



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: NU LETRAS FINANCEIRAS ANBIMA FUNDO DE ÍNDICE

CNPJ do Fundo: 63.734.820/0001-27

Nome da classe: NU LETRAS FINANCEIRAS ANBIMA CLASSE DE ÍNDICE RESPONSABILIDADE LIMITADA

II. FATORES DE RISCO

a. **Risco de mercado** – Variações nas taxas de juros, no câmbio e nos preços dos ativos de renda fixa e letras financeiras que compõem o índice podem impactar o valor da classe.

b. **Risco sistêmico** – Eventos macro-econômicos ou crises financeiras que afetem o sistema bancário ou o mercado de crédito podem gerar perdas simultâneas em grande parte dos ativos da carteira.

c. **Risco de crédito** – Possibilidade de inadimplência ou deterioração da qualidade de crédito dos emissores das letras financeiras incluídas no índice.

d. **Risco de descolamento de rentabilidade** – Diferenças entre o retorno da classe e o desempenho do índice podem ocorrer devido a custos operacionais, timing de rebalanceamento e receitas ainda não recebidas.

e. **Risco de liquidez das cotas (ETF)** – Não há garantia de mercado ativo para negociação das cotas; o preço pode apresentar ágio ou deságio em relação ao Valor Patrimonial da Cota.

f. **Risco de liquidez dos ativos** – Em situações de stress, a negociação das letras financeiras pode ser limitada, dificultando a realização de resgates e comprometendo a solvência da classe.

g. **Risco de não atender aos requisitos mínimos para emissão e resgate** – Integralizações e resgates dependem da entrega de “cesta” por Agente Autorizado dentro do horário de corte estabelecido e da apresentação da documentação exigida; a falta de cumprimento impede a operação.

h. **Risco de ágio e deságio** – As cotas podem ser negociadas acima ou abaixo do seu Valor Patrimonial ou Indicativo.

i. **Risco de o provedor do índice parar de administrar ou manter o índice** – Caso a B3 ou a entidade responsável interrompa a manutenção do índice utilizado como referência, o Administrador deverá convocar Assembleia de Cotistas para deliberar sobre 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 proteção dos investidores ou por questões regulatórias.

k. **Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice** – A classe depende da precisão e da disponibilidade das informações e da metodologia fornecidas pelo provedor do índice; falhas ou atrasos podem comprometer a capacidade de replicação.



BNP PARIBAS

III. INFORMAÇÕES SOBRE FUNDOS DE ÍNDICE (ETF)

a. **O que são os Fundos de Índice (ETF)** – Veículos que buscam replicar passivamente a performance de um índice de referência, cujas cotas são negociadas em bolsa como ações.

b. **Semelhanças e diferenças** – Semelhanças: regulação pela CVM, patrimônio segregado, administração, custódia e auditoria independentes. Diferenças: negociação contínua em bolsa, possibilidade de ágio/deságio, gestão exclusivamente passiva, ausência de taxa de performance.

c. **Processo de integralização e resgate** – Realizado por **Agentes Autorizados**. Integralização: o agente entrega à classe uma **cesta** (mínimo 95 % dos ativos que compõem o índice e até 5 % em ativos permitidos ou caixa) dentro do “Horário de Corte”. A classe emite **Lotes Mínimos de Cotas** correspondentes. Resgate: o agente apresenta a cesta e recebe as cotas a serem canceladas. Liquidação em D+2.

d. **Estratégias permitidas** – Investimento direto nos componentes do índice, posição líquida em contratos futuros ou swaps de taxa de juros para gestão de risco, até 5 % do patrimônio em Investimentos Permitidos (títulos públicos, fundos de renda fixa “Simples/Curto Prazo/Referenciado”, operações compromissadas) e uso de derivativos exclusivamente para hedge, limitado a 20 % da carteira.

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

f. **Como a classe atinge seu objetivo** – Mantendo, no mínimo, 95 % do patrimônio investido nos ativos que replicam o índice de referência, 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.

g. **Como o investidor pode acompanhar a evolução do preço** – Cotação em tempo real na B3; Valor Patrimonial da Cota calculado diariamente ao final de cada Dia de Cota; composição da carteira e demais informações disponíveis no website oficial do fundo: <https://www.nuasset.nu/etfs/NLFA11>.

IV. GLOSSÁRIO

- **Agente Autorizado** – Corretora que tenha firmado contrato para efetuar integralizações e resgates de cotas da classe.
- **Cesta** – Conjunto de ativos (cotas do fundo-alvo, Investimentos Permitidos, Valores em Dinheiro e/ou Direitos sobre Ações) que deve ser entregue para a emissão ou resgate de Lotes Mínimos de Cotas.
- **Lote Mínimo de Cotas** – Quantidade mínima de cotas que pode ser emitida ou resgatada, a critério do gestor, mediante apresentação de Ordem de Integralização ou Ordem de Resgate por Agente Autorizado.
- **Ordem de Integralização** – Ordem emitida por Agente Autorizado para que a classe entregue um Lote Mínimo de Cotas em troca da entrega simultânea de uma Cesta.
- **Ordem de Resgate** – Ordem emitida por 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 ao Agente Autorizado o resgate de cotas que detém.
- **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.



BNP PARIBAS

- **Dia de Cota** – Qualquer dia útil (excluindo sábados, domingos, feriados nacionais e dias sem expediente na B3) em que se calcula 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/63734820000127>. Para informações completas sobre taxas, consulte o link indicado.

VI. AVISOS

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.