



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:** NU IBOV SMART DIVIDENDOS FUNDO DE ÍNDICE
- **CNPJ do Fundo:** 52.116.361/0001-00
- **Nome da classe:** NU IBOV SMART DIVIDENDOS CLASSE DE ÍNDICE – RESPONSABILIDADE LIMITADA

II. FATORES DE RISCO

a. **Risco de mercado** – A variação dos preços das ações que compõem o índice Ibovespa Smart Dividendos pode afetar negativamente o valor da classe.

b. **Risco sistêmico** – Eventos macro-econômicos ou financeiros de grande abrangência podem impactar simultaneamente a maioria dos ativos da carteira.

c. **Risco de crédito** – Apesar de o fundo investir em ações, a deterioração da situação financeira dos emissores pode refletir-se nos preços das cotas.

d. **Risco de descolamento de rentabilidade** – Por ser um fundo de réplica de índice, podem ocorrer diferenças entre o retorno da classe e o desempenho do índice devido a custos operacionais, timing de ajustes e receitas ainda não recebidas.

e. **Risco de liquidez das cotas (ETF)** – Não há garantia de existência de mercado ativo para negociação das cotas; o preço pode apresentar ágio ou deságio em relação ao Valor Patrimonial da Cota.

f. **Risco de liquidez dos ativos** – Em momentos de stress nos mercados de ações brasileiros, a negociação dos papéis que compõem o índice pode tornar-se limitada, dificultando a realização de resgates e afetando a solvência da classe.

g. **Risco de não atender aos requisitos mínimos para emissão e resgate** – Integralizações e resgates dependem da entrega de “cesta” por Agente Autorizado dentro do horário de corte e da apresentação da documentação exigida; o não cumprimento impede a operação.

h. **Risco de ágio e deságio** – As cotas podem ser negociadas acima (ágio) ou abaixo (deságio) do seu Valor Patrimonial ou Indicativo.

i. **Risco de o provedor do índice parar de administrar ou manter o índice** – Caso a B3 deixe de calcular ou publicar o Índice Ibovespa Smart Dividendos, o administrador deverá convocar Assembleia de Cotistas para deliberar sobre mudança de objetivo ou liquidação da classe.

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.

k. **Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice** – A classe depende da precisão e da disponibilidade das informações e da metodologia fornecidas pela B3; falhas ou atrasos podem comprometer a capacidade de replicação do objetivo.

III. INFORMAÇÕES SOBRE FUNDOS DE ÍNDICE (ETF)

a. **O que são os Fundos de Índice (ETF)** – Veículos de investimento que buscam replicar passivamente a performance de um índice de referência, negociando suas cotas em bolsa como ações.



BNP PARIBAS

b. **Semelhanças e diferenças** – Assim como demais fundos, possuem patrimônio segregado, administração, custódia e auditoria independentes. Diferem pelos (i) negociação contínua em bolsa, (ii) possibilidade de ágio/deságio em relação ao Valor Patrimonial, (iii) gestão passiva sem objetivo de superar o índice, (iv) ausência de taxa de performance.

c. **Processo de integralização e resgate** – Realizado por **Agentes Autorizados**. Para integralizar, o agente entrega à classe uma **cesta** (mínimo 95 % dos ativos do índice e até 5 % em ativos permitidos ou caixa) dentro do horário de corte; a classe emite o **Lote Mínimo de Cotas** correspondente. Para resgate, o agente apresenta a cesta e recebe as cotas a serem canceladas. As operações liquidam-se em D+2.

d. **Estratégias permitidas pela regulação** – Investimento direto nos componentes do índice; posição líquida em contratos futuros vinculados ao índice; até 5 % do patrimônio em Investimentos Permitidos (títulos públicos, renda fixa de instituição financeira, fundos de renda fixa “Simples/Curto Prazo/Referenciado” e operações compromissadas); uso de derivativos exclusivamente para hedge, limitado a 20 % da carteira; empréstimo de títulos até 60 % do patrimônio, com receita revertida à classe.

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

f. **Como a classe atinge seu objetivo** – Mantendo, no mínimo, 95 % dos ativos investidos nos componentes do índice Ibovespa Smart Dividendos, nas posições de futuros correspondentes ou em cotas de outros fundos que o replicam. O gestor realiza rebalanceamentos de acordo com a periodicidade definida pelo provedor do índice e pode suspender integralizações ou resgates nos períodos de 5 dias úteis antes e depois da data de rebalanceamento.

g. **Como o investidor pode acompanhar a evolução do preço** – Cotação em tempo real na B3; Valor Patrimonial da Cota (VPC) calculado diariamente ao final de cada Dia de Cota; composição da carteira, desempenho e demais informações divulgadas no website oficial do fundo: <https://www.nuasset.nu/etfs/nsdv11>.

IV. GLOSSÁRIO

- **Agente Autorizado** – Corretora que tenha firmado contrato para efetuar integralizações e resgates de cotas da classe.
- **Cesta** – Conjunto de ativos (cotas de 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.
- **Lote Mínimo de Cotas** – Quantidade mínima de cotas que pode ser emitida ou resgatada, a critério do gestor, mediante apresentação de Ordem de Integralização ou Ordem de Resgate por Agente Autorizado.
- **Ordem de Integralização** – Ordem emitida por Agente Autorizado para que a classe entregue um Lote Mínimo de Cotas em contrapartida à entrega simultânea de uma Cesta.
- **Ordem de Resgate** – Ordem emitida por 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 o resgate de um ou mais Lotes Mínimos de Cotas que detém.
- **Valores em Dinheiro** – Parcela da cesta, se houver, constituída 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.



BNP PARIBAS

- **Dia de Cota** – Qualquer dia útil (excluindo fins de semana, 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/52116361000100>. Para informações completas sobre taxas, consulte o link indicado.

VI. AVISOS

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.

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.