

**CLASSE ÚNICA DE COTAS DO INVESTO BLUESTAR TOP 10 US LISTED ALTERNATIVE ASSET MANAGERS ETF FUNDO DE ÍNDICE – RESPONSABILIDADE LIMITADA**

CNPJ nº 45.295.262/0001-69

**INFORMAÇÕES SOBRE O ÍNDICE**

**DA CLASSE ÚNICA DE COTAS DO INVESTO BLUESTAR TOP 10 US LISTED ALTERNATIVE ASSET MANAGERS ETF FUNDO DE ÍNDICE – RESPONSABILIDADE LIMITADA (“Classe”)**

Os termos e expressões utilizados neste documento em letra maiúscula, no singular ou no plural terão os mesmos significados atribuídos a eles no regulamento do **INVESTO BLUESTAR TOP 10 US LISTED ALTERNATIVE ASSET MANAGERS ETF FUNDO DE ÍNDICE** (“Regulamento” e “Fundo”, respectivamente) ou no anexo da Classe (“Anexo da Classe”).

**1. INFORMAÇÕES GERAIS E DESCRIÇÃO DO ÍNDICE**

O **BlueStar Top 10 US Listed Alternative Asset Managers Index**, lançado em 24 de agosto de 2021, é um índice de mercado criado e administrado pela **MarketVector Indexes GmbH**, fornecedora global de ferramentas e serviços para os mercados financeiros e de capitais, incluindo a administração de índices (“Índice” e “Provedora”, respectivamente). O Índice busca medir o retorno de um investimento por meio de uma carteira teórica que acompanha o desempenho das 10 (dez) maiores e mais líquidas empresas listadas nos Estados Unidos e envolvidas predominantemente na indústria de gestão de ativos alternativos.

O universo elegível do Índice é composto exclusivamente por ações ordinárias e títulos de características similares, negociados em bolsas dos Estados Unidos e denominados em dólares americanos, sendo expressamente excluídas as *Limited Partnerships* (LPs). Para inclusão, as empresas devem apresentar um *free float* mínimo de 10% (ou 5% para componentes já presentes no Índice), valor de mercado total superior a 150 milhões de dólares (ou 75 milhões de dólares para componentes atuais), além de atender a critérios rigorosos de liquidez, como volume médio diário negociado de pelo menos 1 milhão de dólares nos últimos três meses (ou 0,2 milhão de dólares para componentes atuais), e negociação de pelo menos 0,25 milhão de ações por mês no mesmo período.

A composição do Índice é restrita a 10 componentes, selecionados com base no maior valor de mercado ajustado pelo *free float*, sendo aplicados critérios para evitar múltiplas empresas de um mesmo grupo econômico.

**2. ESQUEMA DE PONDERAÇÃO**

O Índice utiliza uma ponderação baseada na capitalização de mercado ajustada ao *free float*, limitada a 15% por componente. Caso algum ativo ultrapasse esse limite, o excedente é redistribuído igualmente entre os demais componentes que ainda não atingiram o máximo.

Esse processo se repete até que todos os pesos estejam dentro do limite e totalizem 100%. O objetivo é evitar concentração excessiva e garantir diversificação. Assim, o Índice reflete de forma equilibrada o desempenho das principais empresas do setor.

### 3. PROCEDIMENTO DE SELEÇÃO

No processo de revisão do Índice, inicialmente são identificados grupos de entidades relacionadas (como subsidiárias, ex-spin-offs ou joint ventures) dentro do universo elegível. Para cada grupo sem componente atual no índice, apenas o maior valor de mercado ajustado ao *free float* permanece elegível; se já houver um componente, ele é mantido, exceto se outro do grupo tiver capitalização ajustada ao *free float* pelo menos 25% maior, caso em que este substitui o anterior.

Em seguida, os ativos restantes são ordenados por capitalização de mercado ajustada ao *free float*, em ordem decrescente. Na primeira seleção, os 10 primeiros são incluídos; nas revisões seguintes, os 8 primeiros entram automaticamente e os demais são escolhidos entre os atuais componentes que estejam entre as posições 9 e 15. Se ainda faltar completar 10 componentes, os próximos mais bem classificados são incluídos até atingir o total.

### 4. REVISÃO DO ÍNDICE

O Índice é revisado e rebalanceado semestralmente, nos meses de março e setembro, com revisões adicionais em junho e dezembro para atualização de fatores de *free float* e número de ações, garantindo que continue refletindo fielmente o desempenho das principais empresas norte-americanas do setor de gestão de ativos alternativos que atendam aos critérios de elegibilidade e liquidez estabelecidos.

### 5. CÁLCULO E DIVULGAÇÃO

O Índice é calculado nos dias úteis entre 01:00 e 22:40 (CET), e os valores do Índice são divulgados para fornecedores de dados a cada 15 (quinze) segundos nos dias em que o mercado de ações dos Estados Unidos da América estiver aberto para negociação. O Índice é divulgado e calculado em dólares americanos (USD).

### 6. DEMAIS INFORMAÇÕES

O presente material representa um resumo das principais informações contidas no “*Index Guide*” da Provedora. Para mais informações, vide o **Anexo I**. Todas as informações sobre o Índice aqui dispostas foram obtidas junto à Provedora e podem ser encontradas na Página do Fundo na rede mundial de computadores (<https://investoetf.com/PEVC11/>), bem como nos materiais de divulgação do Fundo e/ou da Classe. O Fundo, a Classe, o Administrador, o Gestor e qualquer outro prestador de serviços que atue em benefício do Fundo ou da Classe, bem como suas coligadas, não se responsabilizam por eventuais incorreções nas informações sobre o Índice ou no cálculo do Índice, ou ainda, por incorreções no cálculo do Índice.

\* \* \*

