

O presente documento disponibiliza links para sites de terceiros que não pertencem e nem são controlados pelo Banco B3. O Banco B3 não monitora quaisquer sites de terceiros e a disponibilização de links não implica em afiliação com tais terceiros ou responsabilidade do Banco B3 pelo conteúdo disponibilizado.

Programa de BDR de ETF iShares MSCI USA Value Factor ETF

Tipo do Fundo: ETF Renda Variável

Gestor do Fundo: BlackRock Fund Advisors

Índice de referência: MSCI USA Enhanced Value Index

Provedor do Índice: MSCI

Bolsa de Negociação do ativo lastro: CBOE

Ticker US: VLUE | ***Ticker BR:*** BVLU39

ISIN US: US46432F3881 | ***ISIN BR:*** BRBVLUBDR008

Paridade do Programa: 1 : 10 (ETF : BDR)

Disponível para: Investidor em Geral

1. Qualificação do Administrador | Gestor | Custodiante | Instituição Depositária

Informações disponíveis no Descritivo Operacional:

Disponível em: <https://www.bancob3.com.br/bdr-de-etf/documentos>

Procurar o programa na barra de pesquisa e fazer o download do “Descritivo Operacional”.

2. Entidades administradoras de mercados organizados de valores mobiliários em que as cotas do fundo e os BDR são admitidos à negociação

Programa de BDR de ETF negociado na **B3 S.A.**;

Cota do fundo lastro do BDR negociado na **Cboe Global Markets (CBOE)**;

3. Regulamento do fundo:

Disponível em: <https://www.bancob3.com.br/bdr-de-etf/documentos>

Seção: Documentos | Selecionar o fundo "iShares MSCI USA Value Factor ETF" | Documento: Prospecto

O link acima se refere a tradução/interpretação do documento por parte do Gestor do ETF.

4. Descrição do índice de referência do fundo:

Metodologia

Disponível em: <https://www.bancob3.com.br/bdr-de-etf/documentos>

Seção: Documentos | Selecionar o fundo "iShares MSCI USA Value Factor ETF" | Documento: Metodologia do índice

O link acima se refere a tradução/interpretação livre do documento por parte do Depositário, uma vez que o documento oficial produzido pelo provedor do índice está somente na versão em inglês.

Constituintes

Disponível em: <https://www.msci.com/constituents>

Selecione no campo "Index Name" o código "USA ENHANCED VALUE" e clique em "Get constituents"

5. Demonstrações Financeiras do ETF lastro:

Demonstração Financeira Anual

Disponível em: <https://www.bancob3.com.br/bdr-de-etf/documentos>

Seção: Documentos | Selecionar o fundo "iShares MSCI USA Value Factor ETF" | Documento: Demonstrativo Financeiro Anual

O link acima se refere a tradução/interpretação do documento por parte do Gestor do ETF.

Demonstração Financeira Trimestral e/ou Semestral

Disponível em: <https://www.blackrock.com/us/individual/products/251616/>

Seção: Literature | Documento: Semi-Annual Report

6. Política de investimento; Público-alvo; Metas e objetivos de gestão do fundo, incluindo informação específica sobre como o fundo acompanha as variações e a rentabilidade do índice de referência, se por replicação integral da composição da carteira do índice ou por métodos de otimização da composição da carteira; Riscos envolvidos e descrição de fatores que afetam a aderência do desempenho do fundo lastro ao índice de referência; Taxas de Administração, ingresso e saída; Política de distribuição de resultados do fundo; Possibilidade de celebração de contrato a termo de troca de rentabilidade; Política de Voto em Assembleias:

Disponível em: <https://www.bancob3.com.br/bdr-de-etf/documentos>

Seção: Documentos | Selecionar o fundo "iShares MSCI USA Value Factor ETF" | Documento: Prospecto

O link acima se refere a tradução/interpretação do documento por parte do Gestor do ETF.

7. Dados estatísticos do fundo; Composição da carteira do fundo, diariamente atualizada:

Disponível em: <https://www.blackrock.com/us/individual/products/251616/>

8. Informações sobre desenquadramento:

Será feito comunicado a mercado através do mailing e pelo Plantão Empresas sempre que for notificado o desenquadramento

9. Fatos relevantes que envolvam o Depositário ou seu Custodiante no Exterior:

Será feito comunicado a mercado através do mailing e pelo Plantão Empresas sempre que houver qualquer fato relevante que impacte o programa de BDR de ETF, envolvendo o Depositário ou seu Custodiante no Exterior.

10. Descrição qualitativa dos componentes da remuneração à instituição proprietária do índice de referência:

Declaração disponível em: <https://www.bancob3.com.br/bdr-de-etf/documentos>

Procurar o programa na barra de pesquisa e fazer o download do "Declaração do Gestor do ETF lastro".

11. Direitos e Responsabilidades dos titulares dos BDRs, do Administrador, do gestor, da Instituição Depositária e do Custodiante:

Disponível no Descritivo Operacional em: <https://www.bancob3.com.br/bdr-de-etf/documentos>

Procurar o programa na barra de pesquisa e fazer o download do “Descritivo Operacional”.

Disponível no Contrato de Prestação de Serviços de Custódia em: <https://www.bancob3.com.br/sobre-o-bdr>

Seção: Entenda mais sobre os BDRs – Documentos - Contrato de Custódia Global

12. Tributação aplicável aos titulares de BDR; Demais informações consideradas relevantes para a decisão de investimento nos BDR; Procedimentos a serem seguidos pela instituição depositária em caso de descontinuidade do programa, nos termos do art. 74-R da Instrução CVM 359;

Disponível no Descritivo Operacional em: <https://www.bancob3.com.br/bdr-de-etf/documentos>

Procurar o programa na barra de pesquisa e fazer o download do “Descritivo Operacional”.

This document provides links to third-party websites that do not belong or are not controlled by Banco B3. Banco B3 does not monitor any third-party websites and the provision of links does not imply an affiliation with such third parties or Banco B3's responsibility for the content made available.

BDR over ETF Program ***iShares MSCI USA Value Factor ETF***

Fund Type: Equity ETF

Fund Manager: BlackRock Fund Advisors

Benchmark: MSCI USA Enhanced Value Index

Benchmark Provider: MSCI

Underlying Asset Exchange: CBOE

Ticker US: VLUE | Ticker BR: BVLU39

ISIN US: US46432F3881 | ISIN BR: BRBVLUBDR008

Program Parity: 1 : 10 (ETF : BDR)

Available to: General Investor

1. Qualification of Administrator | Manager | Custodian | Depositary Institution

Information available in the Operational Description:

Available at: <https://www.bancob3.com.br/en/bdr-on-etf/documents>

Search for the Program in the Search bar and download "Operational Description".

2. Entity responsible to organized market of securities in which ETF shares and BDRs are admitted to trading:

BDR over ETF Program tradable at **B3 S.A.**;

Shares of the underlying ETF of the BDR tradable at **Cboe Global Markets (CBOE)**;

3. ETF Prospectus:

Available at: <https://www.blackrock.com/us/individual/products/251616/>

Section: Literature | Document: Prospectus

4. Description of the ETF's benchmark index:

Methodology

Available at: <https://www.msci.com/index-methodology>

Select at "MSCI Index Methodology Search" the option "MSCI Global Investable Market Indexes Methodology" and "MSCI ENHANCED VALUE INDEXES METHODOLOGY" and click "Ok"

Constituents

Available at: <https://www.msci.com/constituents>

Select at "Index Name" the option "USA ENHANCED VALUE" and click "Get constituents"

5. Financial Statements over ETF:

Annual Report

Available at: <https://www.blackrock.com/us/individual/products/251616/>

Section: Literature | Document: Annual Report

Semi-Annual Report and/or Quarterly Report

Available at: <https://www.blackrock.com/us/individual/products/251616/>

Section: Literature | Document: Semi-Annual Report

6. Investment Policy;

Target Audience; Fund Management goals and objectives, including specific information on how the fund tracks variations and profitability of the Benchmark index, whether by fully replicating the composition of the index portfolio or by optimizing methods of the portfolio's composition; Risks involved and description of factors that affect the adherence of the underlying fund's performance to the benchmark index; Administration, entry and exit fees; Fund's profit distribution policy; Possibility of entering into a forward exchange contract; Voting Policy at Shareholder Meetings:

Available at: <https://www.blackrock.com/us/individual/products/251616/>

Section: Literature | Document: Prospectus

7. Statistics of the ETF; Composition of the fund's portfolio, updated daily:

Available at: <https://www.blackrock.com/us/individual/products/251616/>

8. Non-conformity details of the ETF:

A notice to the market will be made through the mailing and by the Plantao Empresas portal whenever a non-conformity is notified.

9. Relevant facts that involves the Depositary or the Custodian abroad:

A notice to the market through the mailing and by the Plantao Empresas portal whenever there is any relevant fact that impacts the BDR over ETF program, involving the Depositary or its Custodian Abroad.

10. Qualitative description of the remuneration to the Index Provider:

Statement available at: <https://www.bancob3.com.br/en/bdr-on-etf/documents>

Search for the Program in the Search bar and download "ETF Manager Statement".

11. Rights and responsibilities of the BDR holders, the Administrator, the Manager, the Depositary and the Custodian:

Operational Description available at: <https://www.bancob3.com.br/en/bdr-on-etf/documents>
Search for the Program in the Search bar and download “Operational Description”.

Available in the Custody Services Agreement at: <https://www.bancob3.com.br/en/about-bdr>
Section: Find more about BDRs – Documents - Contrato de Custódia Global

12. Taxation applicable to BDR holders; Any other relevant information for an investment decision in the BDR; Procedures to be followed by the depositary institution in case the program is discontinued, pursuant to art. 74-R of CVM Instruction 359;

Operational Description available at: <https://www.bancob3.com.br/en/bdr-on-etf/documents>
Search for the Program in the Search bar and download “Operational Description”.