



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 HIGH BETA B3 FUNDO DE ÍNDICE

CNPJ do Fundo: 55.705.611/0001-27

Nome da classe: NU IBOV SMART HIGH BETA B3 CLASSE DE ÍNDICE – RESPONSABILIDADE LIMITADA

II. FATORES DE RISCO

a. **Risco de mercado** – Flutuações nos preços das ações que compõem o índice Bovespa BR+ Equal Weight B3 podem provocar perdas na classe.

b. **Risco sistêmico** – Eventos econômicos ou financeiros de grande magnitude podem afetar simultaneamente a maioria dos ativos da carteira.

c. **Risco de crédito** – A deterioração da situação financeira dos emissores das ações pode impactar o valor das cotas.

d. **Risco de descolamento de rentabilidade** – Diferenças entre o retorno da classe e o desempenho do índice podem surgir por custos operacionais, timing de rebalanceamento e receitas ainda não realizadas.

e. **Risco de liquidez das cotas (ETF)** – Não há garantia de mercado secundário ativo; as cotas podem negociar com ágio ou deságio em relação ao Valor Patrimonial.

f. **Risco de liquidez dos ativos** – Em períodos de stress, a negociação dos papéis que compõem o índice pode ser limitada, dificultando a execução 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 documentação exigida; a falta de conformidade impede a operação.

h. **Risco de ágio e deságio** – As cotas podem ser negociadas acima ou abaixo 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 manter o índice Bovespa BR+ Equal Weight B3, o administrador deverá notificar os cotistas e convocar Assembleia 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 proteger os investidores ou por questões regulatórias.

k. **Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice** – A classe depende da precisão e disponibilidade das informações e da metodologia da B3; falhas ou atrasos podem comprometer a réplica do benchmark.

III. INFORMAÇÕES SOBRE FUNDOS DE ÍNDICE (ETF)

a. **O que são os Fundos de Índice (ETF)** – Veículos que replicam passivamente a performance de um índice, com cotas negociadas em bolsa.

b. **Semelhanças e diferenças** – Compartilham regulação, segregação patrimonial, administração e custódia com outros fundos; diferem pela negociação em bolsa, possibilidade de ágio/deságio e gestão passiva sem objetivo de superar o índice.



BNP PARIBAS

c. **Processo de integralização e resgate** – Realizado por Agentes Autorizados. Integralização: entrega de cesta ($\geq 95\%$ dos ativos do índice + até 5% em ativos permitidos ou caixa) dentro do horário de corte; a classe emite Lote Mínimo de Cotas. Resgate: o agente apresenta a cesta e recebe as cotas canceladas. Liquidação em D+2.

d. **Estratégias permitidas** – Investimento direto nos componentes do índice; posições líquidas em futuros do índice; até 5% em Investimentos Permitidos; uso de derivativos exclusivamente para hedge, limitado a 20% da carteira; empréstimo de títulos até 70% do patrimônio, com renda revertida à classe.

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

f. **Como a classe atinge seu objetivo** – Mantendo, no mínimo, 95% dos ativos nos componentes do índice Bovespa BR+ Equal Weight B3, em posições de futuros ou cotas de fundos equivalentes, realizando rebalanceamentos de acordo com a periodicidade estabelecida pela B3 e podendo 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 calculado ao final de cada Dia de Cota; informações de carteira, performance e demais comunicados disponíveis no website do fundo: <https://www.nuasset.nu/etfs/high11/>.

IV. GLOSSÁRIO

- **Agente Autorizado** – Corretora autorizada a efetuar integralizações e resgates de cotas.
- **Cesta** – Conjunto de ativos (cotas de fundo-alvo, Investimentos Permitidos, Valores em Dinheiro e/ou Direitos sobre Ações) que deve ser entregue para 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 Ordem de Integralização ou Ordem de Resgate por Agente Autorizado.
- **Ordem de Integralização** – Ordem que obriga a classe a emitir e entregar um Lote Mínimo de Cotas em troca da entrega simultânea de uma Cesta.
- **Ordem de Resgate** – Ordem que obriga a classe a entregar a Cesta em troca da devolução de um Lote Mínimo de Cotas.
- **Registro de Cotista** – Sujeito a tributação que solicita ao Agente Autorizado o resgate de cotas que detém.
- **Valores em Dinheiro** – Parcela da cesta, quando 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.
- **Dia de Cota** – Qualquer dia útil (excluindo fins de semana, feriados e dias sem expediente na B3) em que é calculado o Valor Patrimonial das Cotas.
- **Dia Útil** – Dia que não seja sábado, domingo, feriado nacional ou dia sem expediente na B3.

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.”



BNP PARIBAS

As taxas poderão ser consultadas no link: <https://data.anbima.com.br/fundos/transparencia-de-taxas-de-fundos/55705611000127>

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.