo exercício do direito de voto, o ADMINISTRADOR colocará à disposição na sua sede o material referente à Assembleia Geral, para eventual consulta.

A versão integral da Política de Voto do GESTOR encontra-se disponível no website do GESTOR no endereço: www.daycoval.com.br.

Tributação

Cotistas: O FUNDO busca manter uma carteira de ativos com prazo médio de vencimento superior a 365 dias. O Imposto de Renda Fonte (IRF) incidirá semestralmente ("come-cotas semestral"), no

último dia útil de maio e novembro de cada ano, à alíquota de 15% sobre os rendimentos produzidos no período. No resgate, todo o rendimento produzido sofrerá a incidência do IRF às alíquotas de: (i) 22,5%, nos resgates efetuados até 180 dias da data da aplicação; (ii) 20%, nos resgates efetuados após 180 dias e até 360 dias da data da aplicação; (iii) 17,5%, nos resgates efetuados após 360 dias e até 720 dias da data da aplicação; e (iv) 15%, nos resgates efetuados após 720 dias da data da aplicação. Nessa ocasião, os valores adiantados quando da ocorrência dos come-cotas semestrais serão descontados para fins de determinação do montante a ser efetivamente recolhido aos cofres públicos. Ainda que o FUNDO busque manter a carteira enquadrada como de longo prazo para fins da legislação tributária em vigor, não há compromisso nem garantia de que este FUNDO receberá o tratamento tributário aplicável para fundos de longo prazo, o que poderá sujeitar seus Cotistas à tributação aplicável a um fundo de investimento enquadrado como de curto prazo para fins fiscais. Nesse caso, o IRF incidirá semestralmente ("come-cotas semestral"), no último dia útil de maio e novembro de cada ano, à alíquota de 20% sobre os rendimentos produzidos no período. No resgate, os rendimentos serão tributados pelo IRF, em função do prazo do investimento, às alíquotas de: (i) 22,5%, em aplicações com prazo de até 180 dias; e (ii) 20%, em aplicações com prazo acima de 180. Ocorrendo incidência do IRF semestral ("come-cotas semestral"), na ocasião do resgate será aplicada alíquota complementar aplicável, para fins de determinação do montante a ser efetivamente recolhido aos cofres públicos. IOF/Títulos: Os resgates ocorridos em um prazo inferior a 30 dias da data de aplicação no FUNDO sofrerão incidência do IOF/Títulos à alíquota de 1% ao dia sobre o valor do resgate, limitado ao rendimento da operação, conforme tabela decrescente em função do prazo prevista na regulamentação em vigor. A partir do 30º dia de aplicação, a alíquota passa a zero.

Fundo: A atual legislação fiscal estabelece que a carteira do FUNDO não está sujeita à incidência de imposto de renda (IR). A atual legislação fiscal estabelece que os recursos do FUNDO não estão sujeitos à incidência do IOF/Títulos.

Gerenciamento de Riscos

O ADMINISTRADOR manterá um sistema automatizado de gerenciamento de riscos baseado em modelos matemáticos e estatísticos aplicados diariamente à CARTEIRA, com o objetivo de garantir que o FUNDO esteja exposto apenas aos riscos inerentes à sua política de investimento e de acordo com os critérios de risco estabelecidos no Regulamento. Os principais modelos são: (i) V@R (Value at Risk) - estima a partir de séries temporais e variáveis estatísticas a perda financeira máxima para um dia; e (ii) Stress Testing - simula perda financeira num cenário econômico financeiro crítico utilizando expressivas variações dos preços dos ativos e derivativos da carteira.

Com relação ao gerenciamento de risco de liquidez, utiliza-se como base a análise da liquidez dos diferentes ativos investidos com o objetivo de cumprir as obrigações do FUNDO, incluindo depósitos de margem esperados e outras garantias, valores de resgate esperados em condições ordinárias, considerando o grau de dispersão da propriedade das cotas. O grau de liquidez será gerenciado de forma a ser compatível com os prazos previstos no Regulamento para pagamento dos pedidos de resgate.

Caso o FUNDO invista em cotas de outros fundos de investimento, serão considerados para a análise da liquidez: o volume investido em cada fundo investido, as regras de pagamento de resgate dos fundos investidos e o processo de gestão de liquidez do gestor dos fundos investidos. Outras medidas podem ser utilizadas internamente para monitorar o grau de liquidez dos ativos do FUNDO. Ações corretivas serão prontamente tomadas buscando a eliminação de distorções.

Os métodos utilizados pelo ADMINISTRADOR para gerenciar os riscos aos quais o FUNDO está sujeito não constituem garantia contra eventuais perdas patrimoniais que possam ser incorridas pelo

FUNDO, inclusive perda total ou mesmo perdas superiores ao capital investido, com a ocorrência de patrimônio líquido negativo.

Agência Classificadora de Risco

Não

CNPJ da agência de rating

N/A

Classificação atribuída pela agência de rating ao fundo

N/A

Padronização do disclaimer relativo à advertência da manutenção do serviço pela CVM

N/A

Apresentação do Administrador e do Gestor

O Daycoval Asset Management Administração de Recursos Ltda., com sede na Cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, na Avenida Paulista, nº. 1793, inscrita no CNPJ/MF sob nº 72.027.832/0001.02 (“ADMINISTRADOR”), devidamente credenciado na CVM como administradora de carteira, de acordo com o Ato Declaratório CVM n.º 8056, de 02 de dezembro de 2004, é responsável pelos serviços de administração geral do FUNDO e gestão da CARTEIRA do FUNDO.

O ADMINISTRADOR é uma instituição financeira com 48 anos de história, especializada em crédito para empresas, crédito para Pessoa Física (pessoal, consignado e financiamento de veículos), produtos de câmbio (comércio exterior e turismo) e investimentos.

É reconhecido em todo o País por seu perfil conservador de gestão e pela seriedade e competência nos negócios.

O ADMINISTRADOR conta com uma equipe de profissionais qualificados e experientes na administração e gestão de Fundos de Investimento em todas as classes de fundos, disponíveis para todos os segmentos de clientes (Varejo, Varejo Alta Renda, Corporativos, Investidores Institucionais, dentre outros).

Demais prestadores de serviços do Fundo

Distribuição: Banco Daycoval S.A.

Custódia e Escrituração de Cotas: Banco Daycoval S.A

Auditoria Independente: KPMG Auditores Independentes

Indicação 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

Política Distribuição

O principal distribuidor do Fundo é o Banco Daycoval S.A. ("DISTRIBUIDOR"), o qual atua por meio dos seus canais de distribuição internos para diversos segmentos de mercado, e oferta fundos de investimento geridos por um único gestor, ou por gestores ligados a um mesmo grupo econômico, sendo que preponderantemente são fundos geridos pelo ADMINISTRADOR, este na qualidade de gestor, que pertence ao mesmo grupo econômico do DISTRIBUIDOR. A remuneração paga ao DISTRIBUIDOR pela prestação de serviço consiste em um percentual da taxa de administração do Fundo, a qual está prevista no Regulamento do Fundo.

Disclaimers

Tipo ANBIMA: Renda Fixa - Duração Baixa - Grau de Investimento

A PRESENTE INSTITUIÇÃO ADERIU AO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO.

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 SERVIÇOS.

ESTE FUNDO UTILIZA 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 DESTES 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 DESTES 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.

Demais Informações Relevantes

Limite Mínimo para Aplicação Inicial: R\$ 500,00

Limite Máximo para Aplicação Inicial: Não há

Limite Mínimo para Permanência: R\$500,00

Limite Mínimo para Aplicações Adicionais: R\$500,00

Limite Máximo para Aplicações Adicionais: Não há

Horário Limite para Movimentação: 16:00hrs

Para maiores informações sobre condições de aplicações e resgates, vide Regulamento do FUNDO.

Forma de Comunicação com os Cotistas: As informações ou documentos para os quais o Regulamento, este Formulário de Informações Complementares ou a regulamentação em vigor exijam a “comunicação”, “acesso”, “envio”, “divulgação” ou “disponibilização” podem, a exclusivo critério do ADMINISTRADOR: (i) ser encaminhadas por meio físico aos cotistas; ou (ii) ser comunicados, enviados, divulgados ou disponibilizados aos cotistas, ou por eles acessados, por meio de canais eletrônico ou por outros meios expressamente previstos na regulamentação em vigor, incluindo a rede mundial de computadores (em conjunto, “Comunicação Eletrônica”).

As comunicações exigidas são consideradas efetuadas na data de sua disponibilização.

Admite-se, nas hipóteses em que o Regulamento, este Formulário de Informações Complementares ou a regulamentação em vigor exijam a “ciência”, “atesto”, “manifestação de voto” ou “concordância” dos cotistas, que estes se deem por meio eletrônico, observados os procedimentos do ADMINISTRADOR.

Assembleia Geral de Cotistas (“Assembleia Geral”):

A convocação da Assembleia Geral far-se-á com 10 dias de antecedência da data da realização da Assembleia Geral, por meio de correspondência, escrita ou eletrônica, encaminhada a cada um dos Cotistas. Das convocações constarão, obrigatoriamente, dia, hora e local em que será realizada a assembleia e, ainda, todas as matérias a serem deliberadas.

A Assembleia Geral poderá ser convocada pelo ADMINISTRADOR, pelo Custodiante ou por Cotistas que detenham, no mínimo, 5% (cinco por cento) do total das cotas emitidas pelo Fundo e poderá ser instalada com qualquer número de Cotistas, salvo para deliberações relacionadas à prestação de fiança, aval, aceite pelo Fundo ou quando o Fundo, que observará o quorum mínimo de dois terços das cotas emitidas pelo Fundo, cabendo a cada cota um voto.

Estarão aptos para votar na Assembleia Geral os Cotistas do Fundo inscritos no registro de cotistas na data da convocação da Assembleia Geral, seus representantes legais ou procuradores legalmente constituídos há menos de 1 (um) ano.

A critério do ADMINISTRADOR, os Cotistas também poderão votar por meio de comunicação escrita ou eletrônica, desde que recebida pelo ADMINISTRADOR antes do início da Assembleia Geral, observados os termos previstos na respectiva convocação da Assembleia Geral.

Os Cotistas poderão obter informações adicionais sobre o FUNDO por meio de carta, e-mail ou telefone, conforme informado pelo ADMINISTRADOR ou por meio do Serviço de Atendimento ao Cotista do FUNDO, mediante correspondência enviada para o ADMINISTRADOR, na Avenida Paulista, nº. 1793, CEP 01311-200, São Paulo - SP, por meio de telefone n.º (11) 3138-0461 ou por meio de endereço eletrônico: daycoval.asset@daycoval.com.br.

