



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 US BOND ETF
- **CNPJ do Fundo:** 43.216.061/0001-01
- **Nome da Classe:** INVESTO BLOOMBERG US BOND ETF CLASSE DE ÍNDICE – RESPONSABILIDADE LIMITADA

II. FATORES DE RISCO

- **a. Risco de mercado** – As variações nas taxas de juros globais, nas condições macro-econômicas internacionais e nas cotações dos títulos que compõem o Bloomberg US Aggregate Bond Float-Adjusted Index podem afetar negativamente o valor da Classe.
 - **b. Risco sistêmico** – Eventos que comprometam o sistema financeiro mundial (crises de liquidez, colapsos de instituições financeiras, choques políticos ou sanitários) podem impactar simultaneamente todos os ativos da carteira, reduzindo a capacidade de a Classe acompanhar o índice.
 - **c. Risco de crédito** – Apesar da 95 % da carteira estar investida em títulos de alta qualidade, existe o risco de inadimplência dos emissores ou de contraparte nas operações de derivativos e de empréstimo de títulos utilizadas para gestão de risco.
 - **d. Risco de descolamento de rentabilidade (tracking-error)** – A performance da Classe pode divergir do índice devido a (i) taxa de administração e despesas operacionais; (ii) diferenças de timing entre a negociação dos ativos e a atualização do índice; (iii) custos de execução de ordens; (iv) necessidade de manter caixa para atender resgates.
 - **e. Risco de liquidez das cotas (ETF)** – Não há garantia de existência de mercado ativo para negociação das cotas; o preço negociado pode apresentar ágio ou deságio em relação ao Valor Patrimonial da Cota (VPC) e os lotes negociáveis podem ser limitados.
 - **f. Risco de liquidez dos ativos** – Em momentos de stress nos mercados de renda fixa internacional, a profundidade de negociação dos títulos pode diminuir, dificultando a venda de ativos para atender solicitações de resgate ou para rebalancear a carteira. Essa situação pode comprometer a solvência da Classe e gerar perdas significativas.
 - **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 oferta e demanda no mercado secundário.
 - **i. Risco de o provedor do índice parar de administrar ou manter o índice** – O índice Bloomberg US Aggregate Bond Float-Adjusted Index é mantido por Bloomberg. Caso a Bloomberg cesse a administração, modificar a metodologia ou descontinuar o índice, o Administrador deve comunicar imediatamente os cotistas e convocar Assembleia de Cotistas para aprovação de mudança de objetivo ou liquidação da Classe.
 - **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 a proteção dos cotistas ou por razões regulatórias/operacionais.
 - **k. Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice** – A Classe depende da precisão, pontualidade e continuidade das informações e da metodologia fornecidas 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. As cotas são listadas e negociadas em bolsa como ações, permitindo ao investidor obter exposição ao benchmark com um único instrumento.
- **b. Semelhanças e diferenças entre Fundos de Índice (ETF) e demais Fundos de Investimento**
 - *Semelhanças:* regidos 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 exclusivamente por **Agentes Autorizados**. Para integralizar, o agente entrega à Classe uma **cesta** contendo, no mínimo, 95 % dos ativos que compõem o índice e até 5 % em ativos permitidos ou caixa, 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 autoriza: (i) investimento direto nos títulos que compõem o índice; (ii) posição líquida em contratos futuros ou swaps para gestão de risco e aprimoramento do tracking-error, respeitando limite de margem de garantia de 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) empréstimo de títulos (securities-lending) até 70 % dos ativos, com receitas revertidas integralmente para a Classe.
- **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 em (i) títulos que replicam o Bloomberg US Aggregate Bond Float-Adjusted Index; (ii) posições líquidas em derivativos de risco-gerenciamento; (iii) cotas de outros fundos que sigam o mesmo benchmark. O Gestor segue política de réplica rígida, realizando rebalanceamentos conforme a periodicidade definida pelo provedor do índice 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, desempenho e demais comunicados publicados no website oficial do fundo: <https://investoetf.com/USDB11>.

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.



BNP PARIBAS

- **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/43216061000101>

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.

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.