



BNP PARIBAS

RELATÓRIO DE INFORMAÇÕES AO INVESTIDOR

(Em conformidade com o Art. 2º do Anexo Complementar VII da RP de AGRT ANBIMA)

I. IDENTIFICAÇÃO

- **Nome do Fundo:** INVESTO BLOOMBERG GLOBAL BOND ETF
- **CNPJ do Fundo:** 43.216.095/0001-98
- **Nome da Classe:** INVESTO BLOOMBERG GLOBAL BOND ETF CLASSE DE ÍNDICE – RESPONSABILIDADE LIMITADA

II. FATORES DE RISCO

a. Risco de mercado – O valor da Classe pode variar em função das oscilações nas taxas de juros globais, nas condições de crédito dos emissores de títulos e nas variações cambiais que afetam os ativos em moeda estrangeira.

b. Risco sistêmico – Eventos macro-econômicos, políticos ou sanitários de grande magnitude podem impactar simultaneamente todos os mercados de renda fixa, resultando em perdas generalizadas para a Classe.

c. Risco de crédito – Apesar da 95 % da carteira ser investida em títulos de alta qualidade, existe a possibilidade de inadimplência ou deterioração de crédito dos emissores, o que pode reduzir o valor dos ativos e, conseqüentemente, o Valor Patrimonial da Cota.

d. Risco de descolamento de rentabilidade – A performance da Classe pode divergir do índice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Float Adjusted RIC Capped Hedged to USD devido a (i) taxa de administração e demais despesas; (ii) diferenças de timing entre a compra/venda dos ativos e a variação do índice; (iii) custos operacionais de hedge cambial; (iv) uso de derivativos para gerenciamento de risco que podem gerar resultados diferentes dos do índice.

e. Risco de liquidez das cotas (ETF) – Não há garantia de existência de mercado ativo para negociação das cotas. O preço de negociação pode apresentar ágio ou deságio em relação ao Valor Patrimonial, e os lotes negociáveis podem ser limitados.

f. Risco de liquidez dos ativos – Os títulos podem apresentar diferentes níveis de liquidez (títulos de governos desenvolvidos são geralmente líquidos, enquanto títulos corporativos de alta rentabilidade podem ser menos negociados). Em situações de stress, a dificuldade de vender esses ativos pode impedir a Classe de honrar solicitações de resgate ou de efetuar o rebalanceamento, comprometendo a solvência da Classe.

g. Risco de não atender aos requisitos mínimos para emissão e resgate – Integralizações e resgates só são aceitos mediante entrega de “cesta” por Agente Autorizado dentro do “Horário de Corte” (15 min após o fechamento da B3) e da apresentação da documentação exigida (Declaração de Isenção ou IRF). O não cumprimento impede a execução da ordem.

h. Risco de ágio e deságio – As cotas podem ser negociadas acima (ágio) ou abaixo (deságio) do seu Valor Patrimonial ou Indicativo, refletindo a oferta e demanda no mercado secundário.

i. Risco de o provedor do índice parar de administrar ou manter o índice – O índice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Float Adjusted RIC Capped Hedged to USD é mantido por Bloomberg. Caso a Bloomberg cesse a administração ou modifique a metodologia, o Administrador deve convocar Assembleia de Cotistas para deliberar sobre a mudança de objetivo ou, na ausência de aprovação, iniciar a liquidação da Classe.



BNP PARIBAS

j. Risco de suspensão da negociação das cotas – A CVM ou a B3 podem suspender a negociação das cotas a qualquer momento, quando julgarem necessário para proteger os cotistas ou por questões regulatórias/operacionais.

k. Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice – A Classe depende da precisão e da disponibilidade das informações e da metodologia fornecida pela Bloomberg. Falhas ou atrasos no fornecimento ou divulgação do índice podem comprometer a capacidade de replicação do objetivo da Classe.

III. INFORMAÇÕES SOBRE FUNDOS DE ÍNDICE (ETF)

a. O que são os Fundos de Índice (ETF) – São fundos que buscam replicar, de forma passiva, a performance de um índice de referência (no caso, o Bloomberg Global Aggregate ex-USD Float Adjusted RIC Capped Hedged to USD). As cotas são negociadas em bolsa como se fossem ações, permitindo ao investidor obter exposição ao benchmark com apenas um instrumento.

b. Semelhanças e diferenças entre Fundos de Índice (ETF) e demais Fundos de Investimento

- **Semelhanças:** são regulados pela CVM, possuem patrimônio segregado por classe, contam com administração, custódia e auditoria independentes.
- **Diferenças:** (i) negociação contínua em bolsa (preço varia ao longo do dia); (ii) preço de mercado pode divergir do Valor Patrimonial (ágio/deságio); (iii) gestão passiva – não há objetivo de superar o índice; (iv) não há taxa de performance; (v) a liquidez das cotas depende da existência de mercado secundário, não de chamadas de resgate ao administrador.

c. Como ocorre o processo de integralização e resgate – As operações são realizadas por **Agentes Autorizados**. Para integralizar, o agente entrega à Classe uma **cesta** (até 5 % em ativos permitidos ou caixa, o restante em títulos que compõem o índice) dentro do Horário de Corte. Em troca, a Classe emite **Lotes Mínimos de Cotas**. Para resgate, o agente apresenta a cesta correspondente e recebe as cotas a serem canceladas. As transações são liquidadas em D+2.

d. Estratégias permitidas pela regulação – A regulação permite: (i) investimento direto nos títulos que compõem o índice; (ii) posição líquida em contratos futuros ou swaps de taxa de juros e câmbio para hedge, dentro dos limites de margem de garantia (até 20 % do patrimônio líquido); (iii) até 5 % do patrimônio em Investimentos Permitidos (títulos públicos, títulos de renda fixa de instituição financeira, fundos de renda fixa “Simples/Curto Prazo/Referenciado” e operações compromissadas); (iv) uso de derivativos exclusivamente para gerenciamento de risco, nunca para alavancagem ou estratégias de retorno excessivo.

e. Regulação aplicável – Resolução CVM n.º 175/2022 (e suas atualizações), Anexo Normativo V da referida Resolução, Lei 11.555/2007, Código Civil (arts. 1.368-D) e as normas da B3 relativas à negociação de ETFs.

f. Como as Classes atingem seu objetivo – Mantendo, no mínimo, 95 % do patrimônio investido nos títulos que compõem o índice Bloomberg Global Aggregate ex-USD, e utilizando até 5 % em ativos permitidos ou hedges de risco. O Gestor segue uma política de indexação rígida, realizando rebalanceamentos trimestrais de acordo com a metodologia da Bloomberg e podendo suspender integralizações ou resgates nos períodos de 5 dias úteis antes e depois da data de rebalanceamento, conforme previsto no regulamento.

g. Como o investidor pode acompanhar a evolução do preço da Classe – Cotação em tempo real na B3; Valor Patrimonial da Cota (VPC) calculado diariamente ao final de cada Dia de Cota; composição da carteira e demais informações divulgadas no website oficial do fundo: <https://investoetf.com/BNDX11>.



BNP PARIBAS

IV. GLOSSÁRIO

- **Agente Autorizado** – Corretora que tenha firmado um *Contrato de Agente Autorizado* para realizar integralizações e resgates de cotas da Classe.
- **Cesta** – Conjunto de ativos (títulos que compõem o índice, Investimentos Permitidos, Valores em Dinheiro e/ou Direitos sobre Ações) que deve ser entregue para a emissão ou resgate de *Lotes Mínimos de Cotas*, conforme calculado pelo Gestor e divulgado diariamente.
- **Lote Mínimo de Cotas** – Quantidade mínima de cotas que pode ser emitida ou resgatada, a critério do Gestor, mediante apresentação de uma *Ordem de Integralização* ou *Ordem de Resgate* por um Agente Autorizado.
- **Ordem de Integralização** – Ordem emitida por um Agente Autorizado para que a Classe emita e entregue um Lote Mínimo de Cotas em contrapartida à entrega simultânea de uma Cesta.
- **Ordem de Resgate** – Ordem emitida por um Agente Autorizado para que a Classe entregue a Cesta em troca da devolução de um Lote Mínimo de Cotas.
- **Registro de Cotista** – Sujeito a tributação que solicita a um Agente Autorizado que efetue o resgate de um ou mais Lotes Mínimos de Cotas detidos por tal cotista.
- **Valores em Dinheiro** – Parcela da cesta, se houver, que consiste em moeda corrente nacional.
- **Valor Patrimonial das Cotas** – Resultado da divisão do Patrimônio Líquido da Classe pelo número de cotas em circulação, calculado ao final de cada *Dia de Cota*.
- **Direitos sobre Ações** – Cupons, direitos, recibos de subscrição e certificados de desdobramento relativos a valores mobiliários eventualmente existentes na carteira da Classe.
- **Dia de Pregão** – Qualquer dia em que a B3 esteja aberta para negociações.
- **Dia de Cota** – Qualquer dia útil (excluindo sábados, domingos, feriados nacionais e dias sem expediente na B3) em que é calculado o Valor Patrimonial das Cotas.
- **Dia Útil** – Entende-se por dia útil qualquer dia que não seja (i) sábado, domingo ou feriado nacional, ou (ii) dia em que a B3 não tenha expediente.

V. TAXAS E DEMAIS DESPESAS DA CLASSE

Esta modalidade de 231 investimento possui outros custos envolvidos, além das despesas da própria Classe. Antes de investir, verifique os custos com corretagem, emolumentos e Custódia.

As taxas poderão ser consultadas no link: <https://data.anbima.com.br/fundos/transparencia-de-taxas-de-fundos/43216095000198>

VI. AVISOS IMPORTANTES

- **a.** “O investimento em Fundos de Índice envolve riscos, inclusive de descolamento do índice de referência e relacionados à liquidez das cotas no mercado secundário. Antes de investir em sua(s) Classe(s) e/ou Subclasse(s), leia o Regulamento, os respectivos anexos descritivos das Classes e os apêndices das Subclasses, conforme aplicável e as informações constantes do site (endereço do website dedicado), em especial, a seção fatores de risco.”
- **b.** “Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do Regulamento do Fundo de Investimento e dos respectivos anexos descritivos das Classes e dos apêndices das Subclasses, conforme aplicável, ao aplicar seus recursos.”
- **c.** “Esta Classe utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.”

Parágrafo único. Os materiais de divulgação dos Fundos de Índice (ETF), de suas Classes e/ou Subclasses, constantes do website, devem apresentar linguagem clara e moderada, advertindo os investidores para o risco do investimento, além de conter a expressão “Material Publicitário”, de forma a alertar os investidores de que não são suficientes para a tomada de decisão de investimento.



BNP PARIBAS

MATERIAL

PUBLICITÁRIO

Este material é meramente informativo e não constitui recomendação de investimento. Os dados aqui apresentados não são suficientes para a tomada de decisão de investimento.