



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 LOW VOLATILITY B3 FUNDO DE ÍNDICE

CNPJ do Fundo: 55.705.668/0001-26

Nome da classe: NU IBOV SMART LOW VOLATILITY B3 CLASSE DE ÍNDICE – RESPONSABILIDADE LIMITADA

II. FATORES DE RISCO

a. **Risco de mercado** – Variações nas ações que compõem o índice Ibovespa Smart Low Volatility podem gerar perdas para a classe.

b. **Risco sistêmico** – Eventos macro-econômicos ou crises financeiras podem impactar simultaneamente grande parte dos ativos da carteira.

c. **Risco de crédito** – A deterioração da situação financeira dos emissores das ações pode refletir-se nos preços das cotas.

d. **Risco de descolamento de rentabilidade** – Diferenças entre o retorno da classe e o desempenho do índice podem ocorrer devido a custos operacionais, timing de rebalanceamento e receitas ainda não recebidas.

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

f. **Risco de liquidez dos ativos** – Em momentos de stress nos mercados de ações, a negociação dos componentes do índice pode ser limitada, dificultando a realização de resgates e comprometendo a solvência da classe.

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 e a apresentação da documentação exigida; a não 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 Ibovespa Smart Low Volatility, 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 a proteção dos cotistas ou por razões regulatórias.

k. **Risco relativo ao fornecimento ou disponibilização do índice** – A classe depende da precisão e disponibilidade das informações e da metodologia fornecidas pela B3; falhas podem prejudicar a capacidade de replicar o 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 como ações.



BNP PARIBAS

b. Semelhanças e diferenças – Semelhanças: regulação, patrimônio segregado, administração e custódia independentes. Diferenças: negociação em bolsa, possibilidade de ágio/deságio, gestão passiva sem objetivo de superar o índice, ausência de taxa de performance.

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 receitas revertidas 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 ao menos 95% dos ativos nos componentes do índice Ibovespa Smart Low Volatility, em posições de futuros ou em cotas de fundos que replicam o mesmo benchmark, realizando rebalanceamentos conforme a periodicidade definida 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 e desempenho disponibilizadas no website do fundo: <https://www.nuasset.nu/etfs/lvol11>.

IV. GLOSSÁRIO

- **Agente Autorizado** – Corretora autorizada a realizar 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 possui.
- **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.



BNP PARIBAS

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/55705668000126>

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.