



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: TREND ETF S&P / B3 DÓLAR FUNDO DE ÍNDICE

CNPJ: 63.747.438/0001-58

Classe: TREND ETF S&P / B3 DÓLAR CLASSE DE ÍNDICE - RESPONSABILIDADE LIMITADA

II. FATORES DE RISCO

a. Risco de mercado – Exposição ao S&P 500 combinada à taxa de câmbio USD/BRL; a volatilidade das ações americanas e da moeda pode gerar perdas.

b. Risco sistêmico – Crises macroeconômicas globais, variações nas políticas monetárias dos EUA ou do Brasil que afetem simultaneamente mercado de ações e câmbio.

c. Risco de crédito – Securities lending permitido até 70 % do NAV; risco de inadimplência da contraparte nos empréstimos de cotas ou de contratos de swap cambial.

d. Risco de descolamento de rentabilidade (tracking error) – Diferenças entre a rentabilidade da cota e a do S&P / B3 Dólar podem surgir por custos operacionais, limites de alocação (mínimo 95 % em ativos de réplica) e impossibilidade de usar alavancagem.

e. Risco de liquidez das cotas da Classe (ETF) – Cotadas na B3; em períodos de alta volatilidade cambial podem aparecer ágio ou deságio em relação ao NAV.

f. Risco de liquidez dos ativos – Embora os componentes do S&P 500 sejam líquidos, a exposição cambial pode gerar atritos e custos adicionais na conversão USD → BRL.

g. Risco de não atender aos requisitos mínimos para emissão e resgate – Emissão/resgate apenas em lotes mínimos via Agente Autorizado; falhas na entrega da cesta (cotas de ações, contratos cambiais, valores em dinheiro) podem impedir a operação.

h. Risco de ágio e deságio na negociação das cotas – Diferenças entre preço de mercado e NAV podem ser acentuadas em momentos de forte variação cambial.

i. Risco de o provedor do índice parar de administrar ou manter o índice – Interrupção ou mudança metodológica do S&P / B3 Dólar Index pode gerar desvio temporário da meta de réplica.

j. Risco de suspensão da negociação das cotas – CVM ou B3 podem suspender a negociação em situações extraordinárias.

k. Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice – Alterações metodológicas ou interrupções na divulgação do índice podem impactar a capacidade de réplica exata.

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, com cotas negociadas em bolsa como ações.



BNP PARIBAS

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 passiva, ausência de taxa de performance.

c. Processo de integralização e resgate – Realizado por Agente Autorizado mediante Lote Mínimo de Cotas; a cesta inclui cotas das ações do S&P 500, contratos de swap ou forward cambial (USD/BRL) e valores em dinheiro, conforme previsto no regulamento da classe.

d. Estratégias permitidas pela regulação – Investimento mínimo de 95 % em ativos que compõem o índice; uso de securities lending até 70 % dos ativos; vedada alavancagem, estratégias sintéticas ou inversas.

e. Regulação aplicável – Resolução CVM 175/2022 e seus anexos, que estabelecem requisitos de divulgação, criação de classes e limites prudenciais.

f. Como o ETF atinge seu objetivo – Alocando predominantemente nas ações do S&P 500 e nos contratos cambiais que replicam a taxa USD/BRL, respeitando limites de concentração e de empréstimo.

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.xpasset.com.br/fundos/dolx11/>).

IV. GLOSSÁRIO

- **Agente Autorizado** – Corretora que tem contrato para efetuar integralizações e resgates de cotas.
- **Cesta** – Conjunto de ativos (cotas das ações do S&P 500, contratos cambiais, valores em dinheiro e eventuais direitos) 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 Ordem de Integralização/Resgate.
- **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** – Não aplicáveis a este fundo; campo permanece vazio.
- **Dia de Pregão** – Qualquer dia em que a B3 está aberta para negociações.
- **Dia de Cota** – Dia útil em que se calcula o Valor Patrimonial das Cotas.
- **Dia Útil** – Dia que não seja sábado, domingo, feriado nacional ou dia sem expediente na B3.
- **ETF** – Fundo de índice negociado em bolsa.
- **Tracking error** – Diferença entre a rentabilidade da cota e a do índice de referência.
- **Ágio/Deságio** – Diferença entre preço de negociação da cota e seu Valor Patrimonial Líquido.

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/63747438000158>. Para informações completas sobre taxas, consulte o link indicado.



BNP PARIBAS

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.