



## 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 IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE
- **CNPJ do Fundo:** 10.406.511/0001-61
- **Nome da classe:** ISHARES IBOVESPA CLASSE DE ÍNDICE - RESP LIMITADA

### II. FATORES DE RISCO

O potencial investidor deve estar ciente de que a aquisição de cotas desta Classe de Fundo de Índice (ETF) envolve os seguintes riscos:

- **a. Risco de mercado:** Refere-se à possibilidade de variações nos preços dos ativos que compõem o índice Ibovespa, o que pode impactar o valor patrimonial da Classe e o preço das cotas.
- **b. Risco sistêmico:** Risco de que eventos macroeconômicos ou crises no sistema financeiro afetem todos os ativos do mercado simultaneamente, impactando o desempenho do índice e do fundo.
- **c. Risco de crédito:** Risco de inadimplência das contrapartes em operações de derivativos ou de custódia, embora o fundo foque em ativos de renda variável de alta liquidez.
- **d. Risco de descolamento de rentabilidade (Tracking Error):** Risco de a rentabilidade da Classe não replicar fielmente a variação do índice Ibovespa, devido a custos de gestão, impostos, taxas ou ajustes de rebalanceamento.
- **e. Risco de liquidez das cotas da Classe:** Risco de o investidor não conseguir vender suas cotas no mercado secundário pelo preço desejado ou em tempo hábil devido à baixa demanda de negociação das cotas no pregão.
- **f. Risco de liquidez dos Ativos:** Refere-se à dificuldade de comercializar os ativos que compõem a carteira do índice. Se o mercado de ações estiver ilíquido, o fundo pode enfrentar dificuldades para replicar o índice ou atender solicitações de resgate via cestas, impactando a solvência da Classe.
- **g. Risco de o investidor não atender aos requisitos mínimos para emissão e resgate:** Investidores que operam via mercado primário (Participantes Autorizados) devem cumprir critérios específicos de qualificação e utilização de cestas de ativos.
- **h. Risco de ágio e deságio:** As cotas negociadas em bolsa podem ser negociadas por valores superiores (ágio) ou inferiores (deságio) ao seu valor patrimonial devido à dinâmica de oferta e demanda no mercado secundário.
- **i. Risco de o provedor do índice parar de administrar ou manter o índice:** Caso o provedor do índice Ibovespa descontinue o índice, a estratégia de replicação torna-se inviável, podendo levar à liquidação da Classe.
- **j. Risco de suspensão da Negociação das cotas:** Possibilidade de suspensão das negociações pelas autoridades reguladoras (CVM) ou pela entidade administradora do mercado organizado (B3).
- **k. Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice:** Eventuais falhas ou interrupções no fornecimento de dados em tempo real do índice podem afetar a precificação e a gestão.

### III. INFORMAÇÕES SOBRE FUNDOS DE ÍNDICE (ETF)

- **a. O que são os Fundos de Índice (ETF):** São fundos de investimento que buscam replicar o desempenho de um índice de referência (benchmark). Suas cotas são negociadas em bolsa de valores como se fossem ações.
- **b. Semelhanças e diferenças:** Assim como outros fundos, os ETFs possuem gestão, administração e taxas. Diferem por possuírem gestão passiva (objetivo de replicar e não superar o índice) e por serem negociados continuamente em bolsa durante o pregão.
- **c. Processo de integralização e resgate:** Ocorre por meio de "cestas de ativos" (creation/redemption baskets). Participantes Autorizados trocam cestas de ativos por cotas



## BNP PARIBAS

(emissão) ou cotas por cestas de ativos (resgate), garantindo o alinhamento entre o valor do fundo e o índice.

- **d. Estratégias permitidas:** A Classe utiliza estratégia de gestão passiva, investindo pelo menos 95% de seu patrimônio líquido em ativos que compõem o índice Ibovespa ou instrumentos similares.
- **e. Regulação aplicável:** O fundo é regulado pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM) e segue as normas de fundos de índice vigentes no Brasil.
- **f. Como atingem o objetivo:** Através da replicação física ou sintética dos componentes do índice Ibovespa, buscando minimizar o erro de acompanhamento (tracking error).
- **g. Acompanhamento de preço:** O investidor pode acompanhar a evolução do preço das cotas através de home brokers, plataformas de corretoras e sites de dados de mercado em tempo real.

#### IV. GLOSSÁRIO

- **Benchmark:** Índice de referência utilizado para medir o desempenho do fundo.
- **Cota:** Fração do patrimônio do fundo que representa a participação do investidor.
- **Ibovespa:** Principal índice de desempenho das ações negociadas na B3.
- **Liquidez:** Facilidade de converter um ativo em dinheiro sem perda significativa de valor.
- **Patrimônio Líquido:** Diferença entre o valor total dos ativos do fundo e o total de suas obrigações/passivos.

#### V. TAXAS E DEMAIS DESPESAS DA CLASSE

Esta modalidade de 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/10406511000161>

#### VI. AVISOS IMPORTANTES

- 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.
- 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.

---

#### MATERIAL PUBLICITÁRIO

*Este material é meramente informativo e não constitui recomendação de investimento. Os dados aqui contidos não são suficientes para a tomada de decisão de investimento.*