



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 S&P 500 FUNDO DE ÍNDICE
- **CNPJ do Fundo:** 19.909.560/0001-91
- **Nome da Classe:** ISHARES S&P 500 CLASSE DE ÍNDICE EM COTAS DE CLASSES DE ÍNDICE INVESTIMENTO NO EXTERIOR - RESPONSABILIDADE LIMITADA
-

II. FATORES DE RISCO

O potencial investidor deve estar ciente de que a aquisição de cotas desta Classe envolve riscos. Abaixo, elencamos os principais fatores:

- **a. Risco de Mercado:** O patrimônio da Classe pode ser afetado negativamente pela flutuação de preços e cotações dos ativos detidos, bem como pela oscilação de taxas de juros e do desempenho dos emissores.
- **b. Risco Sistemico:** Eventos macroeconômicos, políticos ou sociais de ampla escala podem afetar o funcionamento dos mercados e o desempenho de todos os ativos simultaneamente.
- **c. Risco de Crédito:** Embora a Classe busque replicar um índice de ações, existe o risco de que os emissores dos ativos da carteira não cumpram com suas obrigações financeiras.
- **d. Risco de Descolamento de Rentabilidade:** A performance da Classe pode não refletir integralmente a do Índice devido a taxas, despesas, diferenças temporais no ajuste da carteira ou momentos em que os ativos do índice ainda não foram incorporados à carteira da Classe.
- **e. Risco de Liquidez das Cotas:** Não há garantia de que haverá um mercado ativo para as cotas da Classe, não sendo possível prever os níveis de preço ou o tamanho dos lotes negociados no mercado secundário.
- **f. Risco de Liquidez dos Ativos:** Pode haver redução ou inexistência de demanda pelos ativos da carteira nos mercados onde são negociados. Isso pode impedir a Classe de honrar obrigações de forma eficiente e causar perdas significativas na negociação de ativos para atender solicitações de resgate.
- **g. Risco de não atendimento aos requisitos mínimos:** O processo de integralização e resgate exige o cumprimento de procedimentos específicos, como a entrega de "Cestas" por Agentes Autorizados e o atendimento a horários de corte. O não cumprimento desses requisitos pode impedir a execução das ordens.
- **h. Risco de Ágio e Deságio:** As cotas podem ser negociadas no mercado secundário por valores diferentes do seu Valor Patrimonial, apresentando ágio (preço acima do patrimônio) ou deságio (preço abaixo do patrimônio).
- **i. Risco de o provedor do índice parar de administrar ou manter o índice:** A Classe depende da manutenção do índice S&P 500 pela Standard & Poor's. Caso o provedor cesse a gestão ou cálculo do índice, poderá ocorrer a liquidação da Classe.
- **j. Risco de suspensão da Negociação das cotas:** A CVM ou a B3 podem suspender a negociação das cotas em circunstâncias específicas para proteção dos cotistas ou por questões regulatórias/operacionais.



BNP PARIBAS

- **k. Risco relativo ao fornecimento do índice:** A Classe depende da precisão e da disponibilidade das informações e metodologias fornecidas pela Standard & Poor's para atingir seu objetivo.
-

III. INFORMAÇÕES SOBRE FUNDOS DE ÍNDICE (ETF)

- **a. O que são os Fundos de Índice (ETF):** São fundos que buscam replicar o desempenho de um determinado índice de referência (como o S&P 500), sendo negociados em bolsa de valores como se fossem ações.
- **b. Semelhanças e diferenças:** Assim como outros fundos, possuem patrimônio e gestão profissional. Diferente de fundos tradicionais, os ETFs são negociados continuamente no mercado secundário (bolsa) durante o pregão, e o preço oscila conforme a oferta e demanda.
- **c. Processo de integralização e resgate:** Ocorre por meio de "Agentes Autorizados" que entregam ou recebem uma "Cesta" (composta por cotas do fundo alvo, ativos permitidos ou dinheiro) em troca de Lotes Mínimos de Cotas, ou vice-versa.
- **d. Estratégias permitidas:** A regulação permite estratégias de indexação (passivas). Esta Classe utiliza uma abordagem passiva, investindo predominantemente no iShares Core S&P 500 ETF (IVV) para replicar o índice S&P 500.
- **e. Regulação aplicável:** O Fundo é regido pela Resolução CVM nº 175/2022 e demais normas da CVM e da B3.
- **f. Como atingem o objetivo:** Através da compra dos ativos que compõem o índice ou de fundos que os repliquem, mantendo uma composição de carteira que minimize o descolamento em relação ao índice de referência.
- **g. Acompanhamento de preços:** O investidor pode acompanhar a evolução do preço através do site da B3, plataformas de negociação de valores mobiliários e no website oficial do Fundo.

IV. GLOSSÁRIO

- **Agente Autorizado:** Corretora que possui contrato para realizar operações de integralização e resgate de cotas junto à Classe.
- **Cesta:** Conjunto de ativos (cotas de fundo alvo, ativos permitidos ou dinheiro) entregue para a emissão ou resgate de cotas.
- **Cotista:** Investidor que detém cotas da Classe do Fundo.
- **Fundo de Índice Alvo:** O fundo (neste caso, o iShares Core S&P 500 ETF - IVV) que a Classe busca replicar.
- **Índice de Referência:** O benchmark (S&P 500) que norteia a estratégia de investimento da Classe.
- **Lote Mínimo de Cotas:** Quantidade mínima de cotas estabelecida para operações de integralização e resgate.
- **Patrimônio Líquido:** Valor resultante da diferença entre o total de ativos e o total de passivos da Classe.

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.



BNP PARIBAS

As taxas poderão ser consultadas no link: <https://data.anbima.com.br/fundos/transparencia-de-taxas-de-fundos/19909560000191>

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.
- Esta Classe utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas.

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.