

**FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES – ICVM 555
MODAL LION FUNDO DE INVESTIMENTOS MULTIMERCADO CREDITO
PRIVADO**

CNPJ n.º 06.893.041/0001-30
("FUNDO")

Emissão: 24/06/2016

Periodicidade mínima de divulgação da composição da carteira: Mensalmente, até o dia 10 do mês subsequente ao mês de referência, por tipo de ativo e emissor, podendo haver defasagem em tal divulgação, nos termos da legislação vigente.

DIVULGAÇÃO DE INFORMAÇÕES

| Informação | Local | Meio | Periodicidade |
|---|---|-----------------------|--|
| Valor da cota e patrimônio líquido do Fundo | E-mail cotista | Eletrônico | Diariamente |
| Balancete, composição da carteira, perfil mensal e lâmina de informações essenciais | Envio ao site da CVM | Arquivo | Até dia 10 de cada mês |
| Demonstração de desempenho do Fundo | Site do Administrador | Eletrônico | Data base 31/12, até 28/02 Data base 30/06, até 31/08 |
| Formulário de informações complementares | Site do Administrador | Eletrônico | Permanente |
| Demonstrações contábeis do Fundo | | | |
| Atos e Fatos Relevantes ocorridos ou relacionados ao funcionamento do Fundo | Site do Administrador | Eletrônico | Por evento |
| Extrato mensal de conta | Correio ou área logada no Modal Banking | Correio ou Eletrônico | Mensal |
| Convocação de assembleia geral de cotistas | Site do Administrador | Eletrônico | Por evento |

Solicitação de Informações pelo Cotista deverá ser direcionado para as áreas comerciais de atendimento ao Cotista através do email investimentos@modal.com.br.

EXPOSIÇÃO, EM ORDEM DE RELEVÂNCIA, DOS FATORES DE RISCO INERENTES À COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DO FUNDO

O cotista está sujeito aos seguintes riscos inerentes aos mercados nos quais o FUNDO

aplica seus recursos:

- Risco de crédito: inadimplemento de principal ou juros por parte de empresa emissora de títulos de dívida em que o FUNDO invista. Os contratos de derivativos estão eventualmente sujeitos ao inadimplemento da contraparte e à possibilidade da instituição garantidora não poder honrar sua liquidação;
- Risco de liquidez: dificuldade em honrar com os pagamentos de resgates solicitados, nos prazos legais e/ou no montante solicitado, além da possibilidade de venda de ativos com pouca demanda a preço abaixo do contabilizado;
- Risco de mercado: variação dos preços e cotações de mercado dos ativos que compõem a carteira do FUNDO;
- Risco proveniente do uso de derivativos: está relacionado à possibilidade dos instrumentos de derivativos não produzirem os efeitos esperados, bem com o ocasionar em perdas aos cotistas quando da realização ou vencimento das operações.
- Risco de concentração: a eventual concentração dos investimentos em determinados emissores, setores ou prazo de vencimento do ativo, pode aumentar a exposição aos riscos já mencionados, ocasionando volatilidade no valor de suas cotas;
- Risco sistêmico e de regulação: motivos exógenos, que afetam os investimentos financeiros como um todo e cujo risco não é eliminado através de diversificação, e mudanças nas regulamentações e/ou legislação.

Informações detalhadas podem ser obtidas no regulamento.

O gerenciamento do risco do fundo é realizado utilizando metodologia própria e é monitorado pelas áreas de risco de mercado e crédito, avaliando frequentemente a exposição das posições detidas a tais riscos.

DESCRIÇÃO DA POLÍTICA RELATIVA AO EXERCÍCIO DE DIREITO DE VOTO

| | |
|--|-----|
| O gestor exerce voto em assembleias dos ativos que compõem a carteira? | SIM |
|--|-----|

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 financeiros que confirmam aos seus titulares o direito de voto. O gestor, inclusive por meio de seu representante legal, comparecerá às assembleias cuja ordem do dia trate de Matérias Relevantes

Obrigatórias, quando exercerá o direito de voto tomando como princípio de decisão o cuidado e a diligência necessária, evitando práticas que possam ferir a relação de fidúcia com o cotista. A política de voto, em sua versão integral, e as informações relativas ao exercício de direito de voto, estão disponíveis no site www.modal.com.br

DESCRIÇÃO DA TRIBUTAÇÃO APLICÁVEL AO FUNDO E AOS SEUS COTISTAS

As operações da carteira do FUNDO não estão sujeitas ao Imposto de Renda e sujeitam-se a alíquota zero de IOF - Títulos e Valores Mobiliários, exceto:(i) As operações da carteira do FUNDO estão sujeitas à incidência de IOF/Derivativos Cambiais à alíquota de 1%, sendo possível sua majoração a qualquer tempo, mediante ato do Poder Executivo, até o percentual de 25%, conforme disposto na legislação vigente; (ii) A distribuição de juros sobre o capital próprio ou pagamento de rendimentos (no caso de ativos financeiros sujeitos a tributação sobre a renda de acordo com a legislação vigente), realizados pelos emissores dos ativos financeiros tomados em empréstimo pelo FUNDO (posição tomadora), no decurso das operações, estão sujeitos à incidência de imposto de renda à alíquota de 15%.

A) Incidirá imposto de renda na fonte sobre os rendimentos auferidos no FUNDO, por ocasião do resgate, em função do prazo de permanência, às seguintes alíquotas de longo prazo:

I - 22,5% em aplicações com prazo de até 180 dias de permanência;

II - 20% em aplicações com prazo de 181 dias até 360 dias de permanência;

III - 17,5% em aplicações com prazo de 361 dias até 720 dias de permanência;

IV - 15% em aplicações com prazo acima de 720 dias de permanência.

B) Semestralmente, no último dia útil dos meses de maio e novembro, incidirá imposto de renda na fonte sobre os rendimentos auferidos no FUNDO à alíquota de 15%.

C) Por ocasião do resgate das cotas será aplicada alíquota complementar de acordo com o previsto nos incisos I a III do item A.

D) Incidirá IOF- Títulos e Valores Mobiliários à alíquota de 1% ao dia, limitado aos rendimentos auferidos.

E) O disposto acima não se aplica aos cotistas que não estão sujeitos à tributação, conforme legislação tributária e fiscal vigente, desde que apresentada documentação comprobatória.

DESCRIÇÃO DA POLÍTICA DE ADMINISTRAÇÃO DE RISCO

A ADMINISTRADORA possui uma área de risco responsável pelo controle, monitoramento e gerenciamento dos riscos a que estão expostos os fundos de investimento. Para o gerenciamento do risco de mercado é utilizado modelo estatístico VaR (Value at Risk), que mensura a perda máxima esperada, dado um nível de confiança e um período de análise, em condições normais de mercado e a Análise de Stress que é utilizada para estimar a perda potencial, sob as condições mais adversas de mercado ocorridas em determinado período, ou sob cenários de stress. O controle do risco de crédito é realizado por meio de uma política de crédito e um processo de análise dos emissores dos ativos financeiros atendendo à política de investimento do FUNDO. Para atendimento aos resgates e outras exigibilidades, o gerenciamento de liquidez no FUNDO utiliza modelo que contempla projeção de fluxo de BANCO MODAL, histórico de aplicações e resgate, classificação de liquidez dos ativos baseada no histórico de negociação no mercado secundário e acompanhamento de concentração por vencimentos, por prazo e por cotistas. OS MÉTODOS UTILIZADOS PELA ADMINISTRADORA PARA GERENCIAR OS RISCOS A QUE O FUNDO SE ENCONTRA SUJEITO NÃO CONSTITUEM GARANTIA CONTRA EVENTUAIS PERDAS PATRIMONIAIS QUE POSSAM SER INCORRIDAS PELO FUNDO.

IDENTIFICAÇÃO DA AGÊNCIA DE CLASSIFICAÇÃO DE RISCO DE CRÉDITO

| | |
|---|-----|
| Fundo utiliza agência de classificação de rating? | NÃO |
|---|-----|

O BANCO MODAL S.A., inscrito no CNPJ/MF sob o nº 30.723.886/0001-62 (“BANCO MODAL”), instituição financeira, por meio de seu Diretor de Administração de Recursos de Terceiros, encontra-se devidamente registrada perante a Comissão de Valores Mobiliários (CVM) e autorizada para a prestação dos serviços de administração de carteira de valores mobiliários, conforme Ato Declaratório CVM nº. 5.986, de 1º de junho de 2000, realiza a administração do FUNDO. A MODAL ADMINISTRADORA RECURSOS LTDA., inscrita no CNPJ/MF sob nº. 01.116.811/0001-15 (“MODAL ADM RECURSOS”) com autorização na prestação de Administração de Recursos de Terceiros, através do Ato Declaratório CVM nº 8.870, de 21 de Julho de 2006, atua de maneira segregada das atividades que envolvam recursos próprios da Instituição, garantindo transparência, independência, exclusividade de atuação e conduta ética na gestão de recursos de terceiros. Buscando sempre se adequar às melhores práticas de mercado, a MODAL ADM RECURSOS possui estrutura técnica qualificada, formada pelas áreas

de: administração, produto, estratégia e inteligência de mercado, gestão de ativos, estudos econômicos e análise setorial, pesquisa quantitativa, Fundos estruturados e gerenciamento de risco. A MODAL ADM RECURSOS possui, ainda, área de Compliance, responsável por acompanhar a conformidade técnica das operações de gestão e conta com suporte jurídico do BANCO MODAL na prestação de assessoria especializada. Além da gestão de riscos de mercado e crédito, onde são avaliados os níveis de exposição de suas operações. A área de gestão conta ainda com profissionais voltados para avaliação dos ativos passíveis de aquisição pelo fundo, bem como a avaliação das oportunidades de negócios para as quais o fundo poderá obter resultados positivos.

O BANCO MODAL é aderente ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para as atividades listadas abaixo:

- Ética;
- Negociação de Instrumentos Financeiros;
- Distribuição de Produtos de Investimento no Varejo;
- Processos da Regulação e Melhores Práticas;
- Fundos de Investimento
- Fundos de Investimento - Distribuição;
- Programa de Certificação Continuada;
- FIP/FIEE Anbima/Abvcap;
- Ofertas Públicas de Distribuição e Aquisição de Valores Mobiliários; e
- Serviços Qualificados ao Mercado de Capitais.

A Modal Administradora de Recursos é aderente aos códigos de Fundos de Investimento e Código de FIP/FIEE Abvcap, em função de pertencer ao Grupo Econômico do Banco Modal.

RELAÇÃO DOS DEMAIS PRESTADORES DE SERVIÇOS DO FUNDO

| | |
|---------------------------------|---------------------------------------|
| Gestão de carteira | MODAL ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA |
| Distribuição de Cotas | BANCO MODAL |
| Custódia e Controladoria | BANCO MODAL |
| Escrituração de Cotas | BANCO MODAL |
| Auditor Independente | PARTNERSHIP AUDITORES INDEPENDENTES |

DESCRIÇÃO DA POLÍTICA DE DISTRIBUIÇÃO DE COTAS

As cotas do FUNDO são distribuídas exclusivamente pela ADMINISTRADORA por meio da suas Agências. A ADMINISTRADORA oferta ao cotista e potenciais

investidores preponderantemente fundos de investimento por ela geridos. O serviço de distribuição de cotas de fundos de investimento é remunerado somente pela taxa de administração, não havendo qualquer cobrança adicional ou repasse para terceiros.

OUTRAS INFORMAÇÕES

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 (CVM). 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. 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 SUBSTITUI. 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. A PRESENTE INSTITUIÇÃO ADERIU AO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO. ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS QUE PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS 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. ESTE FUNDO PODE TER SUAS COTAS COMERCIALIZADAS POR VÁRIOS DISTRIBUIDORES, O QUE PODE GERAR DIFERENÇAS DE HORÁRIOS E VALORES MÍNIMOS PARA APLICAÇÃO OU RESGATE, E TELEFONES PARA ATENDIMENTO AO CLIENTE.



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