Ishares Ibovespa Fundo de Índice

CNPJ nº 10.406.511/0001-61
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
(CNPJ nº 01.522.368/0001-82)

Demonstrações financeiras em 31 de março de 2023

Conteúdo

Relatório dos auditores independentes sobre as demonstrações financeiras **3**

Demonstrativo da composição e diversificação da carteira **6**

Demonstrações das evoluções do patrimônio líquido **9**

Notas explicativas sobre às demonstrações financeiras **10**

KPMG Auditores Independentes Ltda.
Rua Arquiteto Olavo Redig de Campos, 105, 12º andar - Torre A
04711-904 - São Paulo/SP - Brasil
Caixa Postal 79518 - CEP 04707-970 - São Paulo/SP - Brasil
Telefone +55 (11) 3940-1500
kpmg.com.br

Relatório dos auditores independentes sobre as demonstrações financeiras

Aos Cotistas e ao Administrador do
Ishares Ibovespa Fundo de Índice
São Paulo – SP

Opinião

Examinamos as demonstrações financeiras do Ishares Ibovespa Fundo de Índice ("Fundo") administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A., que compreendem o demonstrativo da composição e diversificação da carteira em 31 de março de 2023 e a respectiva demonstração das evoluções do patrimônio líquido para o exercício findo nesta data, bem como as correspondentes notas explicativas, compreendendo as políticas contábeis significativas e outras informações elucidativas.

Em nossa opinião, as demonstrações financeiras acima referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Ishares Ibovespa Fundo de Índice em 31 de março de 2023 e o desempenho de suas operações para o exercício findo nesta data, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicáveis aos fundos de investimento regulamentados pela Instrução nº 359/02 da Comissão de Valores Mobiliários (CVM).

Base para opinião

Nossa auditoria foi conduzida de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria. Nossas responsabilidades, em conformidade com tais normas, estão descritas na seção a seguir intitulada "Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações financeiras". Somos independentes em relação ao Fundo de acordo com os princípios éticos relevantes previstos no Código de Ética Profissional do Contador e nas normas profissionais emitidas pelo Conselho Federal de Contabilidade e cumprimos com as demais responsabilidades éticas de acordo com essas normas. Acreditamos que a evidência de auditoria obtida é suficiente e apropriada para fundamentar nossa opiniãO.

Principais assuntos de auditoria

Principais assuntos de auditoria são aqueles que, em nosso julgamento profissional, foram os mais significativos em nossa auditoria do exercício corrente. Esses assuntos foram tratados no contexto de nossa auditoria das demonstrações financeiras como um todo e na formação de nossa opinião sobre essas demonstrações financeiras e, portanto, não expressamos uma opinião separada sobre esses assuntos.

KPMG Auditores Independentes Ltda., uma sociedade simples brasileira, de responsabilidade limitada e firma-membro da organização global KPMG de firmas-membro independentes licenciadas da KPMG International Limited, uma empresa inglesa privada de responsabilidade limitada.

KPMG Auditores Independentes Ltda., a Brazilian limited liability company and a member firm of the KPMG global organization of independent member firms affiliated with KPMG International Limited, a private English company limited by guarantee.

Existência e Valorização de ações	
Veja o Demonstrativo da composição e diversificação da carteira	
Principais assuntos de auditoria	**Como a nossa auditoria conduziu esse assunto**
Em 31 de março de 2023, o Fundo possuía 98,52% de seu patrimônio líquido em investimentos em ações e direitos por empréstimos de ações, mensuradas ao valor justo com base em cotação de fechamento divulgada pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão, órgão responsável também pelo registro e custódia dessas ações. Devido ao fato desses ativos serem os principais elementos que influenciam o patrimônio líquido e o reconhecimento de resultado do Fundo, no contexto das demonstrações financeiras como um todo, consideramos esse assunto significativo em nossa auditoria.	Os nossos procedimentos de auditoria incluíram, mas não se limitaram a: • Teste de existência por meio de conciliação das posições mantidas pelo Fundo com as informações fornecidas pelo custodiante; • Recálculo da valorização das ações e direitos por empréstimos de ações, com base em cotação de fechamento divulgada pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão; e • Avaliação das divulgações efetuadas nas demonstrações financeiras do Fundo.

Com base nas evidências obtidas por meio dos procedimentos acima resumidos, consideramos aceitáveis os critérios utilizados na mensuração das ações e empréstimos de ações, no tocante à existência e valorização, assim como suas divulgações, no contexto das demonstrações financeiras tomadas em conjunto, referentes ao exercício findo em 31 de março de 2023.

Responsabilidade da administração do Fundo pelas demonstrações financeiras

A administração é responsável pela elaboração e adequada apresentação das demonstrações financeiras de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicáveis aos fundos de investimento regulamentados pela Instrução nº 359/02 da Comissão de Valores Mobiliários (CVM) e pelos controles internos que ela determinou como necessários para permitir a elaboração de demonstrações financeiras livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro.

Na elaboração das demonstrações financeiras, a administração é responsável, dentro das prerrogativas previstas na Instrução CVM nº 359/02, pela avaliação da capacidade do Fundo continuar operando, divulgando, quando aplicável, os assuntos relacionados com a sua continuidade operacional e o uso dessa base contábil na elaboração das demonstrações financeiras, a não ser que a administração pretenda liquidar o Fundo ou cessar suas operações, ou não tenha nenhuma alternativa realista para evitar o encerramento das operações.

Responsabilidades dos auditores pela auditoria das demonstrações financeiras

Nossos objetivos são obter segurança razoável de que as demonstrações financeiras, tomadas em conjunto, estão livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro, e emitir relatório de auditoria contendo nossa opinião. Segurança razoável é um alto nível de segurança, mas não uma garantia de que a auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria sempre detectam as eventuais distorções relevantes existentes. As distorções podem ser decorrentes de fraude ou erro e são consideradas relevantes quando, individualmente ou em conjunto, possam influenciar, dentro de uma perspectiva razoável, as decisões econômicas dos usuários tomadas com base nas referidas demonstrações financeiras.

KPMG Auditores Independentes Ltda., uma sociedade simples brasileira, de responsabilidade limitada e firma-membro da organização global KPMG de firmas-membro independentes licenciadas da KPMG International Limited, uma empresa inglesa privada de responsabilidade limitada.

KPMG Auditores Independentes Ltda., a Brazilian limited liability company and a member firm of the KPMG global organization of independent member firms affiliated with KPMG International Limited, a private English company limited by guarantee.

Como parte da auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria, exercemos julgamento profissional, e mantemos ceticismo profissional ao longo da auditoria. Além disso:

– Identificamos e avaliamos os riscos de distorção relevante nas demonstrações financeiras, independentemente se causada por fraude ou erro, planejamos e executamos procedimentos de auditoria em resposta a tais riscos, bem como obtemos evidência de auditoria apropriada e suficiente para fundamentar nossa opinião. O risco de não detecção de distorção relevante resultante de fraude é maior do que o proveniente de erro, já que a fraude pode envolver o ato de burlar os controles internos, conluio, falsificação, omissão ou representações falsas intencionais.

– Obtemos entendimento dos controles internos relevantes para a auditoria para planejarmos procedimentos de auditoria apropriados às circunstâncias, mas não com o objetivo de expressarmos opinião sobre a eficácia dos controles internos do Fundo.

– Avaliamos a adequação das políticas contábeis utilizadas e a razoabilidade das estimativas contábeis e respectivas divulgações feitas pela administração.

– Concluímos sobre a adequação do uso, pela administração, da base contábil de continuidade operacional e, com base nas evidências de auditoria obtidas, se existe incerteza relevante em relação a eventos ou condições que possam levantar dúvida significativa em relação à capacidade de continuidade operacional do Fundo. Se concluirmos que existe incerteza relevante, devemos chamar atenção em nosso relatório de auditoria para as respectivas divulgações nas demonstrações financeiras ou incluir modificação em nossa opinião, se as divulgações forem inadequadas. Nossas conclusões estão fundamentadas nas evidências de auditoria obtidas até a data de nosso relatório. Todavia, eventos ou condições futuras podem levar o Fundo a não mais se manter em continuidade operacional.

– Avaliamos a apresentação geral, a estrutura e o conteúdo das demonstrações financeiras, inclusive as divulgações e se as demonstrações financeiras representam as correspondentes transações e os eventos de maneira compatível com o objetivo de apresentação adequada.

Comunicamo-nos com a administração a respeito, entre outros aspectos, do alcance planejado, da época da auditoria e das constatações significativas de auditoria, inclusive as eventuais deficiências significativas nos controles internos que identificamos durante nossos trabalhos.

Fornecemos também aos responsáveis pela Administração declaração de que cumprimos com as exigências éticas relevantes, incluindo os requisitos aplicáveis de independência, e comunicamos todos os eventuais relacionamentos ou assuntos que poderiam afetar, consideravelmente, nossa independência, incluindo, quando aplicável, as respectivas salvaguardas.

Dos assuntos que foram objeto de comunicação com a Administração, determinamos aqueles que foram considerados como mais significativos na auditoria das demonstrações financeiras do exercício corrente, e que, dessa maneira constituem os Principais Assuntos de Auditoria. Descrevemos esses assuntos em nosso relatório de auditoria, a menos que lei ou regulamento tenha proibido divulgação pública do assunto, ou quando, em circunstâncias extremamente raras, determinarmos que o assunto não deve ser comunicado em nosso relatório porque as consequências adversas de tal comunicação podem, dentro de uma perspectiva razoável, superar os benefícios da comunicação para o interesse público.

São Paulo, 30 de maio de 2023

KPMG Auditores Independentes Ltda.

CRC 2SP-027685/O-0 F SP

Luciana Liberal Sâmia
Contadora CRC 1SP198502/O-8

KPMG Auditores Independentes Ltda., uma sociedade simples brasileira, de responsabilidade limitada e firma-membro da organização global KPMG de firmas-membro independentes licenciadas da KPMG International Limited, uma empresa inglesa privada de responsabilidade limitada.

KPMG Auditores Independentes Ltda., a Brazilian limited liability company and a member firm of the KPMG global organization of independent member firms affiliated with KPMG International Limited, a private English company limited by guarantee.

Ishares Ibovespa Fundo de Índice

CNPJ nº 10.406.511/0001-61
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
(CNPJ nº 01.522.368/0001-82)

Demonstrativo da composição e diversificação da carteira

Em 31 de março de 2023
(Em milhares de Reais)

Aplicações - Especificação	Espécie/ Forma	Quantidade	Custo Total	Mercado/ realização	% sobre o patrimônio líquido
Disponibilidades				11	0,00
Aplicações Interfinanceiras de Liquidez		34.713		141.825	1,09
Nota do Tesouro Nacional - B		34.713		141.825	1,09
Ações		545.774.233	11.697.656	10.640.891	81,51
Vale S.A.	VALE3	24.130.570	2.004.295	1.937.443	14,84
Itaú Unibanco Holding S.A.	ITUB4	33.900.383	871.489	838.695	6,42
Petróleo Brasileiro S.A. - Petrobras	PETR4	28.189.649	784.649	661.047	5,06
Petróleo Brasileiro S.A. - Petrobras	PETR3	17.394.609	518.499	460.783	3,53
Centrais Elétricas Bras. S.A - Eletrobras	ELET3	13.437.907	539.209	447.214	3,43
Banco Bradesco S.A.	BBDC4	33.206.478	541.382	437.329	3,35
B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão	B3SA3	41.477.203	517.326	429.289	3,29
Banco do Brasil S.A.	BBAS3	9.273.076	345.107	362.670	2,78
Itausa Investimentos Itaú S.A.	ITSA4	37.577.820	342.247	308.890	2,37
Localiza Rent a Car S.A.	RENT3	5.423.859	308.084	289.634	2,22
WEG S.A.	WEGE3	6.737.480	242.737	273.205	2,09
Ambev S.A.	ABEV3	13.991.928	201.052	200.504	1,54
Rede d or Sao Luiz SA	RDOR3	8.256.392	238.701	175.366	1,34
Raia Drogasil S.A.	RADL3	6.839.246	159.147	167.220	1,28
Rumo Logistica Operadora Multimodal S.A.	RAIL3	8.720.225	159.782	164.376	1,26
Equatorial Energia S.A.	EQTL3	5.915.509	155.194	159.482	1,22
BB Seguridade Participações S.A.	BBSE3	4.823.612	148.453	156.816	1,20
Suzano Papel e Celulose S.A	SUZB3	3.174.067	155.915	132.041	1,01
Banco Bradesco S.A.	BBDC3	10.835.878	151.626	128.405	0,98
BTGP Banco	BPAC11	6.506.187	148.069	127.847	0,98
PetroRio	PRIO3	4.030.761	127.310	125.719	0,96
Cia Saneamento Básico Est São Paulo	SBSP3	2.441.699	124.504	123.574	0,95
Cia. Energética de Minas Gerais - CEMIG	CMIG4	10.356.271	117.213	118.476	0,91
Telefônica Brasil S.A	VIVT3	3.031.986	129.924	117.217	0,90
Sendas Distribuidora S.A	ASAI3	7.048.315	121.355	109.531	0,84
Hypermarcas S.A.	HYPE3	2.878.609	120.664	108.524	0,83
Gerdau S.A.	GGBR4	3.674.078	83.968	92.917	0,71
JBS S.A.	JBSS3	5.062.013	127.700	90.357	0,69
Totvs S.A.	TOTS3	3.078.210	90.926	86.682	0,66
Ultrapar Participações S.A.	UGPA3	5.751.700	76.278	80.294	0,62
Cosan S.A. Indústria e Comércio	CSAN3	5.178.520	87.579	78.144	0,60
EMBRAER - Empresa Bras de Aeronáutica S.A.	EMBR3	3.747.120	58.391	77.903	0,60
Lojas Renner S.A.	LREN3	4.630.567	103.291	76.728	0,59
Cia Paranaense de Energia - COPEL	CPLE6	10.643.832	77.195	73.868	0,57
Centrais Elétricas Bras. S.A - Eletrobras	ELET6	1.978.672	81.061	71.786	0,55
Magazine Luiza S.A.	MGLU3	20.640.656	83.046	68.321	0,52
Eneva S.A.	ENEV3	5.549.976	68.767	58.108	0,45
Metalúrgica Gerdau S.A.	GOAU4	4.790.067	58.291	56.666	0,43
Klabin S.A.	KLBN11	3.094.209	63.084	55.974	0,43
Engie Brasil Energia S.A.	EGIE3	1.341.729	53.851	53.897	0,41
Hapvida Participacoes E Investimentos SA	HAPV3	19.580.851	119.586	51.302	0,39
Bradespar S.A.	BRAP4	1.786.743	50.726	47.920	0,37
Banco Santander (Brasil) S.A.	SANB11	1.757.904	51.509	47.112	0,36
Energisa S.A.	ENGI11	1.126.328	48.175	45.256	0,35
Atacadão S.A.	CRFB3	3.623.718	59.554	44.898	0,34
Vibra Energia S.A.	VBBR3	3.062.662	51.316	44.133	0,34
Tim SA	TIMS3	3.484.059	44.198	43.829	0,34
Multiplan - Empreendimentos Imobiliarios S.A.	MULT3	1.676.633	40.118	41.312	0,32
Cia. Siderúrgica Nacional	CSNA3	2.603.820	44.408	40.203	0,31
BRF - Brasil Foods S.A.	BRFS3	6.429.886	67.170	39.930	0,31
CCR S.A.	CCRO3	2.634.838	32.062	33.726	0,26
Braskem S.A.	BRKM5	1.633.635	46.953	31.627	0,24
SCL Agrícola S.A.	SLCE3	689.989	33.378	31.457	0,24
Aliansce Sonae Shopping Centers	ALSO3	1.776.681	35.247	31.270	0,24
Natura Cosméticos S.A.	NTCO3	2.307.969	36.369	30.465	0,23
Arezzo Indústria e Comércio S.A.	ARZZ3	431.331	35.788	27.394	0,21
3R Petroleum Oleo e Gas S.A.	RRRP3	852.234	31.993	25.115	0,19
CSN Mineração S.A.	CMIN3	4.985.291	23.095	24.129	0,18
Cielo S.A.	CIEL3	4.880.590	22.453	23.671	0,18

Ishares Ibovespa Fundo de Índice

CNPJ nº 10.406.511/0001-61
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
(CNPJ nº 01.522.368/0001-82)

Demonstrativo da composição e diversificação da carteira

Em 31 de março de 2023
(Em milhares de Reais)

Aplicações - Especificação	Espécie/ Forma	Quantidade	Custo Total	Mercado/ realização	% sobre o patrimônio líquido
Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	TAEE11	666.565	24.476	23.216	0,18
Cyrela Brazil Realty S.A. - Empeend. e Part.	CYRE3	1.588.832	23.757	22.371	0,17
São Martinho S.A.	SMTO3	808.492	21.632	21.845	0,17
Fleury S.A.	FLRY3	1.477.398	22.957	21.452	0,16
Grupo de Moda SOMA S.A.	SOMA3	2.621.350	28.258	21.259	0,16
Usinas Siderúrgicas de Minas Gerais S.A.-USIMINAS	USIM5	2.804.862	24.648	20.447	0,16
Minerva S.A.	BEEF3	1.846.476	23.355	19.462	0,15
CPFL Energia S.A.	CPFE3	598.908	19.159	18.955	0,15
Iguatemi S.A.	IGTI11	928.454	18.060	17.910	0,14
Azul S.A.	AZUL4	1.296.249	17.796	15.594	0,12
EDP - Energias do Brasil S.A.	ENBR3	677.127	14.445	15.127	0,12
Cogna Educação S.A.	COGN3	8.044.287	18.846	15.043	0,12
São Paulo Alpargatas S.A.	ALPA4	1.443.438	23.359	11.764	0,09
Via S.A,	VIIA3	5.831.756	15.141	10.964	0,08
Banco Panamericano S.A.	BPAN4	2.077.863	14.137	10.597	0,08
Locaweb Serviços	LWSA3	2.142.157	15.141	10.261	0,08
Ecorodovias Infraestrutura e Logística S.A.	ECOR3	1.913.651	10.326	9.913	0,08
Raízen S.A.	RAIZ4	3.469.275	12.817	9.887	0,08
Pet Center Comércio e Participações S.A.	PETZ3	1.530.925	13.882	9.492	0,07
Estácio Participações S.A.	YDUQ3	1.246.292	14.633	8.786	0,07
EZTEC Empreendimentos e Participações S.A.	EZTC3	494.371	7.633	6.021	0,05
Companhia Brasileira de Distribuição S.A.	PCAR3	399.548	7.361	5.885	0,05
Qualicorp S.A.	QUAL3	1.536.550	12.555	5.655	0,04
MRV Engenharia e Participacoes S.A.	MRVE3	784.508	6.420	5.005	0,04
Marfrig Alimentos S.A	MRFG3	726.707	7.700	4.825	0,04
Dexco S.A.	DXCO3	756.360	6.774	4.447	0,03
Meliuz SA	CASH3	3.000.595	3.987	3.031	0,02
CVC Brasil ON	CVCB3	752.455	4.776	2.340	0,02
Gol Linhas Aéreas Inteligentes S.A.	GOLL4	198.359	1.849	1.325	0,01
Localiza Rent a Car S.A.	RENT1	24.193	318	318	0,00
Direito por Ações em empréstimo				2.221.310	17,01
Ambev S.A.	ABEV3			251.010	1,92
Petróleo Brasileiro S.A. - Petrobras	PETR3			202.239	1,55
Gerdau S.A.	GGBR4			115.568	0,89
WEG S.A.	WEGE3			110.775	0,85
Petróleo Brasileiro S.A. - Petrobras	PETR4			107.958	0,83
Suzano Papel e Celulose S.A	SUZB3			85.097	0,65
Vibra Energia S.A.	VBBR3			71.194	0,55
PetroRio	PRIO3			62.243	0,48
Eneva S.A.	ENEV3			60.461	0,46
CCR S.A.	CCRO3			58.090	0,44
JBS S.A.	JBSS3			55.136	0,42
Equatorial Energia S.A.	EQTL3			53.591	0,41
Banco Bradesco S.A.	BBDC4			50.327	0,39
Natura Cosméticos S.A.	NTCO3			48.782	0,37
Cosan S.A. Indústria e Comércio	CSAN3			48.762	0,37
BTGP Banco	BPAC11			45.086	0,35
Raia Drogasil S.A.	RADL3			42.825	0,33
Lojas Renner S.A.	LREN3			38.166	0,29
Banco do Brasil S.A.	BBAS3			36.363	0,28
Klabin S.A.	KLBN11			35.214	0,27
Hapvida Participacoes E Investimentos SA	HAPV3			32.541	0,25
EMBRAER - Empresa Bras de Aeronáutica S.A.	EMBR3			31.780	0,24
Transmissora Aliança de Energia Elétrica S.A.	TAEE11			31.439	0,24
Tim SA	TIMS3			29.214	0,22
Ultrapar Participações S.A.	UGPA3			28.809	0,22
Energisa S.A.	ENGI11			26.443	0,20
Cia. Siderúrgica Nacional	CSNA3			25.175	0,19
EDP - Energias do Brasil S.A.	ENBR3			24.299	0,19
CPFL Energia S.A.	CPFE3			23.669	0,18
Sendas Distribuidora S.A	ASAI3			23.329	0,18
Banco Santander (Brasil) S.A.	SANB11			21.371	0,16
Vale S.A.	VALE3			19.979	0,15
Engie Brasil Energia S.A.	EGIE3			19.733	0,15

Ishares Ibovespa Fundo de Índice

CNPJ nº 10.406.511/0001-61
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
(CNPJ nº 01.522.368/0001-82)

Demonstrativo da composição e diversificação da carteira

Em 31 de março de 2023
(Em milhares de Reais)

Aplicações - Especificação	Espécie/ Forma	Quantidade	Custo Total	Mercado/ realização	% sobre o patrimônio líquido
Totvs S.A.	TOTS3			18.628	0,14
3R Petroleum Oleo e Gas S.A.	RRRP3			16.358	0,13
Fleury S.A.	FLRY3			15.176	0,12
Raízen S.A.	RAIZ4			14.587	0,11
Cielo S.A.	CIEL3			14.435	0,11
CSN Mineração S.A.	CMIN3			14.414	0,11
Itaú Unibanco Holding S.A.	ITUB4			14.374	0,11
Azul S.A.	AZUL4			12.662	0,10
Iguatemi S.A.	IGTI11			11.608	0,09
Aliansce Sonae Shopping Centers	ALSO3			11.172	0,09
Companhia Brasileira de Distribuição S.A.	PCAR3			10.717	0,08
Via S.A,	VIIA3			10.260	0,08
Marfrig Alimentos S.A	MRFG3			10.184	0,08
B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão	B3SA3			9.371	0,07
Cogna Educação S.A.	COGN3			9.323	0,07
MRV Engenharia e Participacoes S.A.	MRVE3			8.917	0,07
Localiza Rent a Car S.A.	RENT3			8.276	0,06
BRF - Brasil Foods S.A.	BRFS3			8.052	0,06
Gol Linhas Aéreas Inteligentes S.A.	GOLL4			7.648	0,06
Grupo de Moda SOMA S.A.	SOMA3			7.255	0,06
Dexco S.A.	DXCO3			7.052	0,05
Usinas Siderúrgicas de Minas Gerais S.A.-USIMINAS	USIM5			6.428	0,05
Estácio Participações S.A.	YDUQ3			6.115	0,05
Multiplan - Empreendimentos Imobiliarios S.A.	MULT3			6.111	0,05
São Martinho S.A.	SMTO3			5.871	0,04
Pet Center Comércio e Participações S.A.	PETZ3			5.376	0,04
Cyrela Brazil Realty S.A. - Empeend. e Part.	CYRE3			5.280	0,04
Braskem S.A.	BRKM5			5.188	0,04
Locaweb Serviços	LWSA3			4.107	0,03
Cia Paranaense de Energia - COPEL	CPLE6			4.049	0,03
CVC Brasil ON	CVCB3			3.712	0,03
Atacadão S.A.	CRFB3			2.107	0,02
EZTEC Empreendimentos e Participações S.A.	EZTC3			2.082	0,02
Banco Panamericano S.A.	BPAN4			1.803	0,01
Meliuz SA	CASH3			1.626	0,01
Qualicorp S.A.	QUAL3			1.542	0,01
Ecorodovias Infraestrutura e Logística S.A.	ECOR3			1.509	0,01
Bradespar S.A.	BRAP4			392	0,00
Telefônica Brasil S.A	VIVT3			247	0,00
Arezzo Indústria e Comércio S.A.	ARZZ3			243	0,00
Rumo Logistica Operadora Multimodal S.A.	RAIL3			184	0,00
Minerva S.A.	BEEF3			165	0,00
Itausa Investimentos Itaú S.A.	ITSA4			24	0,00
Localiza Rent a Car S.A.	RENT1			9	0,00
Instrumentos financeiros derivativos				(3.713)	(0,03)
Mercado Futuro - ajuste a pagar				(3.713)	(0,03)
Valores a receber				627.436	4,81
Valores a pagar				(572.463)	(4,38)
Patrimônio líquido				13.055.296	100,00

As notas explicativas são parte integrante das demonstrações financeiras.

Ishares Ibovespa Fundo de Índice

CNPJ nº 10.406.511/0001-61
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
(CNPJ nº 01.522.368/0001-82)

Demonstrações das evoluções do patrimônio líquido

Exercícios findos em 31 de março de 2023 e 2022
(Em milhares de Reais, exceto o valor da unitário das cotas)

	2023	2022
Patrimônio líquido no início dos exercícios		
Total de 137.500.000,000 cotas a R$ 115,576429 cada uma	15.891.759	
Total de 131.550.000,000 cotas a R$ 112,226796 cada uma		14.763.435
Cotas emitidas nos exercícios		
228.650.000,00 cotas	23.793.143	
192.648.817,99 cotas		21.071.409
Cotas resgatadas nos exercícios		
233.750.000,000 cotas	(24.541.413)	
186.698.817,988 cotas		(20.192.909)
Variação no resgate de cotas	203.867	(646.926)
Patrimônio líquido antes do resultado dos exercícios	15.347.356	14.995.009
Composição do resultado dos exercícios		
Ações	(2.200.541)	917.252
Desvalorização/valorização a preço de mercado	(3.189.876)	(69.850)
Resultado nas negociações	17.702	19.614
Dividendos e juros sobre capital próprio	1.432.083	1.156.562
Resultado com empréstimos de ações	(460.450)	(189.074)
Renda fixa e outros títulos e valores mobiliários	20.114	9.298
Rendas de aplicações interfinanceiras de liquidez	20.114	9.298
Demais receitas	362.672	243.679
Ganhos com derivativos	362.672	243.679
Demais despesas	(474.305)	(273.479)
Perdas com derivativos	(452.235)	(238.254)
Remuneração da administração	(12.420)	(24.284)
Corretagens e emolumentos	(5.794)	(6.864)
Auditoria e custódia	(1.792)	(1.868)
Taxa de fiscalização	(53)	(52)
Despesas diversas	(2.011)	(2.157)
Total do resultado dos exercícios	(2.292.060)	896.750
Patrimônio líquido no final dos exercícios		
Total de 132.400.000,000 cotas a R$ 98,604953 cada uma	**13.055.296**	
Total de 137.500.000,000 cotas a R$ 115,576429 cada uma		**15.891.759**

As notas explicativas são partes integrantes das demonstrações financeiras.

Ishares Ibovespa Fundo de Índice
CNPJ nº 10.406.511/0001-61
(Administrado pelo Banco BNP Paribas Brasil S.A.)
(CNPJ nº 01.522.368/0001-82)

Notas explicativas às demonstrações financeiras
Exercícios findos em 31 de março de 2023 e 2022
(Em milhares de Reais, exceto o valor unitário das cotas)

1 Contexto operacional

O Ishares Ibovespa Fundo de Índice ("Fundo") foi constituído em 19 de novembro de 2008 e iniciou suas atividades em 28 de novembro de 2008, sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração, destinado a pessoas físicas, pessoas jurídicas, fundos de investimento, fundos de pensão e entidades seguradoras, investidores locais ou não residentes devidamente autorizados a adquirir cotas do Fundo pela respectiva legislação aplicável de sua jurisdição, incluindo, sem limitação, coligadas da administradora e do gestor, que aceitem todos os riscos inerentes ao investimento no Fundo e busquem retorno de rentabilidade condizente com o objetivo do Fundo que é o de buscar retornos de investimento que correspondam de forma geral à performance, antes de taxas e despesas, do índice Ibovespa.

Não obstante a diligência da administradora no gerenciamento dos recursos do Fundo, a política de investimento coloca em risco o patrimônio deste, pelas características dos papéis que o compõem, os quais sujeitam às oscilações do mercado e aos riscos de crédito inerentes a tais investimentos, podendo, inclusive, o valor das cotas do Fundo detidas por qualquer cotista, poderá a qualquer tempo, ser inferior ao valor originalmente pago por suas cotas.

Os investimentos do Fundo estão sujeitos a flutuações do mercado e a riscos de crédito, existindo a possibilidade de realização de operações que coloquem em risco o patrimônio líquido do Fundo, podendo ocorrer variações negativas no valor da cota e perda do capital.

Os investimentos em fundos não são garantidos pelo Administrador ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo Fundo Garantidor de Créditos - FGC.

2 Apresentação e elaboração das demonstrações financeiras

As demonstrações financeiras foram elaboradas de acordo com as práticas contábeis aplicáveis aos fundos de investimento, complementadas pelas normas previstas no Plano Contábil dos Fundos de Investimento (COFI) e pelas orientações emanadas da Comissão de Valores Mobiliários (CVM), especialmente pela Instrução CVM n° 359/02 e alterações posteriores.

Na elaboração dessas demonstrações financeiras foram utilizadas premissas e estimativas de preços para a contabilização e determinação dos valores dos ativos e instrumentos financeiros integrantes da carteira do Fundo. Desta forma, quando da efetiva liquidação financeira desses ativos e instrumentos financeiros, os resultados auferidos poderão ser diferentes dos estimados.

3 Descrição das principais práticas contábeis

Entre as principais práticas contábeis adotadas destacam-se:

a. Receitas e despesas

As receitas e despesas são reconhecidas de acordo com o regime de competência.

b. Aplicações interfinanceiras de liquidez

As operações compromissadas são registradas pelo valor efetivamente pago e atualizadas diariamente pelo rendimento auferido com base no indexador e prazo negociado, são reconhecidas como resultado e registradas na rubrica "Renda fixa e outros títulos e valores mobiliários".

c. Ações

As ações integrantes da carteira são valorizadas pela cotação de fechamento do último dia em que foram negociadas em bolsas de valores. Na hipótese de não divulgação dos preços ou da inexistência de negócios no dia em questão, serão utilizados os preços do dia imediatamente anterior ou os preços da última data em que tiverem sido registrados negócios com a ação. São reconhecidas como resultado e registrados na rubrica "Ações".

d. Bonificações

As bonificações em ações são registradas na carteira de títulos apenas pelas respectivas quantidades, sem modificação do valor dos investimentos, quando as ações correspondentes são consideradas "ex-direito" na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão. Os ganhos provenientes das bonificações são registrados na rubrica "Dividendos e juros sobre capital próprio".

e. Dividendos e juros sobre capital próprio

São contabilizados em receita quando as ações correspondentes são consideradas "ex-direito" na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão. Os ganhos provenientes dos dividendos e juros de capital são registrados na rubrica "Dividendos e juros sobre capital próprio".

f. Corretagens

As despesas de corretagens em operações de compra de ações são consideradas parte integrante do custo de aquisição. Na venda são registradas como despesa, na rubrica "Corretagens e emolumentos".

g. Direitos/Obrigações por empréstimo de ações

As ações doadas e tomadas por empréstimos são valorizadas pela cotação de fechamento do último dia em que foram negociadas em bolsas de valores e a comissão sobre essas operações é apropriada "pro rata" sendo registrada na rubrica "Resultado com empréstimos de ações".

h. Instrumentos financeiros derivativos

i. **Operações de futuro -** Os ajustes diários, positivos e negativos, das operações no mercado futuro são apropriados ao resultado e registrados na rubrica "Ganhos/Perdas com derivativos".

4 Títulos e valores mobiliários

O critério de precificação das ações considera os preços de fechamento divulgados pela B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

O Fundo mantém em sua carteira, em 31 de março de 2023, ações e empréstimo de ações classificados como "Títulos para negociação" no valor total de R$ 10.640.891 e R$ 2.221.310, respectivamente.

O resultado com ações está apresentado na demonstração da evolução do patrimônio líquido na rubrica "Ações – desvalorização/valorização a preço de mercado" e "Ações - resultados nas negociações", cujos ganhos deduzidos das perdas no exercício findo em 31 de março de 2023 totalizam R$ 3.172.174 negativo (no exercício findo em 31 de março de 2022 totalizaram R$ 50.236 negativo).

Os juros contratuais das operações de empréstimos de ações foram registrados com base na taxa de remuneração contratual e em virtude dos prazos e vencimentos dos contratos juntamente com a valorização/desvalorização de empréstimo de ações, e está apresentado na demonstração da evolução do patrimônio líquido na rubrica "Ações – resultado com empréstimos de ações", no exercício findo em 31 de março de 2023 totalizaram R$ 460.450 negativo (no exercício findo em 31 de março de 2022 totalizaram R$ 189.074 negativo).

O resultado com dividendos está apresentado na demonstração da evolução do patrimônio líquido em "Ações - dividendos e juros sobre capital próprio", no exercício findo em 31 de março de 2023 totaliza R$ 1.432.083 (no exercício findo em 31 de março de 2022 totalizou R$ 1.156.562 positivo).

5 Instrumentos financeiros derivativos

O Fundo poderá realizar operações com derivativos executadas em bolsas de valores, em bolsas de mercadorias e futuros ou em mercados de balcão organizados, contanto que tais operações com derivativos sejam realizadas unicamente com o propósito de administrar os riscos inerentes à carteira do Fundo ou dos valores mobiliários que a integrem, observados os limites de diversificação e de composição da carteira dispostos no regulamento do Fundo.

As operações foram realizadas em bolsa, e seus valores assim como seus prazos de vencimento, estão demonstrados conforme segue:

a. Composição da carteira

Futuros

	Quantidade de contratos					
Indexador	**Compra**	**Venda**	**Posição líquida**	**Valor do ajuste**	**Valor de referência**	**Faixas de vencimento**
FUT WIN	9.224	-	9.224	(3.713)	188.406	Até 1 ano
Total	9.224	-	9.224	(3.713)	188.406	

O ajuste de futuro apresentado no demonstrativo da composição e diversificação da carteira nas rubricas “Instrumentos Financeiros Derivativos”.

Mercado futuro - As operações no mercado futuro são ajustadas a mercado conforme ajuste proveniente da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão.

No exercício findo em 31 de março de 2023, as operações com Mercado Futuro geraram resultado líquido negativo de R$ 89.563 (no exercício findo em 31 de março de 2022 de R$ 5.425 positivo).

6 Gerenciamento de riscos

O administrador e a gestora possuem Comitês de Risco por meio dos quais é definida uma carteira-modelo para os objetivos de *performance*, política de investimento e política de administração de risco do Fundo, conforme segue:

Risco de Mercado: o valor dos ativos que integram a carteira pode variar em função de oscilações nas taxas de juros, taxas de câmbio, preços e cotações de mercado, bem como em razão de quaisquer alterações nas condições econômicas e/ou políticas, nacionais e internacionais. Tais fatos podem afetar negativamente os preços dos ativos integrantes da carteira, resultando, inclusive, na depreciação do valor da cota do Fundo, com perdas patrimoniais aos cotistas;

Risco de Crédito: o inadimplemento ou atraso no pagamento de juros ou principal pelos emissores dos ativos integrantes da carteira ou pelas contrapartes das operações do Fundo, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial de tais emissores e/ou contrapartes, pode ocasionar a redução de ganhos ou mesmo perdas financeiras ao Fundo e aos seus cotistas. Adicionalmente, pode haver custos adicionais nas hipóteses em que o Fundo tente recuperar seus créditos por meio de ações judiciais, acordos extrajudiciais ou outros. O Fundo está sujeito a risco de perda substancial de seu patrimônio líquido nos casos dos eventos ora indicados;

Risco de liquidez - a possibilidade de redução ou mesmo inexistência de demanda pelos ativos e modalidades operacionais integrantes da carteira podem fazer com que o Fundo não esteja apto a realizar pagamentos de resgate de suas cotas conforme previsto em seus respectivos regulamentos, inclusive em decorrência de dificuldades para liquidar posições ou negociar tais ativos pelo preço e no tempo desejados;

Risco de derivativos - a utilização de instrumentos de derivativos pelo Fundo, tanto para proteção quanto para alavancagem, arbitragem e/ou posicionamento em estratégias, pode aumentar a volatilidade do Fundo, limitar as possibilidades de retorno nas suas operações, não produzir os efeitos desejados e/ou provocar significativas perdas patrimoniais ao Fundo, bem como perdas superiores ao capital aplicado pelos cotistas, o que resultará na obrigatoriedade de aporte de recursos adicionais pelos cotistas no caso de patrimônio líquido negativo, para cobrir os prejuízos do Fundo, em valor proporcional ao número de cotas por eles detidas, mediante solicitação do Administrador;

Risco para ativos registrados na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão ("B3") - a guarda da documentação física original representativa dos ativos financeiros e eventuais garantias a eles vinculadas é de responsabilidade do participante registrador do ativo financeiro na B3, o que pode limitar o acesso do Fundo à referida documentação, podendo dificultar ou retardar eventuais

procedimentos de cobrança decorrentes de inadimplência no pagamento dos referidos ativos financeiros por seus respectivos devedores, podendo acarretar em perdas ao Fundo, e consequentemente, aos seus cotistas. Adicionalmente, eventos que fogem ao controle do Administrador, do Custodiante ou do participante registrador na B3, tais como, mas não se limitando a, incêndio, inundação ou outros eventos de força maior, poderão causar a perda dos documentos originais e consequentemente gerar perdas ao Fundo e aos seus cotistas; e

Riscos gerais - eventual interferência de órgãos reguladores no mercado, mudanças na legislação e regulamentação aplicáveis aos fundos de investimento, decretação de moratória, fechamento parcial ou total dos mercados, alteração nas políticas monetária e cambial, dentre outros eventos, podem impactar as condições de funcionamento do Fundo, bem como seu respectivo desempenho.

Desde o início de janeiro de 2020, o surto de coronavírus, que é uma situação em rápida evolução, impactou adversamente as atividades econômicas globais. O rápido desenvolvimento e fluidez dessa situação impedem qualquer previsão como seu impacto final. Adicionalmente, certas ações da Organização dos Países Exportadores de Petróleo e a Rússia também trouxeram aumento na volatilidade nos mercados financeiros e de capitais. Estes eventos podem ter um impacto adverso contínuo nas condições econômicas e de mercado e desencadear um período de desaceleração econômica global, o que poderia trazer reflexos na precificação subsequente da carteira do Fundo, cuja a quota vem sendo divulgada diariamente ao mercado. A Administradora não acredita que haja impacto financeiro nas demonstrações financeiras em 31 de março de 2020, como resultado destes eventos, e segue monitorando os desenvolvimentos relacionados ao coronavírus e coordenando sua resposta operacional com base nos planos de continuidade de negócios existentes e nas orientações de organizações globais de saúde, governos relevantes e melhores práticas gerais de resposta à pandemia.

Política de administração de risco

O processo de avaliação e monitoramento do risco consiste em:

- Além do controle de posição, o risco é controlado por meio de *tracking error* na carteira do Fundo visando manter o máximo de aderência ao Índice do Fundo (Benchmark previsto). Não há limites de VaR e *stress* para este tipo de Fundo.

- Definir parâmetros para avaliar se as perdas estimadas estão de acordo com o perfil do Fundo, se agressivo ou conservador.

A política de administração de risco do Fundo compreende ainda: (i) discussão, definição e verificação do cumprimento das estratégias de investimento; (ii) monitoramento do desempenho do Fundo e (iii) verificação do cumprimento das normas e restrições aplicáveis à administração e gestão do Fundo."

Análise de sensibilidade

Em 31 de março de 2023, a análise de sensibilidade foi efetuada a partir do cenário elaborado abaixo:

Patrimônio Líquido:	13.055.295.727,63
Var *% PL	13,2099140184%
Var Financeiro	1.724.593.340,46

Valores em Reais

A mensuração dos riscos de mercado tem por objetivo a avaliação das perdas possíveis com as variações de preços e taxas de mercado. O método Value at Risk – Var, representa a perda máxima esperada para 21 dias considerando intervalo de 95% de confiança. Essa metodologia assume que os retornos dos ativos são relacionados linearmente com os retornos dos fatores de riscos e que o os fatores de riscos são aproximadamente normalmente distribuídos. Essas aproximações podem subestimar as perdas futuras decorrentes do aumento futuro da volatilidade dos ativos pois representam as condições atuais de mercado.

7 Emissões e resgates de cotas

As cotas são nominativas, intransferíveis e mantidas em conta de depósito em nome de seus titulares.

Para fins de integralização e resgate de cotas, a administradora utiliza o valor patrimonial das cotas apurado no encerramento do dia de pregão em que a respectiva solicitação foi processada. As operações de integralização e de resgate são liquidadas no prazo estipulado para liquidação de operações na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

As cotas são emitidas e resgatadas somente em lotes mínimos de cotas ou em múltiplos de lotes mínimos de cotas. Entende-se por lote mínimo 50.000 cotas, a ser emitido nos termos de uma Ordem de Integralização ou Ordem de Resgate devidamente apresentada por um agente autorizado. Os lotes mínimos de cotas somente podem ser resgatados mediante uma ordem de resgate devidamente submetida por um agente autorizado e mediante a entrega de uma Cesta pelo Fundo.

"Cesta" corresponde a lotes mínimos de cotas composta de ações do índice, investimentos permitidos, valores em dinheiro ou direitos sobre ações. A composição da "Cesta", seja para fins de uma ordem de integralização ou de uma ordem de resgate, obedecerá às seguintes regras:

(a) No mínimo 95% do seu valor representado por ações do índice, em qualquer proporção;
(b) No máximo 5% do seu valor representado por investimentos permitidos e ou valores em dinheiro.

Durante o período compreendido entre os cinco dias úteis anteriores e os cinco dias úteis posteriores a data de rebalanceamento do índice a gestora pode a seu exclusivo critério instruir a administradora a adotar os procedimentos especiais previstos no regulamento do Fundo, tais como, suspensão das integralizações de cotas e limitações de resgates.

8 Remuneração da Administração

Pela prestação dos serviços de administração do Fundo, que incluem a gestão da carteira, as atividades de tesouraria e de controle e processamento dos títulos e valores mobiliários e de escrituração, o Fundo paga 0,10% (zero vírgula dez por cento) ao ano, incidente sobre o patrimônio líquido, referente à remuneração global paga mensalmente pelo Fundo.

A taxa de administração será provisionada diariamente, com base em um total de 252 (duzentos e cinquenta e dois) dias úteis por ano, e paga mensalmente até o 5º (quinto) dia útil do mês subsequente à sua vigência. No último dia útil de cada mês, a administradora fará a apuração do valor total das receitas decorrentes das operações de empréstimo de ações realizadas pelo Fundo provisionadas durante o mês em questão em "Receitas de empréstimos". Na hipótese das receitas de empréstimos na data de apuração serem inferiores a 0,1% ao ano calculadas sobre patrimônio líquido médio do mês em questão correspondente a diferença entre as receitas de empréstimos e o percentual de 0,1% do patrimônio líquido. A devolução da taxa de administração é efetuada, quando aplicável, no primeiro dia útil do mês subsequente, e não configura para quais quer fins, uma redução da taxa de administração.

A despesa correspondente no exercício findo em 31 de março de 2023 foi no montante de R$ 12.420 (no exercício findo em 31 de março de 2022 foi no montante de R$ 24.284), está apresentada na demonstração da evolução do patrimônio líquido em "Demais despesas - remuneração da administração".

9 Serviços de gestão e custódia e controladoria

A gestão da carteira do Fundo é realizada pela BlackRock Brasil Gestora de Investimentos Ltda.

As operações compromissadas lastreadas em títulos públicos são registradas no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC), os instrumentos financeiros derivativos, as ações e os empréstimos de ações na B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

Os serviços de tesouraria, custódia e controladoria dos títulos e valores mobiliários e demais ativos financeiros do Fundo e escrituração da emissão e resgate de cotas do Fundo são realizados pelo próprio Administrador. Os serviços de distribuição do Fundo são contratados pelo Administrador agentes autorizados.

A despesa com taxa de custódia no exercício findo em 31 de março de 2023 foi no montante de R$ 1.782 (no exercício findo em 31 de março de 2022 foi no montante de R$ 1.648) está apresentada na demonstração da evolução do patrimônio líquido em "Demais despesas – Auditoria e custódia".

10 Informações sobre transações com partes relacionadas

Segue demonstrado abaixo as transações que o Fundo realizou com partes relacionadas:

a. **Operações compromissadas realizadas com o Banco BNP Paribas Brasil S.A.:**

Mês/Ano	Operações compromissadas realizadas com partes relacionadas / total de operações compromissadas	Volume médio diário / Patrimônio médio diário do fundo	Taxa Média contratada / Taxa SELIC
abr/22	1,0000	0,0083	0,9974
mai/22	1,0000	0,0098	0,9988
jun/22	1,0000	0,0090	0,9990
jul/22	0,7138	0,0079	0,9977
ago/22	0,8529	0,0091	1,0003
set/22	0,9696	0,0119	0,9978
out/22	0,9469	0,0080	0,9978
nov/22	1,0000	0,0087	0,9978
dez/22	0,9329	0,0131	0,9978
jan/23	1,0000	0,0154	0,9978
fev/23	1,0000	0,0186	0,9978
mar/23	1,0000	0,0148	0,9978

b. **Outras transações com partes relacionadas:**

	Contraparte	Natureza	R$ Mil
Disponibilidades	Banco BNP Paribas Brasil S/A	Administrador	11

	Contraparte	Natureza	R$ Mil
Despesa Taxa de Custódia	Banco BNP Paribas Brasil S/A	Administrador	(1.782)
Despesa Taxa de Administração	Banco BNP Paribas Brasil S/A	Administrador	(4.580)
Despesa Taxa de Gestão	BlackRock Brasil Gestora de Investimentos Ltda	Gestor	(7.840)

11 Legislação tributária

a. Fundo

Os rendimentos e ganhos auferidos com operações realizadas pela carteira do Fundo não estão sujeitos ao imposto de renda nem ao IOF.

b. Cotista

i. Imposto de renda - De acordo com a lei n° 11.033/04, os rendimentos estão sujeitos ao imposto de renda na fonte a alíquota de 15%, retido exclusivamente no resgate de cotas.

ii. IOF - Em conformidade com o decreto nº 6.306, de 14 de dezembro de 2007, os resgates de cotas, quando efetuados em prazo inferior a 30 dias, estavam sujeitos ao IOF, mediante alíquota regressiva. Após 30 dias não havia incidência de IOF.

12 Política de distribuição dos resultados

Os resultados auferidos são incorporados ao patrimônio com a correspondente variação no valor das cotas, de maneira que todos os seus condôminos participem proporcionalmente à quantidade de cotas possuídas.

13 Política de divulgação das informações

O Administrador colocará à disposição dos interessados, na sede do Administrador, as seguintes informações:

- Diariamente, o valor da cota e do patrimônio líquido do Fundo;
- Mensalmente, até 15 dias após o encerramento do mês a que se referir o balancete, demonstrativo de composição e diversificação da carteira e informações relativas ao perfil mensal;
- Anualmente, no prazo de até 60 dias contados a partir do encerramento do exercício a que se referirem as demonstrações financeiras acompanhadas do parecer do auditor independente.

O Fundo tem uma página eletrônica na rede mundial de computadores, no site www.blackrock.com/br que contém as informações exigidas pelo artigo 39 da Instrução CVM nº 359/02.

O cotista pode acessar a Ouvidoria pelo telefone – 0800-7715999 ou através do e-mail: ouvidoria@br.bnpparibas.com. O horário de funcionamento da Ouvidoria é de segunda-feira à sexta-feira, das 09h00 às 18h00, outros canais de duvidas com o Client Desk pelo telefone – (11) 3841-3157 ou (11) 3841-3168 ou através do e-mail: atendimentoafs@br.bnpparibas.com e brasil@blackrock.com, ou no site www.blackrock.com/br.

14 Rentabilidade

A rentabilidade mensal proporcionada pelo Fundo e o valor nominal da cota no exercício foram os seguintes:

			Rentabilidade em %		Benchmak - Ibovespa	
Data	Patrimônio Líquido Médio Mensal - R$	Valor da Cota - R$	Variação Mensal	Variação Acumulada	Variação Mensal	Variação Acumulada
31/03/2022	16.221.416	115,576429	-	-	-	-
29/04/2022	15.167.545	103,921567	(10,08)	(10,08)	(10,10)	(10,10)
31/05/2022	13.458.024	107,344815	3,29	(7,12)	3,22	(7,21)
30/06/2022	14.951.274	95,075879	(11,43)	(17,74)	(11,50)	(17,88)
29/07/2022	13.912.125	99,545329	4,70	(13,87)	4,69	(14,03)
31/08/2022	14.117.404	105,722403	6,21	(8,53)	6,16	(8,73)
30/09/2022	14.881.576	106,215363	0,47	(8,10)	0,47	(8,30)
31/10/2022	15.550.067	112,005678	5,45	(3,09)	5,45	(3,30)
30/11/2022	15.497.462	108,645653	(3,00)	(6,00)	(3,06)	(6,26)
30/12/2022	15.250.621	106,078169	(2,36)	(8,22)	(2,45)	(8,55)
31/01/2023	13.952.844	109,717265	3,43	(5,07)	3,37	(5,47)
28/02/2023	12.599.725	101,514935	(7,48)	(12,17)	(7,49)	(12,56)
31/03/2023	13.484.929	98,604953	(2,87)	(14,68)	(2,91)	(15,10)

A rentabilidade obtida no passado não representa a garantia de resultados futuros.

A rentabilidade nos exercícios foram as seguintes:

Data	Patrimônio líquido médio dos exercícios – R$	Rentabilidade (%)	Rentabilidade Índice (%)
Exercício findo em 31 de março de 2023	14.396.745	(14,68)	(15,10)
Exercício findo em 31 de março de 2022	15.266.578	2,98	2,89

15 Demandas judiciais

Não há registro de demandas judiciais ou extrajudiciais, quer na defesa dos direitos dos cotistas, quer desses contra a administração do Fundo.

16 Política de empréstimo de ações

As ações da carteira podem ser emprestadas aos cotistas para fins de voto em Assembleia Geral de Acionistas. A solicitação de empréstimo de ações somente pode ser feita após a convocação da Assembleia Geral do respectivo emissor e deve ser comunicada a administradora por intermédio de um agente autorizado no mínimo de cinco dias e no máximo de seis dias de pregão de antecedência à realização da Assembleia Geral de Acionistas. O empréstimo é isento de taxa de aluguel sendo assim o cotista arca somente com os custos operacionais.

A Administradora pode, durante os cinco primeiros dias do período de rebalanceamento, rejeitar ou limitar empréstimos de ações da carteira, desde que tal restrição se limite à parcela de ações da carteira cujo empréstimo poderia, a critério do gestor, vir a causar danos significativos na capacidade do Fundo de atingir seu objetivo de investimento.

17 Outros assuntos

A Comissão de Valores Mobiliários (CVM) publicou em 23 de dezembro de 2022 a Resolução CVM nº 175, que dispõe sobre a constituição, o funcionamento e a divulgação de informações dos fundos de investimento, bem como sobre a prestação de serviços, em substituição à Instrução CVM nº 555. As modificações introduzidas pela Resolução CVM nº 175, deveriam entrar em vigor a partir de 3 de abril de 2023. Porém, O Colegiado da Comissão de Valores Mobiliários (CVM) aprovou, em reunião na data de 28 de março de 2023, a Resolução CVM 181, que promove alterações pontuais e prorroga o início de vigência da Resolução CVM 175 (novo marco regulatório dos fundos de investimento) para 2/10/2023, sendo que os fundos de investimento em funcionamento têm até 31 de dezembro de 2024 para se adaptar à nova Resolução. A prorrogação atende a solicitações feitas à CVM por representantes do mercado, que reportaram que os agentes, após processarem o conteúdo da norma e elaborarem suas especificações iniciais de sistemas e processos, perceberam que seria necessário um cronograma mais longo para a adequada implementação da Resolução CVM 175. A Administradora está avaliando os eventuais impactos, os quais poderão vir a ser objeto de aprovação em assembleia de cotistas.

18 Prestação de outros serviços e política de independência do auditor

Registre-se que a Administração, no exercício, não contratou nem teve serviços prestados pela KPMG Auditores Independentes Ltda. relacionados aos fundos de investimento por ela administrados que não aos serviços de auditoria externa referente a esse Fundo.

A política adotada atende aos princípios que preservam a independência do auditor, de acordo com os critérios internacionalmente aceitos, quais sejam, o auditor não deve auditar o seu próprio trabalho, nem exercer funções gerenciais no seu cliente ou promover os interesses deste.

***

Antônio Eduardo Alves Penteado do Nascimento
Diretor Responsável

Cristina Andrade Santana
CRC 1SP283337/O-9