Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada

(CNPJ nº 61.736.225/0001-03)
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
Demonstrações financeiras em
31 de março de 2026
e relatório do auditor independente

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Relatório do auditor independente sobre as demonstrações financeiras

Aos Cotistas e ao Administrador
Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)

Opinião

Examinamos as demonstrações financeiras da Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada ("Classe"), que compreendem o demonstrativo da composição e diversificação da carteira em 31 de março de 2026 e a demonstração da evolução do patrimônio líquido para o período de 8 de outubro de 2025 (início das atividades) a 31 de março de 2026, bem como as correspondentes notas explicativas, incluindo as políticas contábeis materiais e outras informações elucidativas.

Em nossa opinião, as demonstrações financeiras acima referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira da Classe em 31 de março de 2026 e o desempenho de suas operações para o período de 8 de outubro de 2025 (início das atividades) a 31 de março de 2026, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de índice.

Base para opinião

Nossa auditoria foi conduzida de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria. Nossas responsabilidades, em conformidade com tais normas, estão descritas na seção intitulada "Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações financeiras". Somos independentes em relação à Classe, de acordo com os princípios éticos relevantes previstos no Código de Ética Profissional do Contador e nas normas profissionais emitidas pelo Conselho Federal de Contabilidade, aplicáveis a auditorias de demonstrações financeiras de entidades de interesse público no Brasil, e cumprimos com as demais responsabilidades éticas conforme essas normas. Acreditamos que a evidência de auditoria obtida é suficiente e apropriada para fundamentar nossa opinião.

Pricewaterhousecoopers Auditores Independentes Ltda.,
Avenida Brigadeiro Faria Lima, 3732, 16º andar, partes 1 a 6, Edifício Adalmiro Dellape Baptista B32, Itaim Bibi, São Paulo - SP, CEP 04538-132
T: +55 (11) 4004-8000

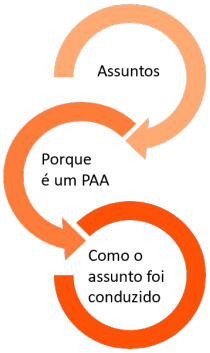
www.pwc.com.br

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)

Principais Assuntos de Auditoria

Principais Assuntos de Auditoria (PAA) são aqueles que, em nosso julgamento profissional, foram os mais significativos em nossa auditoria do período corrente. Esses assuntos foram tratados no contexto de nossa auditoria das demonstrações financeiras como um todo e na formação de nossa opinião sobre essas demonstrações financeiras e, portanto, não expressamos uma opinião separada sobre esses assuntos.



Porque é um PAA	Como o assunto foi conduzido em nossa auditoria
Mensuração e existência das aplicações	
Conforme apresentado no Demonstrativo da Composição e Diversificação da Carteira, as aplicações da Classe são compostas, substancialmente, por títulos de renda fixa, classificados na categoria para negociação. A mensuração dos títulos de renda fixa, classificados para negociação, é obtida por meio de cotação de preços divulgados no mercado. A existência dos títulos de renda fixa e são asseguradas por meio de registros junto aos órgãos custodiantes – Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC) e B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão. Considerando a relevância dessas aplicações em relação ao patrimônio líquido da Classe e à consequente apuração do valor da cota, a mensuração e existência dessas aplicações foram consideradas áreas de foco em nossa auditoria.	Nossos principais procedimentos de auditoria consideraram, entre outros: Em relação aos títulos de renda fixa classificados na categoria para negociação, comparamos os valores utilizados para a mensuração desses investimentos com os preços divulgados no mercado. Efetuamos testes quanto à existência dessas aplicações em títulos de renda fixa por meio do confronto das informações constantes na composição e diversificação da carteira da Classe com as informações do órgão custodiante. Consideramos que os critérios e as premissas adotadas pela Administração quanto a mensuração e existência dessas aplicações são consistentes com as informações analisadas em nossa auditoria.

Responsabilidades da administração e da governança pelas demonstrações financeiras

A administração da Classe é responsável pela elaboração e adequada apresentação das demonstrações financeiras de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de índice e pelos controles internos que ela determinou como necessários para permitir a elaboração de demonstrações financeiras livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro.

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Na elaboração das demonstrações financeiras, a administração é responsável pela avaliação da capacidade da Classe continuar operando, divulgando, quando aplicável, os assuntos relacionados com a sua continuidade operacional e o uso dessa base contábil na elaboração das demonstrações financeiras. A continuidade das operações de uma classe de investimento é, adicionalmente, dependente da prerrogativa dos cotistas em resgatar suas cotas nos termos do regulamento da Classe.

Os responsáveis pela governança da Classe são aqueles com responsabilidade pela supervisão do processo de elaboração das demonstrações financeiras.

Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações financeiras

Nossos objetivos são obter segurança razoável de que as demonstrações financeiras, tomadas em conjunto, estão livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro, e emitir relatório de auditoria contendo nossa opinião. Segurança razoável é um alto nível de segurança, mas não uma garantia de que a auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria sempre detectam as eventuais distorções relevantes existentes. As distorções podem ser decorrentes de fraude ou erro e são consideradas relevantes quando, individualmente ou em conjunto, possam influenciar, dentro de uma perspectiva razoável, as decisões econômicas dos usuários tomadas com base nas referidas demonstrações financeiras.

Como parte de uma auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria, exercemos julgamento profissional e mantemos ceticismo profissional ao longo da auditoria. Além disso:

- Identificamos e avaliamos os riscos de distorção relevante nas demonstrações financeiras, independentemente se causada por fraude ou erro, planejamos e executamos procedimentos de auditoria em resposta a tais riscos, bem como obtemos evidência de auditoria apropriada e suficiente para fundamentar nossa opinião. O risco de não detecção de distorção relevante resultante de fraude é maior do que o proveniente de erro, já que a fraude pode envolver o ato de burlar os controles internos, conluio, falsificação, omissão ou representações falsas intencionais.

- Obtemos entendimento dos controles internos relevantes para a auditoria para planejarmos procedimentos de auditoria apropriados às circunstâncias, mas, não, com o objetivo de expressarmos opinião sobre a eficácia dos controles internos da Classe.

- Avaliamos a adequação das políticas contábeis utilizadas e a razoabilidade das estimativas contábeis e respectivas divulgações feitas pela administração.

- Concluímos sobre a adequação do uso, pela administração, da base contábil de continuidade operacional e, com base nas evidências de auditoria obtidas, se existe incerteza relevante em relação a eventos ou condições que possam levantar dúvida significativa em relação à capacidade de continuidade operacional da Classe. Se concluirmos que existe incerteza relevante, devemos chamar atenção em nosso relatório de auditoria para as respectivas divulgações nas demonstrações financeiras ou incluir modificação em nossa opinião, se as divulgações forem inadequadas. Nossas conclusões estão fundamentadas nas evidências de auditoria obtidas até a data de nosso relatório.

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Todavia, eventos ou condições futuras podem levar a Classe a não mais se manter em continuidade operacional.

- Avaliamos a apresentação geral, a estrutura e o conteúdo das demonstrações financeiras, inclusive as divulgações, e se essas demonstrações financeiras representam as correspondentes transações e os eventos de maneira compatível com o objetivo de apresentação adequada.

Comunicamo-nos com os responsáveis pela governança a respeito, entre outros aspectos, do alcance e da época dos trabalhos de auditoria planejados e das constatações significativas de auditoria, inclusive as deficiências significativas nos controles internos que, eventualmente, tenham sido identificadas durante nossos trabalhos.

Fornecemos também aos responsáveis pela governança declaração de que cumprimos com as exigências éticas relevantes, incluindo os requisitos aplicáveis de independência, e comunicamos todos os eventuais relacionamentos ou assuntos que poderiam afetar, consideravelmente, nossa independência, incluindo, quando aplicável, as respectivas salvaguardas.

Dos assuntos que foram objeto de comunicação com os responsáveis pela governança, determinamos aqueles que foram considerados como mais significativos na auditoria das demonstrações financeiras do período corrente e que, dessa maneira, constituem os Principais Assuntos de Auditoria. Descrevemos esses assuntos em nosso relatório de auditoria, a menos que lei ou regulamento tenha proibido divulgação pública do assunto, ou quando, em circunstâncias extremamente raras, determinarmos que o assunto não deve ser comunicado em nosso relatório porque as consequências adversas de tal comunicação podem, dentro de uma perspectiva razoável, superar os benefícios da comunicação para o interesse público.

São Paulo, 26 de maio de 2026

PricewaterhouseCoopers

PricewaterhouseCoopers
Auditores Independentes Ltda.
CRC 2SP000160/O-5

DocuSigned by
Wilian Shigueaki Tatebe
Assinado por: WILIAN SHIGUEAKI TATEBE:21858637899
CPF: 21858637899
Data/Hora da Assinatura: 26 May 2026 | 20:25 BRT
O: ICP-Brasil, OU: Secretaria da Receita Federal do Brasil - RFB
C: BR
Emissor: AC SERASA RFB v5
426B6ODBDFAE45F...

Wilian Shigueaki Tatebe
Contador CRC 1SP253071/O-3

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada

CNPJ: 61.736.225/0001-03
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
CNPJ: 01.522.368/0001-82

Demonstrativo da composição e diversificação da carteira

Em 31 de março de 2026

(Em milhares de Reais)

Aplicações - Especificações	Quantidade	Mercado / realização	% sobre o patrimônio líquido
Disponibilidades		3	0,01
Títulos públicos		447	0,90
Letras Financeiras do Tesouro - LFT	24	447	0,90
Debêntures		48.941	98,82
TIM Brasil Serviços e Participações S.A.	6.121	6.330	12,78
Nova Transportadora do Sudeste S.A.	1.442	1.502	3,04
Aegea Saneamento e Participações S.A.	1.517	1.499	3,04
Localiza Rent a Car S.A.	1.423	1.489	3,03
Cosan S.A. Indústria e Comércio	1.473	1.450	2,94
Rede D'Or São Luiz S.A.	1.318	1.323	2,59
Energisa S.A.	1.290	1.289	2,61
Companhia de Saneamento Básico do Estado de São Paulo	1.214	1.265	2,57
Cemig Distribuição S.A.	1.254	1.265	2,56
Celg Distribuição S.A.	1.176	1.235	2,50
Vibra Energia S.A.	1.144	1.230	2,49
ISA Energia Brasil S.A.	1.044	1.067	2,17
PRIO Forte S.A.	1.006	1.037	2,11
Multiplan Empreendimentos Imobiliários S.A.	913	975	1,98
Companhia Hidrelétrica do São Francisco	967	975	1,98
BR Malls Participações S.A.	865	884	1,79
Suzano S.A.	798	851	1,72
CESP – Companhia Energética de São Paulo	831	834	1,68
Grua Investimentos S.A.	750	782	1,58
Hapvida Participações e Investimentos S.A.	984	771	1,56
Votorantim Cimentos S.A.	711	757	1,53
Engie Brasil Energia S.A.	703	748	1,51
B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão	738	742	1,50
Concessionária do Sistema Anhanguera-Bandeirantes S.A.	710	724	1,46
Localiza Fleet S.A.	668	703	1,42
Diagnósticos da América S.A.	670	682	1,38
Companhia Estadual de Distribuição de Energia Elétrica	649	681	1,28
Centrais Elétricas do Norte do Brasil S.A.	655	658	1,33
Eurofarma Laboratórios S.A.	647	649	1,31
Sendas Distribuidora S.A.	648	620	1,25
EcoRodovias Concessões e Serviços S.A.	597	618	1,25
Brava Energia S.A.	584	605	1,22
Equatorial Distribuição de Energia S.A.	574	570	1,15
Copel Geração e Transmissão S.A.	560	569	1,15
Compass Gás e Energia S.A.	505	529	1,07
Armac Locação, Logística e Serviços S.A.	559	523	1,06
Auren Energia S.A.	484	510	1,03
Cielo S.A.	471	498	1,01
Vamos Locação de Caminhões, Máquinas e Equipamentos S.A.	455	480	0,97
Mantiqueira Holding S.A.	451	479	0,97
BRK Ambiental Participações S.A.	446	473	0,95
Parsan S.A.	415	424	0,86
Motiva Infraestrutura de Mobilidade S.A.	408	422	0,85
Usinas Siderúrgicas de Minas Gerais S.A. – Usiminas	419	418	0,84

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada

CNPJ: 61.736.225/0001-03
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
CNPJ: 01.522.368/0001-82

Demonstrativo da composição e diversificação da carteira

Em 31 de março de 2026

(Em milhares de Reais)

Rodovias das Colinas S.A.	392	401	0,81
União Química Farmacêutica Nacional S.A.	394	401	0,81
Companhia Riograndense de Saneamento	370	397	0,80
Transportadora Associada de Gás S.A.	334	378	0,76
Simpar S.A.	387	375	0,76
Iguá Sergipe S.A.	285	351	0,71
Iochpe-Maxion S.A.	339	349	0,70
ContourGlobal Brasil Participações S.A.	366	344	0,69
RGE Sul Distribuidora de Energia S.A.	334	337	0,68
Arteris S.A.	296	322	0,65
Algar Telecom S.A.	296	308	0,62
Tupy S.A.	296	303	0,61
Ouro Verde Locação e Serviço S.A.	278	295	0,60
Banco BTG Pactual S.A.	276	290	0,59
Vix Logística S.A.	265	281	0,57
TOTVS S.A.	267	277	0,56
Equatorial Energia S.A.	247	249	0,50
Rodovias do Brasil Holding S.A.	151	235	0,48
Aura Almas Mineração S.A.	203	223	0,45
JSL S.A.	195	208	0,42
Inspirali Educação S.A.	187	199	0,40
Camil Alimentos S.A.	157	168	0,34
Centrais Elétricas Brasileiras S.A. – Eletrobras	110	119	0,24
Cotas de fundos de investimento		135	0,27
BNP Paribas Soberano II Classe de Investimento em Cotas de Classe de Investimento Renda Fixa Simples - Responsabilidade Limitada (*)	808	135	0,27
Valores a receber		25	0,05
Valores a pagar		(25)	(0,05)
Patrimônio líquido		49.526	100,00

(*) Fundo administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.

As notas explicativas são parte integrante das demonstrações financeiras

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada

CNPJ: 61.736.225/0001-03

(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)

CNPJ: 01.522.368/0001-82

Demonstração da evolução do patrimônio líquido

Período de 8 de outubro de 2025 (início das atividades) a 31 de março de 2026

(Em milhares de reais, exceto o valor unitário das cotas)

	Período de 8 de outubro de 2025 (início das atividades) a 31 de março de 2026
Patrimônio líquido no início do período	
Total de 3.350.000,000 cotas a R$ 10,000000 cada uma	33.500
Cotas emitidas no período	
1.350.000,000 cotas	13.816
Patrimônio líquido antes do resultado do período	47.316
Composição do resultado do período	
Cotas de fundos	40
Rendas de aplicações em cotas de fundos de investimento	40
Renda fixa e outros títulos e valores mobiliários	2.288
Apropriação de rendimentos	(504)
Resultado nas negociações	(8)
Valorização a preço de mercado	2.800
Demais despesas	(118)
Remuneração do administrador	(101)
Auditoria e custódia	(12)
Taxa de fiscalização	(1)
Despesas diversas	(4)
Total do resultado do período	2.210
Patrimônio líquido no final do período	
Total de 4.700.000,000 cotas a R$ 10,537529 cada uma	49.526

As notas explicativas são parte integrante das demonstrações financeiras.

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada

CNPJ nº 61.736.225/0001-03
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
(CNPJ nº 01.522.368/0001-82)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Período de 8 de outubro de 2025 (início das atividades) a 31 de março de 2026
(Em milhares de Reais, exceto o valor unitário das cotas)

1 Contexto operacional

O Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada ("Classe") foi constituído em 14 de julho de 2025 e iniciou suas atividades em 8 de outubro de 2025, sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração, e é destinado a investidores em geral. Seu objetivo visa refletir as variações e rentabilidade do índice Teva Debêntures DI Quality High Beta ("Índice"). O índice Teva Debêntures DI Quality High Beta ("Índice") é calculado pela Teva Índices ("Provedora do Índice"), que tem por objetivo refletir o desempenho de uma carteira teórica composta por debêntures com remuneração atrelada ao DI acrescido de spread, bem como por Letras Financeiras do Tesouro (LFTs) disponíveis para negociação, que atendam a critérios adequados de liquidez, conforme estabelecido na metodologia do Índice. A carteira permite exposição às debêntures indexadas ao DI de maior duration de forma diversificada e com rebalanceamentos mensais, compatíveis com a agilidade desse mercado. Os critérios de elegibilidade e ponderação permitem uma replicabilidade adequada do índice pelo fundo de índice e minimizam custos de turnover (giro da carteira). Sua estratégia é investir no mínimo 95% de seu patrimônio líquido, em ativos financeiros que compõem o índice de referência, posição líquida em contratos futuros e cotas de outros fundos de índice que visem refletir as variações e rentabilidade do índice de referência da classe investidora e poderá ter, no máximo, 5% do seu valor representado por investimentos permitidos e/ou valores em moeda corrente nacional.

Não obstante a diligência e os cuidados a serem empregados pelos Prestadores de Serviços na implantação da política de investimento descrita nos respectivos Anexos das Classes, os investimentos das Classes, bem como das classes de fundos por elas investidas, por sua própria natureza, estão sujeitos a variações de mercado, a riscos inerentes aos emissores dos ativos financeiros e a riscos de crédito de forma geral. Portanto, não poderão os Prestadores de Serviços ser responsabilizados por qualquer depreciação dos ativos que comporão a carteira ou por eventuais prejuízos impostos ou gerados aos Cotistas.

O investimento em uma Classe e/ou Subclasse deste Fundo não é garantido pelo FGC – Fundo Garantidor de Crédito. O investimento em uma Classe e/ou Subclasse deste Fundo não é garantido, de forma alguma, pelo Administrador, Gestor, ou qualquer outro Prestador de Serviços. O investimento em uma Classe e/ou Subclasse deste Fundo não conta com qualquer tipo de cobertura de seguro.

A responsabilidade dos cotistas da Classe é limitada ao valor por eles subscrito. Desta forma, os cotistas não poderão ser demandados a arcar com quaisquer obrigações assumidas pela Classe em valor superior ao valor por eles subscrito para reverter o patrimônio líquido negativo da Classe. Constatado o patrimônio líquido negativo e percorrido o processo previsto na regulamentação vigente, o Administrador da Classe deverá, obrigatoriamente, submeter para deliberação pelos cotistas a decisão sobre o ingresso do pedido de declaração de insolvência da Classe, observando ainda o disposto na Resolução.

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice - Responsabilidade Limitada

CNPJ nº 61.736.225/0001-03
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
(CNPJ nº 01.522.368/0001-82)

Notas explicativas às demonstrações financeiras

Período de 8 de outubro de 2025 (início das atividades) a 31 de março de 2026
(Em milhares de Reais, exceto o valor unitário das cotas)

2 Apresentação e elaboração das demonstrações financeiras

As demonstrações financeiras foram preparadas de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de índice, complementadas pelas normas previstas no Plano Contábil dos Fundos de Investimento (COFI) e pelas orientações emanadas da Comissão de Valores Mobiliários.

Na elaboração dessas demonstrações financeiras foram utilizadas premissas e estimativas de preços para a contabilização e determinação dos valores dos ativos e instrumentos financeiros integrantes da carteira da Classe. Desta forma, quando da efetiva liquidação financeira desses ativos e instrumentos financeiros, os resultados auferidos poderão ser diferentes dos estimados.

As demonstrações financeiras em 31 de março de 2026 foram aprovadas pelo Administrador em 26 de maio de 2026.

3 Descrição das principais práticas contábeis

Entre as principais práticas contábeis adotadas destacam-se:

a. Receitas e despesas

As receitas e despesas são reconhecidas de acordo com o regime de competência.

b. Cotas de fundos de investimento

As cotas de fundo de investimento são atualizadas, diariamente, com base no valor da cota divulgado pelas Instituições Financeiras custodiantes dos fundos onde os recursos são aplicados. Na hipótese de não divulgação das cotas, são utilizadas as cotas do dia imediatamente anterior. As receitas e despesas decorrentes são registradas em “Rendas de aplicações em cotas de fundos de investimento”.

c. Títulos públicos / Títulos privados

Os títulos públicos e privados integrantes da carteira são contabilizados pelo custo de aquisição, acrescido diariamente dos rendimentos incorridos (curva) até a data do balanço, e ajustados ao valor justo, quando aplicável, em função da classificação dos títulos. São reconhecidos como resultado e registrados na rubrica “Renda fixa e outros títulos e valores mobiliários”.

4 Investimento em fundos

As aplicações em fundos são representadas por fundos administrados pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

5 Títulos e valores mobiliários

De acordo com o estabelecido pela Instrução CVM nº 577, de 7 de julho de 2016, os títulos e valores mobiliários são classificados em duas categorias específicas de acordo com a intenção de negociação, atendendo aos seguintes critérios para contabilização:

i. **Títulos para negociação** - Incluem os títulos e valores mobiliários adquiridos com o objetivo de serem negociados frequentemente e de forma ativa, sendo contabilizados pelo valor justo, em que as perdas e os ganhos realizados e não realizados sobre esses títulos são reconhecidos no resultado;

ii. **Títulos mantidos até o vencimento** - Incluem os títulos e valores mobiliários, exceto ações não resgatáveis, para os quais haja a intenção e a capacidade financeira para mantê-los até o vencimento, sendo contabilizados ao custo de aquisição, acrescidos dos rendimentos intrínsecos, desde que observadas as seguintes condições:

- Que a Classe seja destinada exclusivamente a um único investidor, a investidores pertencentes ao mesmo conglomerado ou grupo econômico-financeiro ou a investidores qualificados, esses últimos definidos como tal pela regulamentação editada pela CVM relativamente aos fundos de investimento em títulos e valores mobiliários;

- Que todos os cotistas declarem formalmente, por meio de um termo de adesão ao regulamento da Classe, a sua anuência à classificação de títulos e valores mobiliários integrantes da carteira da Classe.

Caso a Classe de investimento invista em cotas de outro fundo de investimento, que classifique os títulos e valores mobiliários da sua carteira na categoria de títulos mantidos até o vencimento, é necessário que sejam atendidas, pelos cotistas do fundo investidor, as mesmas condições acima mencionadas.

a. Composição da carteira

Os títulos e valores mobiliários integrantes da carteira e suas respectivas faixas de vencimento estão assim classificados:

Títulos para negociação	**Valor Curva**	**Valor Justo**
Títulos públicos federais - Acima de 1 ano		
Letras Financeiras do Tesouro - LFT	446	447
Títulos privados - Acima de 1 ano		
Debêntures	48.721	48.941
Total	**49.167**	**49.388**

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

b. Valor justo

Os critérios utilizados para apuração do valor justo são os seguintes:

- **Títulos públicos -** Para os títulos públicos federais são utilizados os preços unitários divulgados pela Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais (ANBIMA) para a data de avaliação. No caso de aproximação de vencimento do papel em que não há divulgação de taxas da ANBIMA, é utilizada a taxa indicativa do papel de vencimento mais próximo para a data de avaliação, ou agentes de mercado, quando necessário;

- **Debêntures -** Para as debêntures com informações divulgadas pela ANBIMA, são utilizadas as taxas indicativas divulgadas diariamente por essa instituição na data de avaliação. Para as debêntures que não possuírem informações divulgadas pela ANBIMA, o Comitê de Crédito estabelece as taxas de marcação a mercado de forma a refletirem análises de *rating*, prazo, liquidez e eventuais ofertas de compra feitas por instituições financeiras;

6 Gerenciamento de riscos

O administrador e a gestora possuem Comitês de Risco por meio dos quais é definida uma carteira-modelo para os objetivos de performance, política de investimento e política de administração de risco da Classe, conforme segue:

Risco de Mercado - o valor dos ativos que integram a carteira pode variar em função de oscilações nas taxas de juros, taxas de câmbio, preços e cotações de mercado, bem como em razão de quaisquer alterações nas condições econômicas e/ou políticas, nacionais e internacionais. Tais fatos podem afetar negativamente os preços dos ativos integrantes da carteira, resultando, inclusive, na depreciação do valor da cota da Classe, com perdas patrimoniais aos cotistas;

Risco de Crédito - o inadimplemento ou atraso no pagamento de juros ou principal pelos emissores dos ativos integrantes da carteira ou pelas contrapartes das operações da Classe, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial de tais emissores e/ou contrapartes, pode ocasionar a redução de ganhos ou mesmo perdas financeiras à Classe e aos seus cotistas. Adicionalmente, pode haver custos adicionais nas hipóteses em que a Classe tente recuperar seus créditos por meio de ações judiciais, acordos extrajudiciais ou outros. A Classe está sujeita a risco de perda substancial de seu patrimônio líquido nos casos dos eventos ora indicados;

Risco de liquidez - a possibilidade de redução ou mesmo inexistência de demanda pelos ativos e modalidades operacionais integrantes da carteira podem fazer com que a Classe não esteja apta a realizar pagamentos de resgate de suas cotas conforme previsto em seus respectivos regulamentos, inclusive em decorrência de dificuldades para liquidar posições ou negociar tais ativos pelo preço e no tempo desejados;

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Risco de derivativos - a utilização de instrumentos de derivativos pela Classe, tanto para proteção quanto para alavancagem, arbitragem e/ou posicionamento em estratégias, pode aumentar a volatilidade da Classe, limitar as possibilidades de retorno nas suas operações, não produzir os efeitos desejados e/ou provocar significativas perdas patrimoniais à Classe, bem como perdas superiores ao capital aplicado pelos cotistas, o que resultará na obrigatoriedade de aporte de recursos adicionais pelos cotistas no caso de patrimônio líquido negativo, para cobrir os prejuízos da Classe, em valor proporcional ao número de cotas por eles detidas, mediante solicitação do Administrador;

Risco para ativos registrados na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão - a guarda da documentação física original representativa dos ativos financeiros e eventuais garantias a eles vinculadas é de responsabilidade do participante registrador do ativo financeiro na B3, o que pode limitar o acesso da Classe à referida documentação, podendo dificultar ou retardar eventuais procedimentos de cobrança decorrentes de inadimplência no pagamento dos referidos ativos financeiros por seus respectivos devedores, podendo acarretar em perdas à Classe, e consequentemente, aos seus cotistas. Adicionalmente, eventos que fogem ao controle do Administrador, do Custodiante ou do participante registrador na B3, tais como, mas não se limitando a incêndio, inundação ou outros eventos de força maior, poderão causar a perda dos documentos originais e consequentemente gerar perdas à Classe e aos seus cotistas; e

Riscos gerais - eventual interferência de órgãos reguladores no mercado, mudanças na legislação e regulamentação aplicáveis aos fundos de investimento, decretação de moratória, fechamento parcial ou total dos mercados, alteração nas políticas monetária e cambial, dentre outros eventos, podem impactar as condições de funcionamento da Classe, bem como seu respectivo desempenho.

Política de administração de risco

- Além do controle de posição, o risco é controlado por meio de tracking error na carteira da Classe visando manter o máximo de aderência ao Índice da Classe (Benchmark previsto). Não há limites de VaR e stress para este tipo de Classe.

- Definir parâmetros para avaliar se as perdas estimadas estão de acordo com o perfil da Classe, se agressivo ou conservador.

A política de administração de risco da Classe compreende ainda: (i) discussão, definição e verificação do cumprimento das estratégias de investimento; (ii) monitoramento do desempenho da Classe e (iii) verificação do cumprimento das normas e restrições aplicáveis à administração e gestão da Classe.

Análise de sensibilidade

Em 31 de março de 2026, a análise de sensibilidade foi efetuada a partir do cenário elaborado abaixo:

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Patrimônio Líquido:	49.526
VaR % PL:	0,710309%
VaR Financeiro:	352

A mensuração dos riscos de mercado tem por objetivo a avaliação das perdas possíveis com as variações de preços e taxas de mercado. O método Value at Risk – VaR, representa a perda máxima esperada para 21 dias considerando intervalo de 95% de confiança. Essa metodologia assume que os retornos dos ativos são relacionados linearmente com os retornos dos fatores de riscos e que os fatores de riscos são aproximadamente normalmente distribuídos. Essas aproximações podem subestimar as perdas futuras decorrentes do aumento futuro da volatilidade dos ativos pois representam as condições atuais de mercado.

7 Emissões, resgates e amortização de cotas

Para fins de integralização e resgate de cotas, a administradora utiliza o valor patrimonial das cotas apurado no encerramento do dia de pregão em que a respectiva solicitação foi processada. As operações de integralização e de resgate são liquidadas no prazo estipulado para liquidação de operações na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

As cotas são emitidas e resgatadas somente em lotes mínimos de cotas ou em múltiplos de lotes mínimos de cotas. Os lotes mínimos de cotas somente poderão ser resgatados e entregues mediante uma ordem de resgate devidamente submetida por um agente autorizado e mediante a concomitante entrega de uma cesta ao respectivo agente autorizado pela Classe.

A Cesta corresponde a lotes mínimos de cotas composta de ativos do índice, investimentos permitidos, valores em dinheiro ou direitos sobre ações. A composição da cesta, seja para fins de uma Ordem de Integralização ou de uma ordem de resgate, obedecerá às seguintes regras:

(i) poderá ter, no máximo, 5% (cinco por cento) do seu valor representado por investimentos permitidos e/ou valores em contratos derivativos.

(ii) poderá ter, no máximo, 20% (vinte por cento) do montante envolvido na operação, contemplando ativos financeiros que não façam parte do Índice, mas que sejam de mesma natureza destes, porém de diferentes emissões; e

(iii) o restante será representado por Ativos do Índice.

Em situações excepcionais de dificuldade na execução de ordens de integralização ou ordens de resgate, devida à baixa liquidez de uma ou mais ações do índice que componham a cesta, a Gestora, a seu exclusivo critério, pode substituir tais ações do índice por valores em dinheiro, limitados a 5% (cinco por cento) do valor total da cesta.

As amortizações poderão ser feitas tão somente a critério do Administrador, conforme instruções da Gestora. Considera-se amortização o pagamento em moeda corrente nacional, de forma proporcional a todos os cotistas, de parcela do valor patrimonial de suas respectivas cotas, sem redução no número de cotas. O administrador pode efetuar uma amortização trimestral de

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

cotas nos termos previstos no regulamento, somente se a performance da Classe se mostrar superior à performance do índice durante o trimestre precedente.

8 Negociação de cotas

As cotas da Classe são listadas para negociação na B3, com o código GICP11, e poderão ser adquiridas ou vendidas por qualquer corretora. O administrador, a gestora, suas respectivas coligadas, bem como seus respectivos diretores e funcionários, poderão adquirir e negociar as cotas a qualquer tempo. Não obstante o disposto no regulamento em nome da Classe, formador de mercado para as cotas da Classe, as cotas poderão ser negociadas pelo administrador e pessoas a ela ligadas sob as mesmas condições dos outros cotistas da Classe.

9 Remuneração do administrador

Pela prestação dos serviços de administração da Classe, que incluem a gestão da carteira, as atividades de tesouraria e de controle e processamento dos títulos e valores mobiliários, a distribuição de cotas e a escrituração da emissão e resgate de cotas, a Classe paga a taxa global de 0,50% ao ano, calculada diariamente, por dia útil, sobre o patrimônio líquido da Classe. A taxa global é calculada e provisionada diariamente, por dia útil, sendo paga mensalmente até o 5º dia útil do mês subsequente.

As classes de fundos de investimento em que a Classe investe estão sujeitas a taxa de administração e gestão próprias. A efetiva Taxa Global da Subclasse pode variar até o valor da Taxa Máxima Global, que compreende também as taxas cobradas por classes de fundos de investimento investidas pela Classe em relação as quais a regulamentação em vigor exige consolidação, conforme abaixo indicadas:

Taxa Máxima Global: 0,51% (cinquenta e um centésimos por cento) ao ano (base 252 dias)
Base de cálculo: patrimônio líquido investido pela Classe.

No período de 8 de outubro de 2025 a 31 de março de 2026, a despesa com taxa global foi de R$ 101, e foi registrada em “Remuneração do administrador”.

Não serão cobradas taxa de *performance*, de saída ou de ingresso.

10 Serviços de gestão e custódia e controladoria

A gestão da carteira da Classe é realizada pela Plural Gestão de Recursos Ltda.

A gestora fará jus a uma parcela da taxa global, a ser paga diretamente pela Classe à gestora.

Os títulos públicos estão registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC) do Banco Central do Brasil, os títulos privados estão registradas na B3 S.A. - Brasil e as cotas de fundo de investimento administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A. são custodiadas pela própria instituição financeira.

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

Os serviços de controladoria, tesouraria e custódia dos títulos e valores mobiliários e demais ativos financeiros da Classe, escrituração da emissão e resgate de cotas da Classe são realizados pelo próprio administrador, os serviços de distribuição da Classe são contratados pelo administrador e agentes autorizados.

A taxa máxima de custódia a ser cobrada é de 0,03% ao ano, calculada e provisionada diariamente, por dia útil, sobre o valor do patrimônio líquido da Classe. No período de 8 de outubro de 2025 a 31 de março de 2026 a despesa de custódia foi de R$ 4, e foi registrada em "Auditoria e custódia".

11 Informações sobre transações com partes relacionadas

No período findo em 31 de março de 2026, a Classe realizou as seguintes operações com partes relacionadas:

	Contraparte	Natureza	R$ mil
Disponibilidade	Banco BNP Paribas Brasil S.A.	Administrador	3

	Contraparte	Natureza	R$ mil
Despesa de Taxa de Gestão	Plural Gestão de Recursos Ltda.	Gestora	(71)
Despesa de Taxa de Administração	Banco BNP Paribas Brasil S.A.	Administrador	(30)
Despesa de Taxa de Custodia	Banco BNP Paribas Brasil S.A.	Administrador	(4)

12 Legislação tributária

a. Classe

Os rendimentos e ganhos auferidos com operações realizadas pela carteira da Classe não estão sujeitos ao imposto de renda nem ao IOF.

b. Cotista

Imposto de renda - De acordo com a legislação em vigor, os rendimentos estão sujeitos ao imposto de renda, à alíquota de 15% sobre o ganho líquido (diferença positiva entre o preço de venda e o respectivo custo de aquisição) auferido na venda de cotas da Classe no mercado à vista da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão, entrando no cômputo da apuração mensal dos ganhos líquidos de renda variável decorrentes de todas as operações efetuadas no mês, nas bolsas de valores, de mercadorias, de futuros e assemelhadas. O imposto de renda sobre os ganhos líquidos mensais deve ser apurado e pago pelo próprio cotista até o último dia útil do mês subsequente ao de sua apuração. A tributação é definitiva, não sendo tais ganhos incluídos no cômputo do imposto de renda sobre rendimentos sujeitos ao ajuste anual da pessoa física.

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

13 Política de distribuição dos resultados

A Classe incorpora ao seu patrimônio líquido os dividendos, juros sobre capital próprio ou outros rendimentos porventura advindos de ativos e operações que integrem a carteira da Classe.

14 Política de divulgação das informações

O Administrador colocará à disposição dos interessados, na sede do Administrador, as seguintes informações:

- Diariamente, o valor da cota e do patrimônio líquido da Classe;
- Mensalmente, até 15 dias após o encerramento do mês a que se referir o balancete, demonstrativo de composição e diversificação da carteira e informações relativas ao perfil mensal;
- Anualmente, no prazo de até 60 dias contados a partir do encerramento do exercício a que se referirem as demonstrações financeiras acompanhadas do parecer do auditor independente.

Os cotistas poderão obter informações e esclarecer dúvidas a respeito da Classe da seguinte forma: (i) mediante correspondência enviada à sede do Administrador, no endereço Av. Presidente Juscelino Kubitschek, nº 1909, 9º andar, Torre Sul, Vila Nova Conceição, CEP 04543-907, São Paulo- SP, aos cuidados Client Desk; (ii) por correio eletrônico endereçado ao Administrador, no seguinte endereço: atendimentoafs@br.bnpparibas.com; ou (iii) por telefone, através do número: (11) 3841-3157 ou 3841-3168;

A Classe tem uma página eletrônica na rede mundial de computadores, no endereço https://www.genialasset.com.br/pt/strategy/etf/qicp11, com acesso disponível a partir do link específico da Classe, que contém as informações exigidas pela norma vigente.

15 Rentabilidade

A rentabilidade mensal proporcionada pela Classe e o valor nominal da cota no período foram os seguintes:

				Não auditado			
				Rentabilidade em %		Benchmark em % a.a.	
				Classe		Teva Debêntures DI Quality High Beta (**)	
Data		Patrimônio Líquido Médio - R$	Valor da Cota - R$	Mensal	Acumulada	Mensal	Acumulada
08/10/2025	(*)	-	10,000000	-	-	-	-
31/10/2025		33.610	10,044560	0,45	0,45	0,35	0,35
30/11/2025		37.410	10,163605	1,19	1,64	1,01	1,36
31/12/2025		43.922	10,268635	1,03	2,69	1,07	2,44

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

31/01/2026	44.563	10,425677	1,53	4,26	1,67	4,15
28/02/2026	47.042	10,508689	0,80	5,09	0,69	4,87
31/03/2026	49.342	10,537529	0,27	5,38	0,26	5,14

(*) Data do início das atividades da Classe.

(**) O índice Índice Teva Debêntures DI Quality High Beta, calculado pela Teva Indices.

A rentabilidade obtida no passado não representa a garantia de resultados futuros.

As rentabilidades no período foi a seguinte:

Data	Patrimônio líquido médio – R$	Rentabilidade Classe (%)	Rentabilidade Índice (%)
Período de 8 de outubro de 2025 a 31 de março de 2026	42.997	5,38	5,14

16 Demandas judiciais

Não há registro de demandas judiciais ou extrajudiciais, quer na defesa dos direitos dos cotistas, quer desses contra a administração da Classe.

17 Política de empréstimo na representação direta

Os valores mobiliários da carteira podem ser emprestadas aos cotistas para fins de voto em Assembleia Geral de Acionistas. Cada cota busca representar uma determinada quantidade de ativos integrantes da carteira da Classe, o cotista que solicitar o empréstimo de determinada valores mobiliários da carteira terá direito a tomar emprestada a quantidade de tais valores mobiliários da carteira equivalente à respectiva quantidade de valores mobiliários da carteira que o número total de cotas detidas por tal cotista represente no final do dia da solicitação de tal empréstimo. Caso a quantidade de valores mobiliários do índice que o cotista tenha direito de tomar em empréstimo seja fracionária, tal número será arredondado para o menor número inteiro mais próximo. A solicitação de empréstimo de valores mobiliários somente pode ser feita após a convocação da Assembleia Geral do respectivo emissor e deve ser comunicada a administradora por intermédio de um agente autorizado no mínimo de cinco dias e no máximo de seis dias de pregão de antecedência à realização da Assembleia Geral de Acionistas. O empréstimo é isento de taxa de aluguel sendo assim o cotista arca somente com os custos operacionais.

A Administradora pode, durante os cinco primeiros dias do período de rebalanceamento, rejeitar ou limitar empréstimos de valores mobiliários da carteira, desde que tal restrição se limite à parcela de valores mobiliários da carteira cujo empréstimo poderia, a critério do gestor, vir a causar danos significativos na capacidade da Classe de atingir seu objetivo de investimento.

Docusign Envelope ID: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618

18 Política de exercício de direito de voto

A Classe tem como política o exercício de seu direito de voto em assembleias gerais de acionistas de emissores apenas com relação a matérias consideradas de suma relevância ao emissor. A Gestora da Classe adota política de exercício de direito de voto em assembleias, que disciplina os princípios gerais, o processo decisório e quais são as matérias relevantes obrigatórias para o exercício do direito de voto. Tal política orienta as decisões da Gestora em assembleias de detentores de títulos e valores mobiliários que confiram aos seus titulares o direito de voto.

19 Alteração estatutária

Por meio do Instrumento Particular de Alteração do Regulamento da Classe datado de 24 de fevereiro de 2026, a Administradora decidiu, a partir de 2 de março de 2026, considerando o Ofício-Circular-Conjunto 01/2025/CVM/SIN/SSE fica centralizado a Ferramenta ANBIMA (Plataforma de Transparência de Taxas) como instrumento adequado a ser adotado em substituição à divulgação de taxas no website de cada gestor, promoverá as alterações necessárias no regulamento da Classe, de forma a adequá-lo à nova regulamentação.

20 Prestação de outros serviços e política de independência do auditor

O Administrador, no período, não observou a contratação de serviços prestados pela PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes Ltda., relacionados a esta Classe de Investimento por ele administrado que não os serviços de auditoria externa. A política adotada atende aos princípios que preservam a independência do auditor, de acordo com os critérios internacionalmente aceitos, qual seja o auditor não deve auditar o seu próprio trabalho, nem exercer funções gerenciais no seu cliente ou promover os interesses deste.

* * *

Maria Luiza Gregório Paiva
Diretora Responsável

Cristina Andrade Santana
CRC 1SP283337/O-9

Certificado de Conclusão

Identificação de envelope: EFEF84A5-A078-421E-98AD-7B0398D42618
Status: Concluído
Assunto: Complete with Docusign: 1095951 - Genial Teva Debêntures DI Quality High Beta Classe de Índice ...
LoS / Área: Assurance (Audit, CMAAS)
Tipo de Documento: Relatórios ou Deliverables
Envelope fonte:
Documentar páginas: 19
Certificar páginas: 2
Assinatura guiada: Ativado
Selo com EnvelopeId (ID do envelope): Ativado
Fuso horário: (UTC-03:00) Brasília

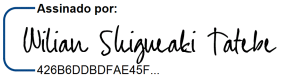
Assinaturas: 1
Rubrica: 0

Remetente do envelope:
Caio Cruz
Avenida Brigadeiro Faria Lima, 3732, 16º e 17º andares, Edifício Adalmiro Dellape Baptista B32, Itai
São Paulo, São Paulo 04538-132
caio.cruz@pwc.com
Endereço IP: 134.238.159.64

Rastreamento de registros

Status: Original
26 de maio de 2026 | 17:01
Portador: Caio Cruz
caio.cruz@pwc.com
Local: DocuSign

Status: Original
26 de maio de 2026 | 20:25
Portador: CEDOC Brasil
BR_Sao-Paulo-Arquivo-Atendimento-Team@pwc.com
Local: DocuSign

Eventos do signatário	Assinatura	Registro de hora e data
Wilian Shigueaki Tatebe wilian.shigueaki@pwc.com PwC Nível de segurança: E-mail, Autenticação da conta (Nenhuma), Certificado Digital **Detalhes do provedor de assinatura:** Tipo de assinatura: ICP-Brasil Emissor: AC SERASA RFB v5 Assunto: CN=WILIAN SHIGUEAKI TATEBE:21858637899	Assinado por:  426B6DDBDFAE45F... Adoção de assinatura: Estilo pré-selecionado Usando endereço IP: 134.238.160.200 Política de certificado: [1]Certificate Policy: Policy Identifier=2.16.76.1.2.3.10 [1,1]Policy Qualifier Info: Policy Qualifier Id=CPS Qualifier: http://publicacao.certificadodigital.com.br/repositorio/dpc/declaracao-rfb.pdf	Enviado: 26 de maio de 2026 | 17:02 Visualizado: 26 de maio de 2026 | 20:24 Assinado: 26 de maio de 2026 | 20:25

Termos de Assinatura e Registro Eletrônico:
Não oferecido através da Docusign

Eventos do signatário presencial	Assinatura	Registro de hora e data

Eventos de entrega do editor	Status	Registro de hora e data

Evento de entrega do agente	Status	Registro de hora e data

Eventos de entrega intermediários	Status	Registro de hora e data

Eventos de entrega certificados	Status	Registro de hora e data

Eventos de cópia	Status	Registro de hora e data

Eventos de cópia	Status	Registro de hora e data
Caio Cruz caio.cruz@pwc.com PwC BR Nível de segurança: E-mail, Autenticação da conta (Nenhuma) **Termos de Assinatura e Registro Eletrônico:** Não oferecido através da Docusign	**Copiado**	Enviado: 26 de maio de 2026 | 20:25 Visualizado: 26 de maio de 2026 | 20:25 Assinado: 26 de maio de 2026 | 20:25
Carlos Santos carlos.asantos@pwc.com Nível de segurança: E-mail, Autenticação da conta (Nenhuma) **Termos de Assinatura e Registro Eletrônico:** Não oferecido através da Docusign	**Copiado**	Enviado: 26 de maio de 2026 | 17:02
Leticia Lima leticia.lima@pwc.com Nível de segurança: E-mail, Autenticação da conta (Nenhuma) **Termos de Assinatura e Registro Eletrônico:** Não oferecido através da Docusign	**Copiado**	Enviado: 26 de maio de 2026 | 17:02 Visualizado: 26 de maio de 2026 | 20:33

Eventos com testemunhas	Assinatura	Registro de hora e data

Eventos do tabelião	Assinatura	Registro de hora e data

Eventos de resumo do envelope	Status	Carimbo de data/hora
Envelope enviado	Com hash/criptografado	26 de maio de 2026 | 17:02
Entrega certificada	Segurança verificada	26 de maio de 2026 | 20:24
Assinatura concluída	Segurança verificada	26 de maio de 2026 | 20:25
Concluído	Segurança verificada	26 de maio de 2026 | 20:25

Eventos de pagamento	Status	Carimbo de data/hora