



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:** ISHARES BOVESPA BR+ EQUAL WEIGHT B3 FUNDO
- DE ÍNDICE
- **CNPJ do Fundo:** 60.554.347/0001-08
- **Nome da classe:** ISHARES BOVESPA BR+ EQUAL WEIGHT B3 CLASSE DE ÍNDICE RESPONSABILIDADE LIMITADA

II. FATORES DE RISCO

a. Risco de mercado – O patrimônio da Classe pode ser afetado negativamente pela variação dos preços das ações que compõem o índice Bovespa BR+ Equal Weight, bem como pelas oscilações nas taxas de juros e nas condições macro-econômicas brasileiras.

b. Risco sistêmico – Choques macro-econômicos, políticos ou sanitários que afetem o sistema financeiro como um todo podem produzir perdas generalizadas na carteira da Classe.

c. Risco de crédito – Embora a carteira seja constituída por ações, há risco de inadimplência dos emissores dos valores mobiliários ou das contrapartes em operações de derivativos utilizadas para gestão de risco.

d. Risco de descolamento de rentabilidade – A performance da Classe pode divergir do índice de referência devido a (i) taxa de administração e demais despesas; (ii) diferenças temporais no ajuste da carteira quando há alterações no rebalanceamento do índice; (iii) receitas ainda não recebidas; (iv) posições em caixa ou em ativos permitidos; (v) limites operacionais nos períodos de rebalanceamento.

e. Risco de liquidez das cotas (ETF) – Não há garantia de existência de mercado ativo para negociação das cotas; o preço de negociação pode apresentar ágio ou deságio em relação ao Valor Patrimonial e os lotes negociados podem ser limitados.

f. Risco de liquidez dos ativos – A liquidez dos papéis que compõem o índice depende da profundidade dos mercados de ações e dos contratos futuros. Em momentos de estresse, a dificuldade de vender esses ativos pode impedir a Classe de atender solicitações de resgate ou de manter a aderência ao índice, afetando sua solvência.

g. Risco de não atender aos requisitos mínimos para emissão e resgate – Integralizações e resgates exigem a entrega de “cesta” por Agente Autorizado dentro do “Horário de Corte” (15 min após o fechamento da B3) e a apresentação da documentação exigida (Declaração de Isenção ou IRF). O descumprimento impede a execução da ordem.

h. Risco de ágio e deságio – As cotas podem ser negociadas acima (ágio) ou abaixo (deságio) do seu Valor Patrimonial ou Indicativo, refletindo a dinâmica de oferta e demanda no mercado secundário.

i. Risco de o provedor do índice parar de administrar ou manter o índice – O índice Bovespa BR+ Equal Weight é criado, calculado e mantido pela B3. Caso a B3 deixe de prestar esse serviço, o Administrador deverá convocar Assembleia de Cotistas para deliberar sobre mudança de objetivo, ajuste de taxa ou eventual liquidação da Classe.



BNP PARIBAS

j. Risco de suspensão da negociação das cotas – A CVM ou a B3 podem suspender a negociação das cotas a qualquer momento, quando julgarem necessário para proteção dos cotistas ou por questões regulatórias/operacionais.

k. Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice – A Classe depende da disponibilidade e da integridade das informações e da metodologia fornecida pela B3. Falhas ou atrasos no fornecimento do índice podem comprometer a capacidade de replicação do objetivo da Classe.

III. INFORMAÇÕES SOBRE FUNDOS DE ÍNDICE (ETF)

a. O que são os Fundos de Índice (ETF) – São fundos que buscam replicar, de forma passiva, a performance de um índice de referência (no caso, o Bovespa BR+ Equal Weight). As cotas são listadas e negociadas em bolsa, permitindo ao investidor obter exposição ao conjunto de ações que compõem o índice com um único instrumento.

b. Semelhanças e diferenças com demais fundos de investimento

- *Semelhanças:* regidos pela CVM, possuem patrimônio segregado por classe, administração, custódia e auditoria independentes.
- *Diferenças:* (i) negociação contínua em bolsa (preço de mercado pode divergir do Valor Patrimonial); (ii) gestão passiva – não há objetivo de superar o índice; (iii) não há taxa de performance; (iv) a liquidez das cotas depende da existência de mercado secundário, não de chamadas de resgate ao administrador.

c. Processo de integralização e resgate – As operações são realizadas exclusivamente por **Agentes Autorizados**. Para integralizar, o agente entrega à Classe uma **cesta** (mínimo 95 % em ativos que compõem o índice e até 5 % em Investimentos Permitidos ou dinheiro) até o “Horário de Corte”. Em troca, a Classe emite **Lotes Mínimos de Cotas**. Para resgate, o agente apresenta a cesta correspondente e recebe as cotas a ser canceladas. As ordens são liquidáveis em D+2.

d. Estratégias permitidas pela regulação – A regulação autoriza (i) investimento direto nos papéis que compõem o índice; (ii) posição líquida em contratos futuros do índice; (iii) cotas de outros fundos de índice que replicam o mesmo benchmark; (iv) até 5 % do patrimônio em Investimentos Permitidos (títulos públicos, títulos de renda fixa de instituição financeira, fundos de renda fixa “Simples/Curto Prazo/Referenciado” e operações compromissadas); (v) uso de derivativos exclusivamente para gerenciamento de risco, com margem de garantia limitada a 20 % do patrimônio líquido da Classe.

e. Regulação aplicável – Resolução CVM n.º 175/2022 (e suas atualizações), Anexo Normativo V da referida Resolução, Lei 11.555/2007, Código Civil (arts. 1.368-D) e as normas da B3 relativas à negociação de ETFs.

f. Como a Classe atinge seu objetivo – Mantendo, no mínimo, **95 %** do patrimônio em (i) ativos que compõem o índice Bovespa BR+ Equal Weight, (ii) posição líquida em contratos futuros do índice e (iii) cotas de outros fundos que replicam o mesmo benchmark. O Gestor adota uma política de indexação rígida, realizando ajustes de carteira nas **Datas de Rebalanceamento** (a cada 4 meses) e podendo suspender integralizações ou resgates no período de 5 dias úteis antes e depois da data de rebalanceamento, conforme previsto no regulamento.

g. Como acompanhar a evolução do preço da Classe – Cotação em tempo real na B3; Valor Patrimonial da Cota (VPC) calculado diariamente ao final de cada Dia de Cota; composição da cesta e demais informações divulgadas diariamente no site oficial do fundo: <https://www.blackrock.com/br/products/341926/>.

IV. GLOSSÁRIO



BNP PARIBAS

- **Agente Autorizado** – Corretora que tenha firmado um *Contrato de Agente Autorizado* para realizar integralizações e resgates de cotas da Classe.
- **Cesta** – Conjunto de ativos (cotas do fundo-alvo, Investimentos Permitidos, Valores em Dinheiro e/ou Direitos sobre Ações) que deve ser entregue para a emissão ou resgate de Lotes Mínimos de Cotas, conforme calculado pelo Gestor e divulgado diariamente.
- **Lote Mínimo de Cotas** – Quantidade mínima de cotas que pode ser emitida ou resgatada, a critério do Gestor, mediante apresentação de uma *Ordem de Integralização* ou *Ordem de Resgate* por um Agente Autorizado.
- **Ordem de Integralização** – Ordem emitida por um Agente Autorizado para que a Classe emita e entregue um Lote Mínimo de Cotas em contrapartida à entrega simultânea de uma Cesta.
- **Ordem de Resgate** – Ordem emitida por um Agente Autorizado para que a Classe entregue a Cesta em troca da devolução de um Lote Mínimo de Cotas.
- **Registro de Cotista** – Sujeito a tributação que solicita a um Agente Autorizado que efetue o resgate de um ou mais Lotes Mínimos de Cotas detidos por tal cotista.
- **Valores em Dinheiro** – Parcela da cesta, se houver, que consiste 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 sábados, domingos, feriados nacionais e dias sem expediente na B3) em que é calculado o Valor Patrimonial das Cotas.
- **Dia Útil** – Entende-se por dia útil qualquer dia que não seja (i) sábado, domingo ou feriado nacional, ou (ii) dia em que a B3 não tenha expediente.

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/60554347000108>

VI. AVISOS IMPORTANTES

- **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.



BNP PARIBAS

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.