



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 NASDAQ BRAZIL BITCOIN CARRY FUTURES FUNDO DE ÍNDICE

CNPJ do Fundo: 61.846.717/0001-43

Nome da classe: NU NASDAQ BRAZIL BITCOIN CARRY FUTURES CLASSE DE ÍNDICE – RESPONSABILIDADE LIMITADA

II. FATORES DE RISCO

- **a. Risco de mercado** – A performance da classe está vinculada ao contrato futuro de Bitcoin (BIT) negociado na B3; variações de preço do Bitcoin podem gerar perdas significativas.
- **b. Risco sistêmico** – Crises no mercado de cripto-ativos ou eventos macro-econômicos podem impactar simultaneamente o preço do Bitcoin e dos ativos de referência (CDI).
- **c. Risco de crédito** – Possível inadimplência ou deterioração de crédito das contrapartes em contratos futuros ou nos instrumentos de referência CDI.
- **d. Risco de descolamento de rentabilidade** – Diferenças entre o retorno da classe e o desempenho do índice Nasdaq Brazil Bitcoin Futures TR Index podem ocorrer por custos operacionais, atrasos na atualização de preços dos contratos futuros e receitas ainda não recebidas.
- **e. Risco de liquidez das cotas (ETF)** – Não há garantia de mercado secundário ativo; as cotas podem negociar com ágio ou deságio em relação ao Valor Patrimonial.
- **f. Risco de liquidez dos ativos** – Em períodos de alta volatilidade do Bitcoin, a negociação dos contratos futuros pode tornar-se limitada, dificultando a execução de resgates e afetando 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 e da documentação exigida; o não 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 Nasdaq Inc. ou a Compass Financial Technologies interrompam a manutenção ou cálculo do índice Nasdaq Brazil Bitcoin Futures TR Index, 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, por questões regulatórias ou de proteção ao investidor.
- **k. Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice** – A classe depende da precisão e disponibilidade das informações fornecidas pela Nasdaq Inc. e pela Compass Financial Technologies; falhas ou atrasos podem comprometer a capacidade de replicar o objetivo da classe.

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, negociando cotas em bolsa como se fossem ações.
- **b. Semelhanças e diferenças** – Semelhanças: regulação CVM, patrimônio segregado, administração e custódia independentes. Diferenças: negociação em bolsa, possibilidade de



BNP PARIBAS

ágio/deságio, gestão passiva sem objetivo de superar o índice, e exposição a ativos de cripto-ativos que apresentam alta volatilidade.

- **c. Processo de integralização e resgate** – Realizado por Agentes Autorizados. O agente entrega à classe uma cesta ($\geq 95\%$ dos ativos que compõem o índice + até 5% em ativos permitidos ou caixa) dentro do Horário de Corte; a classe emite Lotes Mínimos de Cotas. Para resgate, a cesta é apresentada e as cotas são canceladas. Liquidação em D+2.
- **d. Estratégias permitidas** – Investimento direto nos componentes do índice (contrato futuro de Bitcoin e instrumentos referenciados ao CDI); posição líquida em contratos futuros; até 5% do patrimônio em Investimentos Permitidos (títulos públicos, fundos de renda fixa “Simples/Curto Prazo/Referenciado”, operações compromissadas); uso de derivativos exclusivamente para hedge, limitado a 20% da carteira.
- **e. Regulação aplicável** – Resolução CVM n.º 175/2022, Anexo Normativo V, Lei 11.555/2007, Código Civil (arts. 1.368-D) e normas da B3 relativas a ETFs.
- **f. Como a classe atinge seu objetivo** – Mantendo, no mínimo, 95% do patrimônio em ativos que compõem o índice Nasdaq Brazil Bitcoin Futures TR Index (contrato futuro de Bitcoin e instrumentos CDI) e em posições de hedge relacionadas, realizando rebalanceamentos conforme a periodicidade definida pela Nasdaq e pela B3, 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; informações de carteira e desempenho disponíveis no website oficial: <https://www.nuasset.nu/etfs/NBIT11>.

IV. GLOSSÁRIO

- **Agente Autorizado** – Corretora autorizada a realizar integralizações e resgates de cotas.
- **Cesta** – Conjunto de ativos (cotas de fundo-alvo, Investimentos Permitidos, Valores em Dinheiro e/ou Direitos sobre Ações) que deve ser entregue para 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 Ordem de Integralização ou Ordem de Resgate por Agente Autorizado.
- **Ordem de Integralização** – Ordem que obriga a classe a emitir e entregar um Lote Mínimo de Cotas em troca da entrega simultânea de uma Cesta.
- **Ordem de Resgate** – Ordem que obriga a classe a entregar 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, constituída 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 fins de semana, feriados e dias sem expediente na B3) em que é calculado o Valor Patrimonial das Cotas.
- **Dia Útil** – Dia que não seja sábado, domingo, feriado nacional ou dia sem expediente na B3.

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.”



BNP PARIBAS

As taxas poderão ser consultadas no link: <https://data.anbima.com.br/fundos/transparencia-de-taxas-de-fundos/61846717000143>

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.