



**BNP PARIBAS**

São Paulo, 26 de junho de 2023.

**TREND ETF IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE**

**CNPJ/MF Nº 40.155.573/0001-09**

Código negociação B3: BOVX11

Código ISIN: BRBOVXCTF005

**FATO RELEVANTE**

O **BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.**, instituição financeira privada, com sede na Cidade e Estado de São Paulo, na Avenida Presidente Juscelino Kubitschek, nº 1.909, 9º, 10º e 11º andares, Torre Sul, CEP 04543-907, São Paulo - SP, inscrito no CNPJ/MF sob nº 01.522.368/0001-82 ("Administrador"), na qualidade de administrador fiduciário do **TREND ETF IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE**, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 40.155.573/0001-09 ("Fundo"), vem, por meio do presente, em atenção às disposições do artigo 40 da Instrução CVM nº 359, de 22 de janeiro de 2002, conforme alterada, informar aos cotistas do Fundo ("Cotistas") e ao mercado em geral que, a incorporação do TREND ETF SMALL CAPS FUNDO DE ÍNDICE, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 40.153.709/0001-41 ("Fundo Incorporado"), aprovada em Assembleia Geral Extraordinária do Fundo ("Assembleia") e Assembleia Geral Extraordinária do Fundo Incorporado ("Assembleia do Incorporado"), será implementada na abertura do dia 27 de junho de 2023, nos termos indicados no Fato Relevante do Fundo, divulgado em 18 de maio de 2023 ("Incorporação").

Neste sentido, conforme indicado no Memorial de Incorporação dos Fundos de Investimento de Índice ("Memorial"), as relações de troca da Incorporação foram definidas com base no valor patrimonial das cotas do Fundo e do Fundo Incorporado, apurados na Data de Corte (i.e., a presente data), tomando-se como base o valor patrimonial ajustado das cotas do Fundo Incorporado dividido pelo valor patrimonial ajustado das cotas do Fundo, consistindo nos valores indicados na tabela abaixo, de modo que cada cota do Fundo Incorporado será substituída e convertida em 0,61924081 (zero virgula seis, um, nove, dois, quatro, zero, oito, um) cotas do Fundo, sendo que a posição de cotas do Fundo Incorporado deverão corresponder a um número inteiro:



# BNP PARIBAS

| Fundo                                  | PL (R\$)       | Quantidade de Cotas | Cota Patrimonial (R\$) | % participação no Fundo Incorporador após incorporação | Quantidade de Cotas – Fundo Incorporador após incorporação | Relação de Troca |
|--|----------------|---------------------|------------------------|--|--|------------------|
| Fundo Incorporado                      | 4.427.282,11   | 600.000             | 7,3788030              | 0,08%  | 371.544  | 1,00000000       |
| Fundo Incorporador                     | 529.661.170,30 | 44.450.000          | 11,9158860             | N/A  | 44.450.000   | 0,61924081       |
| Fundo Incorporador (após incorporação) | 534.088.452,41 | 44.821.544          | 11,9158860             | N/A  | 44.821.544   | N/A              |

As frações de cotas resultantes da Incorporação, em decorrência da Relação de Troca, serão agregadas a fim de formar números inteiros de cotas, as quais serão ofertadas à venda por meio de leilão a ser realizado na B3 posteriormente à conversão das cotas do Fundo Incorporado em cotas do Fundo, sendo que os valores líquidos angariados serão creditados nas contas correntes dos detentores de tais frações, nos termos do Memorial.

Este Fato Relevante, bem como o Memorial e os demais documentos relativos à Incorporação foram disponibilizados para consulta no website dos fundos, através dos links:

**Fundo:** [www.xpasset.com.br/etfs/bovx11](http://www.xpasset.com.br/etfs/bovx11)

**Fundo incorporado:** [www.xpasset.com.br/etfs/xmal11](http://www.xpasset.com.br/etfs/xmal11)

Adicionalmente, também foram disponibilizados no sistema FundosNet, portanto, podem ser consultados nos websites da CVM ([www.cvm.gov.br](http://www.cvm.gov.br)) e B3 ([www.b3.com.br](http://www.b3.com.br)).

Sendo o que se apresenta no momento, permanecemos à inteira disposição para quaisquer esclarecimentos que se façam necessários.

Atenciosamente,

**BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.**