



**BNP PARIBAS**

São Paulo, 26 de junho de 2023.

**TREND ETF SMALL CAPS FUNDO DE ÍNDICE**

**CNPJ/MF Nº 40.153.709/0001-41**

Código negociação B3: XMAL11

Código ISIN: BRXMALCTF002

**FATO RELEVANTE**

O **BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.**, instituição financeira privada, com sede na Cidade e Estado de São Paulo, na Avenida Presidente Juscelino Kubitschek, nº 1.909, 9º, 10º e 11º andares, Torre Sul, CEP 04543-907, São Paulo - SP, inscrito no CNPJ/MF sob nº 01.522.368/0001-82 ("Administrador"), na qualidade de administrador fiduciário do **TREND ETF SMALL CAPS FUNDO DE ÍNDICE**, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 40.153.709/0001-41 ("Fundo"), vem, por meio do presente, em atenção às disposições do artigo 40 da Instrução CVM nº 359, de 22 de janeiro de 2002, conforme alterada, informar aos cotistas do Fundo ("Cotistas") e ao mercado em geral que, a incorporação pelo TREND ETF IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 40.155.573/0001-09 ("Fundo Incorporador"), aprovada em Assembleia Geral Extraordinária do Fundo ("Assembleia") e Assembleia Geral Extraordinária do Fundo Incorporador ("Assembleia do Incorporador"), será implementada na abertura do dia 27 de junho de 2023, nos termos indicados no Fato Relevante do Fundo, divulgado em 18 de maio de 2023 ("Incorporação").

Neste sentido, conforme indicado no Memorial de Incorporação dos Fundos de Investimento de Índice ("Memorial"), as relações de troca da Incorporação foram definidas com base no valor patrimonial das cotas do Fundo Incorporador e do Fundo, apurados na Data de Corte (i.e., a presente data), tomando-se como base o valor patrimonial ajustado das cotas do Fundo dividido pelo valor patrimonial ajustado das cotas do Fundo Incorporador, consistindo nos valores indicados na tabela abaixo, de modo que cada cota do Fundo será substituída e convertida em 0,61924081 (zero virgula seis, um, nove, dois, quatro, zero, oito, um) cotas do Fundo Incorporador, sendo que a posição de cotas do Fundo deverão corresponder a um número inteiro:



# BNP PARIBAS

Fundo	PL (R\$)	Quantidade de Cotas	Cota Patrimonial (R\$)	% participação no Fundo Incorporador após incorporação	Quantidade de Cotas – Fundo Incorporador após incorporação	Relação de Troca
Fundo Incorporado	4.427.282,11	600.000	7,3788030	0,08%	371.544	1,00000000
Fundo Incorporador	529.661.170,30	44.450.000	11,9158860	N/A	44.450.000	0,61924081
Fundo Incorporador (após incorporação)	534.088.452,41	44.821.544	11,9158860	N/A	44.821.544	N/A

As frações de cotas resultantes da Incorporação, em decorrência da Relação de Troca, serão agregadas a fim de formar números inteiros de cotas, as quais serão ofertadas à venda por meio de leilão a ser realizado na B3 posteriormente à conversão das cotas do Fundo em cotas do Fundo Incorporador, sendo que os valores líquidos angariados serão creditados nas contas correntes dos detentores de tais frações, nos termos do Memorial.

Este Fato Relevante, bem como o Memorial e os demais documentos relativos à Incorporação foram disponibilizados para consulta no website do dos fundos, através dos links:

**Fundo:** [www.xpasset.com.br/etfs/xmal11](http://www.xpasset.com.br/etfs/xmal11)

**Fundo Incorporador:** [www.xpasset.com.br/etfs/bovx11](http://www.xpasset.com.br/etfs/bovx11)

Adicionalmente, também foram disponibilizados no sistema FundosNet, portanto, podem ser consultados nos websites da CVM ([www.cvm.gov.br](http://www.cvm.gov.br)) e B3 ([www.b3.com.br](http://www.b3.com.br)).

Sendo o que se apresenta no momento, permanecemos à inteira disposição para quaisquer esclarecimentos que se façam necessários.

Atenciosamente,

**BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.**