

REGULAMENTO DO

BB ETF ÍNDICE DAP5 B3 FUNDO DE ÍNDICE RESPONSABILIDADE LIMITADA

CNPJ: 51.921.067/0001-08

ÍNDICE

REGULAMENTO

CAPÍTULO I - DO FUNDO.....	7
CAPÍTULO II - DOS PRESTADORES DE SERVIÇO ESSENCIAIS.....	7
CAPÍTULO III - DOS ENCARGOS DO FUNDO E DA CLASSE.....	10
CAPÍTULO IV - DA ASSEMBLEIA DE COTISTAS.....	11
CAPÍTULO V - DA POLÍTICA RELATIVA AO EXERCÍCIO DE DIREITO DE VOTO.....	14
CAPÍTULO VI - DA FORMA DE COMUNICAÇÃO AOS COTISTAS.....	14
CAPÍTULO VII - DO EXERCÍCIO SOCIAL DO FUNDO.....	15
CAPÍTULO VIII - DISPOSIÇÕES GERAIS.....	15

ANEXO - CLASSE ÚNICA

CAPÍTULO I - DA CLASSE.....	17
CAPÍTULO II - DA RESPONSABILIDADE LIMITADA.....	17
CAPÍTULO III - DA PRESTAÇÃO DOS SERVIÇOS DE CUSTÓDIA E CONTROLADORIA	19
CAPÍTULO IV - DA POLÍTICA DE INVESTIMENTO.....	19
CAPÍTULO V - DO ÍNDICE BOVESPA – IBOVESPA	21
CAPÍTULO VI - DOS FATORES DE RISCO.....	22
CAPÍTULO VII - DAS OPERAÇÕES DE EMPRÉSTIMO DE AÇÕES.....	25
CAPÍTULO VIII - REPRESENTAÇÃO DIRETA: DAS OPERAÇÕES DE EMPRÉSTIMO DE ATIVOS AOS COTISTAS PARA VOTO.....	25

APÊNDICE

CAPÍTULO I - DO PÚBLICO-ALVO E RESPONSABILIDADE DOS COTISTAS.....	26
CAPÍTULO II - DA REMUNERAÇÃO.....	26
CAPÍTULO III - DAS COTAS DA CLASSE.....	27

DEFINIÇÕES

ADMINISTRADORA

A BB GESTÃO DE RECURSOS – DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A., instituição financeira com sede na Cidade e Estado do Rio de Janeiro, na Avenida República do Chile, 330, 7º e 8º andares - Torre Oeste, Centro, CEP 20.031-170, inscrita no CNPJ sob o nº 30.822.936/0001-69, devidamente credenciada pela CVM como prestadora de serviços de administração de carteiras.

Agente Autorizado

Significa qualquer corretora de títulos e valores mobiliários e/ou distribuidora de títulos e valores mobiliários, autorizada a atuar nos mercados financeiro e de capitais intermediando a negociação de títulos e valores mobiliários entre investidores e tomadores de recursos, que tenha celebrado contrato de agente autorizado para atuar como intermediário dos Cotistas na integralização e no resgate de Cotas diretamente com o **FUNDO**.

Assembleia Geral

Significa a assembleia geral de Cotistas do **FUNDO**.

B3

a B3 S.A. - Brasil, Bolsa, Balcão.

Carteira

Significa a totalidade dos ativos que integram a carteira do **FUNDO**.

Cesta

Significa a composição de ativos e/ou valores em moeda corrente nacional a ser entregue pelos Cotistas ou pelo **FUNDO** para fins, respectivamente, de

execução de Ordens de Integralização e/ou de Ordens de Resgate, conforme o caso, de Lote Mínimo de Cotas, observado o disposto neste Regulamento e na página eletrônica do **FUNDO** na *internet*.

Cotas

Significam as cotas de emissão do **FUNDO**.

Cotistas

Significam os cotistas do **FUNDO**.

Custodiante

o **BANCO DO BRASIL S.A.**, sociedade de economia mista, com sede no Setor Bancário Sul, Quadra 4, Bloco C, Lote 32, edifício Sede III, Brasília (DF), inscrito no CNPJ sob nº 00.000.000/0001-91.

CVM

a Comissão de Valores Mobiliários.

Data de Rebalanceamento do ÍNDICE

Significa a data da realização do Rebalanceamento pela B3, no âmbito do Período de Rebalanceamento.

Dia Útil

Significa qualquer dia que não seja sábado, domingo ou feriados nacionais, ou dias em que, por qualquer motivo, não haja expediente na B3.

FUNDO

o **BB ETF ÍNDICE DAP5 B3 FUNDO DE ÍNDICE RESPONSABILIDADE LIMITADA**, fundo de índice de mercado, constituído sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração, regido pelo Regulamento e pelas disposições legais e regulamentares que lhe forem aplicáveis, em especial a Resolução CVM 175/22, e alterações posteriores.

GESTORA

a **BB GESTÃO DE RECURSOS – DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E**

VALORES MOBILIÁRIOS S.A., instituição financeira com sede na Cidade e Estado do Rio de Janeiro, na Avenida República do Chile, 330, 7º e 8º andares - Torre Oeste, Centro, CEP 20.031-170, inscrita no CNPJ sob o nº 30.822.936/0001-69, devidamente credenciada pela CVM como prestadora de serviços de Gestão de Carteiras.

ÍNDICE

Significa o ÍNDICE DAP5 B3 (IDAP5 B3), calculado pela B3.

Resolução CVM 175/22

Significa a Resolução da Comissão de Valores Mobiliários nº 175, de 23 de dezembro de 2022, e alterações posteriores.

Lote Mínimo de Cotas

Significa o lote mínimo de Cotas, conforme determinado e divulgado pela **ADMINISTRADORA**, na página eletrônica do **FUNDO** na *internet*, a ser emitido ou entregue ao **FUNDO**, respectivamente, nos termos de uma Ordem de Integralização ou Ordem de Resgate, apresentada pelo Agente Autorizado, observado o disposto neste Regulamento.

Ordem de Integralização

Significa uma ordem emitida pelo Agente Autorizado para emissão de um ou mais Lote(s) Mínimo(s) de Cotas pelo **FUNDO**, em contraprestação à entrega de Cesta pelo Agente Autorizado ao **FUNDO**.

Ordem de Resgate

Significa uma ordem emitida pelo Agente Autorizado, para que o **FUNDO** entregue Cesta em contraprestação à entrega de um ou mais Lote(s) Mínimo(s) de Cotas pelo Agente Autorizado.

Período de Rebalanceamento do ÍNDICE

Significa o período compreendido entre os 5 (cinco) Dias Úteis anteriores e 5 (cinco) Dias Úteis subsequentes à Data de Rebalanceamento.

Página do FUNDO

A página do **FUNDO** na rede mundial de computadores, qual seja: <http://www.bb.com.br/bdap11>.

Regulamento

Significa o regulamento do **FUNDO**.

Taxa de Administração

0,0800% ao ano, incidente sobre o Patrimônio Líquido, referente à remuneração a ser paga mensalmente pelo **FUNDO** à **ADMINISTRADORA**, nos termos do Artigo 1º do Apêndice ao Anexo do Regulamento.

Taxa de Gestão

0,1200% ao ano, incidente sobre o Patrimônio Líquido, referente à remuneração paga mensalmente pelo **FUNDO** ao **GESTOR**, nos termos do Artigo 1º do Apêndice ao Anexo do Regulamento.

Valor Patrimonial

Significa o valor resultante da divisão do patrimônio líquido do **FUNDO** pelo número de Cotas existentes, calculado ao final de cada Dia Útil.

CAPÍTULO I - DO FUNDO

Artigo 1º - O **BB ETF ÍNDICE DAP5 B3 FUNDO DE ÍNDICE RESPONSABILIDADE LIMITADA**, aqui doravante designado de forma abreviada **FUNDO**, é um Fundo de Índice, constituído sob a forma de condomínio aberto, com prazo indeterminado de duração, regido pelo presente Regulamento e pelas disposições legais e regulamentares que lhe forem aplicáveis.

Artigo 2º - O **FUNDO** possui classe única de cotas. As características da classe estão dispostas no Anexo do Regulamento.

CAPÍTULO II - DOS PRESTADORES DE SERVIÇO ESSENCIAIS

Artigo 3º - A responsabilidade dos prestadores de serviços essenciais e dos demais prestadores de serviços do **FUNDO** será limitada, perante o **FUNDO** e entre si, de acordo com as suas respectivas esferas de atuação sem estabelecimento de solidariedade entre os prestadores.

Parágrafo Único - Os prestadores de serviços essenciais são responsáveis, em conjunto, por:

- I. Deliberar sobre a constituição do fundo de investimento, suas classes e subclasses, conforme o caso, bem como aprovar seus respectivos regulamentos;
- II. Contratar os prestadores de serviços para os fundos de investimento e, caso aplicável, para suas classes e/ou subclasses;
- III. Relativamente às classes abertas, adotar políticas, procedimentos e controles internos, no âmbito de suas respectivas esferas de atuação, necessários para a gestão do risco de liquidez de tais classes;
- IV. Por resolver o patrimônio líquido negativo da classe com responsabilidade limitada dos cotistas, observadas as respectivas esferas de atuação e nos termos da regulação;
- V. Zelar para que as despesas com a contratação de terceiros prestadores de serviços que não constituam encargos das classes e/ou das subclasses, conforme o caso, não excedam o montante total, conforme o caso, da taxa de administração ou de gestão prevista no respectivo regulamento, correndo o pagamento de qualquer despesa que ultrapasse esse limite às expensas do prestador de serviço essencial que realizou a contratação.

SEÇÃO I - ADMINISTRADOR FIDUCIÁRIO

Artigo 4º - O **FUNDO** é administrado pela **BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.**, sediada no Rio de Janeiro - RJ, na Av. República do Chile, n.º 330, 7º e 8º andares, Torre Oeste,

inscrita no CNPJ sob o nº 30.822.936/0001-69, devidamente credenciada pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1.481, de 13 de agosto de 1990, doravante abreviadamente designada **ADMINISTRADORA**.

Parágrafo 1º - A **ADMINISTRADORA**, observadas as limitações legais e as previstas na regulamentação aplicável, tem poderes para praticar os atos necessários à administração do fundo de investimento, na sua respectiva esfera de atuação.

Parágrafo 2º - A **ADMINISTRADORA** pode contratar, em nome do **FUNDO**, com terceiros devidamente habilitados e autorizados, os seguintes serviços:

- a) tesouraria, controle e processamento de ativos;
- b) escrituração de cotas;
- c) auditoria independente; e
- d) custódia.

Parágrafo 3º - A **ADMINISTRADORA** poderá contratar outros serviços em benefício da classe de cotas, que não estejam na lista acima, sendo que caso o prestador de serviço contratado não seja um participante de mercado regulado pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM ou o serviço prestado ao **FUNDO** não se encontre dentro da esfera de atuação da Autarquia, a **ADMINISTRADORA** deve fiscalizar as atividades do terceiro contratado relacionadas ao **FUNDO**.

Parágrafo 4º - Incluem-se entre as obrigações do administrador fiduciário, dentre outras:

- a) diligenciar para que sejam mantidos, às suas expensas, atualizados e em perfeita ordem:
 - I - o registro de cotistas;
 - II - o livro de atas das assembleias gerais;
 - III - o livro ou lista de presença de cotistas;
 - IV - os pareceres do auditor independente; e
 - V - os registros contábeis referentes às operações e ao patrimônio do **FUNDO**.
- b) solicitar, se for o caso, a admissão à negociação das cotas de classe fechada em mercado organizado;
- c) pagar a multa cominatória às suas expensas, nos termos da legislação vigente, por cada dia de atraso no cumprimento dos prazos previstos na regulamentação aplicável;
- d) elaborar e divulgar as informações periódicas e eventuais da classe de cotas;
- e) manter atualizada junto à Comissão de Valores Mobiliários - CVM a lista de todos os prestadores de serviços contratados pelo **FUNDO**, inclusive os prestadores de serviços essenciais, bem como as demais informações cadastrais do **FUNDO** e suas classes de cotas;
- f) manter serviço de atendimento ao cotista, responsável pelo esclarecimento de dúvidas e pelo recebimento de reclamações, conforme definido no regulamento;

- g) nas classes abertas, receber e processar os pedidos de resgate;
- h) monitorar as hipóteses de liquidação antecipada, se houver;
- i) observar as disposições constantes do regulamento;
- j) cumprir as deliberações da assembleia de cotistas; e
- k) promover o rateio das despesas e contingências que sejam comuns às classes, caso o **FUNDO** conte com diferentes classes de cotas.

SEÇÃO II - GESTOR DE RECURSOS

Artigo 5º - O **FUNDO** é gerido pela **BB GESTÃO DE RECURSOS - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.**, sediada no Rio de Janeiro - RJ, na Av. República do Chile, nº 330, 7º e 8º andares, Torre Oeste, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 30.822.936/0001-69, devidamente credenciada pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM como prestadora de serviços de Administração de Carteiras por meio do Ato Declaratório nº 1.481, de 13 de agosto de 1990, doravante abreviadamente designada **GESTORA**.

Parágrafo 1º - A **GESTORA**, observadas as limitações legais e as previstas na regulamentação aplicável, tem poderes para praticar os atos necessários à gestão da carteira de ativos, na sua respectiva esfera de atuação.

Parágrafo 2º - A **GESTORA** pode contratar, em nome do **FUNDO**, com terceiros devidamente habilitados e autorizados, os seguintes serviços:

- a) intermediação de operações para a carteira de ativos;
- b) distribuição de cotas;
- c) consultoria de investimentos;
- d) classificação de risco por agência de classificação de risco de crédito;
- e) formador de mercado de classe fechada; e
- f) cogestão da carteira de ativos.

Parágrafo 3º - A **GESTORA** poderá contratar outros serviços em benefício da classe de cotas, que não estejam na lista acima, sendo que caso o prestador de serviço contratado não seja um participante de mercado regulado pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM ou o serviço prestado ao **FUNDO** não se encontre dentro da esfera de atuação da Autarquia, a **GESTORA** deve fiscalizar as atividades do terceiro contratado relacionadas ao **FUNDO**.

Parágrafo 4º - A **ADMINISTRADORA** e a **GESTORA** podem prestar os serviços de que tratam os itens “a” e “b” do parágrafo 2º, observada a regulamentação aplicável às referidas atividades.

Parágrafo 5º - Compete a **GESTORA** exercer o direito de voto decorrente de ativos detidos pela classe, realizando todas as ações necessárias para tal exercício, observado o disposto na Diretriz de exercício de direito de voto em assembleias, conforme indicado no endereço eletrônico <https://www.bb.com.br/pbb/pagina-inicial/bb-asset/fundos/politica-de-voto#>.

Parágrafo 6º - Compete a **GESTORA** negociar os ativos da carteira, bem como firmar, quando for o caso, todo e qualquer contrato ou documento relativo à negociação de ativos, qualquer que seja a sua natureza, representando a classe de cotas para essa finalidade.

Parágrafo 7º - Incluem-se entre as obrigações do gestor, dentre outras:

- a) informar a administradora, de imediato, caso ocorra qualquer alteração em prestador de serviço por ele contratado;
- b) providenciar a elaboração do material de divulgação da classe para utilização pelos distribuidores, às suas expensas;
- c) diligenciar para manter atualizada e em perfeita ordem, às suas expensas, a documentação relativa às operações da classe de cotas;
- d) manter a carteira de ativos enquadrada aos limites de composição e concentração e, se for o caso, de exposição ao risco de capital;
- e) observar as disposições constantes do regulamento;
- f) cumprir as deliberações da assembleia de cotistas; e
- g) as decisões de investimento, manutenção e desinvestimento da carteira da classe, em conformidade com a política de investimento estabelecida no anexo da classe respectiva.

Parágrafo 8º – A **GESTORA** celebrará contratos de agente autorizado com corretoras, previamente aprovadas ("Agente Autorizado"), que desejem atuar como intermediárias dos cotistas do **FUNDO** ("Cotistas") na integralização e no resgate de Cotas diretamente com o **FUNDO**.

CAPÍTULO III - DOS ENCARGOS DO FUNDO E DA CLASSE

Artigo 6º - Constituem encargos que poderão ser debitados ao **FUNDO** assim como de suas classes de cotas, no que couber:

- a) taxas, impostos ou contribuições federais, estaduais, municipais ou autárquicas, que recaiam ou venham a recair sobre os bens, direitos e obrigações do **FUNDO**;
- b) despesas com o registro de documentos, impressão, expedição e publicação de relatórios e informações periódicas previstas na Resolução CVM n.º 175/22.
- c) despesas com correspondências de interesse do **FUNDO**, inclusive comunicações aos cotistas;
- d) honorários e despesas do auditor independente;
- e) emolumentos e comissões pagas por operações da carteira de ativos;
- f) despesas com a manutenção de ativos cuja propriedade decorra de execução de garantia ou de acordo com devedor;
- g) honorários de advogado, custas e despesas processuais correlatas, incorridas em razão de defesa dos interesses do **FUNDO**, em juízo ou fora dele, inclusive o valor da condenação imputada, se for o caso;
- h) gastos derivados da celebração de contratos de seguro sobre os ativos da carteira, assim como a parcela de prejuízos da carteira não coberta por apólices de seguro, salvo se decorrente diretamente de culpa ou dolo dos prestadores dos serviços no exercício de suas respectivas funções;

- i) despesas relacionadas ao exercício de direito de voto decorrente de ativos da carteira;
- j) despesas com a realização de assembleia de cotistas;
- k) despesas inerentes à constituição, fusão, incorporação, cisão, transformação ou liquidação da classe;
- l) despesas com liquidação, registro e custódia de operações com ativos da carteira;
- m) despesas com fechamento de câmbio, vinculadas às operações da carteira de ativos;
- n) no caso de classe fechada, se for o caso, as despesas inerentes à:
 - I. distribuição primária de cotas; e
 - II. admissão das cotas à negociação em mercado organizado;
- o) royalties devidos pelo licenciamento de índices de referência, desde que cobrados de acordo com contrato estabelecido entre a **ADMINISTRADORA** e a instituição que detém os direitos sobre o índice, se aplicável;
- p) taxas de administração e de gestão;
- q) montantes devidos a fundos investidores na hipótese de acordo de remuneração com base na taxa de administração, performance ou gestão, observado o disposto no art. 99 da Resolução CVM n.º 175/22;
- r) taxa máxima de distribuição;
- s) despesas relacionadas ao serviço de formação de mercado;
- t) despesas decorrentes de empréstimos contraídos em nome da classe de cotas, desde que de acordo com as hipóteses previstas na Resolução CVM n.º 175/22;
- u) contratação da agência de classificação de risco de crédito;
- v) taxa máxima de custódia;

CAPÍTULO IV - DA ASSEMBLEIA DE COTISTAS

Artigo 7º - Compete privativamente à assembleia de cotistas deliberar sobre:

- a) demonstrações contábeis apresentadas pela **ADMINISTRADORA**, nos termos do parágrafo 1º abaixo;
- b) a substituição de prestador de serviço essencial do **FUNDO**, quais sejam, o administrador ou gestor;
- c) a fusão, a incorporação, a cisão, total ou parcial, a transformação ou a liquidação do **FUNDO** ou da **CLASSE**;
- d) a alteração do regulamento, ressalvado o disposto no Parágrafo 2º abaixo;
- e) o plano de resolução de patrimônio líquido negativo, nos termos da legislação em vigor;
- f) o pedido de declaração judicial de insolvência da **CLASSE**;
- g) a amortização de cotas e a distribuição de resultados, caso não estejam previstas no regulamento;
- h) mudança na política de investimento;
- i) aumento da taxa de custódia;
- j) mudança do endereço da página eletrônica do **FUNDO** na rede mundial de computadores;

- k) alterações no contrato entre a instituição proprietária do índice e o administrador, se houver, caso essas alterações acarretem aumento de despesas para a **CLASSE**; e
- l) outras alterações no regulamento que não sejam resultado de decisões relativas aos itens “h” a “j”.

Parágrafo 1º - Anualmente, a assembleia especial de cotistas deverá deliberar sobre as demonstrações contábeis da **CLASSE**, assim como a assembleia geral de cotistas deverá deliberar sobre as demonstrações contábeis do **FUNDO**, no prazo previsto nas regras específicas da categoria do **FUNDO**.

Parágrafo 2º - Este Regulamento poderá ser alterado independentemente de assembleia, nos seguintes casos:

- I. sempre que tal alteração decorrer exclusivamente da necessidade do atendimento a normas legais ou regulamentares, exigências expressas da Comissão de Valores Mobiliários - CVM, de entidade administradora de mercados organizados em que as cotas do **FUNDO** sejam admitidas à negociação ou de entidade autorreguladora, nos termos da legislação aplicável e de convênio com a Comissão de Valores Mobiliários - CVM;
- II. em virtude de atualização dos dados cadastrais dos prestadores de serviços do **FUNDO**, ou ainda;
- III. devido a redução das taxas devidas aos prestadores de serviços do **FUNDO**.

Artigo 8º - A convocação das assembleias será feita, no mínimo, com 10 (dez) dias de antecedência da data de sua realização, e poderá ser efetuada por meio físico ou eletrônico, a critério da **ADMINISTRADORA**.

Artigo 9º - É admitida a possibilidade de a **ADMINISTRADORA** adotar processo de consulta formal aos cotistas, em casos que julgar necessário. As deliberações serão tomadas com base na maioria dos votos recebidos.

Artigo 10 - A Assembleia de cotistas pode ser realizada:

- a) por meio exclusivamente eletrônico, devendo estar resguardados os meios para garantir a participação dos cotistas e a autenticidade e segurança na transmissão de informações, particularmente os votos, que devem ser proferidos por meio de assinatura eletrônica ou outros meios eficazes para assegurar a identificação do cotista; ou
- b) por meio parcialmente eletrônico, caso os cotistas possam participar e votar tanto presencialmente quanto a distância por meio de comunicação escrita ou sistema eletrônico.

Parágrafo 1º - A assembleia realizada exclusivamente de modo eletrônico é considerada como ocorrida na sede da **ADMINISTRADORA**.

Parágrafo 2º - Os cotistas podem votar por meio de comunicação escrita ou eletrônica, desde que recebida pelo administrador antes do início da assembleia, observado o disposto no regulamento.

Artigo 11 - Somente poderão votar nas assembleias, os cotistas inscritos no registro de cotistas na data da convocação da assembleia, seus representantes legais ou procuradores legalmente constituídos.

Artigo 12 - As deliberações relativas às demonstrações contábeis do **FUNDO** que não contiverem opinião modificada podem ser consideradas automaticamente aprovadas caso a assembleia correspondente não seja instalada em virtude do não comparecimento dos cotistas.

Artigo 13 - A assembleia de cotistas somente pode ser realizada após a divulgação, com prazo de antecedência mínimo de 15 (quinze) dias, na página do **FUNDO** na rede mundial de computadores das demonstrações contábeis relativas ao exercício, que devem também ficar à disposição dos cotistas na sede da **ADMINISTRADORA**.

Artigo 14 - A assembleia de cotistas também deverá ser convocada pela **ADMINISTRADORA**, às suas expensas, no prazo de 15 (quinze) dias, sempre que:

- I. o erro de aderência, calculado como o desvio padrão populacional das diferenças entre a variação percentual diária do Valor Patrimonial das cotas e a variação percentual diária do valor de fechamento do Índice nos últimos 60 (sessenta) pregões seja superior a 2 (dois) pontos percentuais, desde que tal erro de aderência não seja reenquadrado ao limite de 2 (dois) pontos percentuais até o 15º (décimo quinto) Dia Útil consecutivo subsequente à data de verificação do respectivo erro de aderência;
- II. a diferença entre a rentabilidade acumulada do **FUNDO** e a rentabilidade acumulada do Índice nos últimos 60 (sessenta) pregões seja superior a 2 (dois) pontos percentuais, desde que tal diferença de rentabilidade não seja reenquadrada ao limite de 2 (dois) pontos percentuais até o 15º (décimo quinto) Dia Útil consecutivo subsequente à data de verificação da respectiva diferença de rentabilidade; ou
- III. a diferença entre a rentabilidade acumulada do **FUNDO** e a rentabilidade acumulada do Índice em um período de 12 (doze) meses for superior a 4 (quatro) pontos percentuais, desde que tal diferença de rentabilidade não seja reenquadrada ao limite de 4 (quatro) pontos percentuais até o 30º (trigésimo) Dia Útil consecutivo subsequente à data de verificação da respectiva diferença de rentabilidade.

Parágrafo 1º - A ocorrência de qualquer dos eventos referidos nos incisos do caput deverá ser divulgada imediatamente na página do **FUNDO** na rede mundial de computadores, devendo a primeira divulgação relativa aos incisos I e II ocorrer após decorridos 60 (sessenta) pregões da data da listagem das cotas na B3, sendo que a primeira divulgação relativa ao inciso III deverá ocorrer após decorridos 12 (doze) meses daquela data.

Parágrafo 2º - A assembleia referida no caput deve ter em sua pauta os seguintes itens:

- I. explicações, por parte do gestor, das razões que, no seu entendimento, motivaram o erro de aderência ou a diferença de rentabilidade, as quais

devem ser divulgadas também na página eletrônica do **FUNDO** na rede mundial de computadores, com antecedência mínima de 15 (quinze) dias da realização da assembleia, e mantidas até 30 (trinta) dias após sua realização; e

- II. deliberação sobre a liquidação ou não da classe de cotas e substituição ou não do administrador, do gestor ou de ambos, item sobre o qual não podem votar pessoas ligadas à **ADMINISTRADORA** ou à **GESTORA**, conforme o caso.

Parágrafo 3º - As assembleias convocadas em função das condições previstas no caput devem ter intervalo mínimo de 30 (trinta) dias, no caso da manutenção do gestor, e de 90 (noventa) dias, caso a assembleia anterior tenha decidido por sua substituição.

Artigo 15 - As deliberações da assembleia de cotistas, que deve ser instalada com a presença de pelo menos 1 (um) cotista ou representante legal, são tomadas pelo critério da maioria das cotas de titularidade dos presentes, sendo atribuído 1 (um) voto a cada cota.

Parágrafo 1º - As matérias previstas nos itens “b”, “c”, “h” e “i” do artigo 7º devem ser aprovadas pelo voto dos cotistas que detenham a maioria absoluta das cotas, sendo impedidas de votar as pessoas ligadas a prestador de serviço essencial, quando se tratar de deliberação sobre sua destituição.

Parágrafo 2º - O quórum disposto no parágrafo acima não é obrigatório nas deliberações acerca das seguintes matérias:

- I. liquidação da classe de cotas e substituição do gestor, conforme hipótese prevista do artigo 15, parágrafo 2º, inciso II, deste Regulamento; e
- II. substituição do administrador decorrente de sua renúncia ou descredenciamento, nos termos do art. 108 da parte geral da Resolução CVM n.º 175/22.

CAPÍTULO V - DA POLÍTICA RELATIVA AO EXERCÍCIO DE DIREITO DE VOTO

Artigo 16 - Ao adotar política de exercício de direito de voto, conforme indicado no endereço eletrônico - <https://www.bb.com.br/pbb/pagina-inicial/bb-asset/fundos/politica-de-voto#/> a **GESTORA** comparecerá às assembleias em que o **FUNDO** seja detentor de ativos financeiros, sempre que identificar tal necessidade, a fim de resguardar os direitos e interesses dos Cotistas, conforme aplicável.

CAPÍTULO VI - DA FORMA DE COMUNICAÇÃO AOS COTISTAS

Artigo 17 - A **ADMINISTRADORA** e **GESTORA** disponibilizarão os documentos e as informações referentes ao **FUNDO** e a **CLASSE** a todos os cotistas preferencialmente por meio eletrônico, de acordo com a Resolução CVM n.º 175/22 e alterações posteriores.

Parágrafo 1º - O **FUNDO** manterá uma página eletrônica na internet, no endereço <http://www.bb.com.br/bdap11> (“**Página do Fundo**”), que conterá as informações previstas na regulamentação aplicável, os materiais de divulgação, bem como quaisquer informações relativas ao **FUNDO** que sejam consideradas relevantes pela **ADMINISTRADORA**.

Parágrafo 2º - Não haverá prospecto para o **FUNDO** ou prospecto de distribuição pública de suas Cotas. A divulgação de informações será realizada na página eletrônica do **FUNDO** e/ou no sistema FundosNet.

Parágrafo 3º - Outras características e detalhes sobre as operações de integralização e resgate de Cotas, bem como sobre operações de empréstimo de ativos, estão disponíveis na **Página do Fundo** e serão atualizados periodicamente, na forma da regulamentação aplicável.

Artigo 18 - A **ADMINISTRADORA** divulgará ampla e imediatamente, qualquer ato ou fato relevante inerente ao funcionamento do **FUNDO** de modo a garantir a todos os Cotistas o acesso a informações que possam, direta ou indiretamente, influenciar suas decisões quanto à permanência no **FUNDO** ou, no caso de outros investidores, quanto à aquisição das Cotas na página eletrônica do **FUNDO** na internet, aos endereços eletrônicos cadastrados na página eletrônica do **FUNDO** e no sistema de divulgação de informações da B3.

Artigo 19 - A cada Dia Útil, a **ADMINISTRADORA** informará à B3 o Valor Patrimonial, a composição da Carteira e o valor do patrimônio líquido do **FUNDO**.

Artigo 20 - Os Cotistas serão informados acerca de suas posições em conformidade com a legislação e regulamentação aplicáveis.

Artigo 21 - A **ADMINISTRADORA** disponibilizará as demonstrações financeiras anuais a qualquer interessado que as solicitar, no prazo máximo de 60 (sessenta) dias após o encerramento do exercício na **Página do Fundo**.

Artigo 22 - Caso a **ADMINISTRADORA** envie correspondência por meio físico aos cotistas, os custos decorrentes deste envio serão suportados pelo **FUNDO**.

CAPÍTULO VII - DO EXERCÍCIO SOCIAL DO FUNDO E DA CLASSE

Artigo 23 - O exercício social do **FUNDO** e da **CLASSE** compreende o período de 1º de abril a 31 de março do ano seguinte.

CAPÍTULO VIII - DISPOSIÇÕES GERAIS

Artigo 24 - Todo investidor ao solicitar a integralização de Cotas, adquirir Cotas na B3 ou de qualquer outra forma se tornar Cotista estará automaticamente aderindo e concordando com todas as disposições deste Regulamento.

Artigo 25 - Este Regulamento subordina-se às exigências previstas na legislação vigente divulgada pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM, em especial, à Resolução CVM n.º 175/22 e alterações posteriores.

Artigo 26 - Fica eleito o Foro da Cidade do Rio de Janeiro, Estado do Rio de Janeiro, com expressa renúncia de qualquer outro, por mais privilegiado que possa ser, para quaisquer ações relativas ao **FUNDO**, ou a questões decorrentes deste Regulamento.

Artigo 27 - Esclarecimentos aos cotistas serão prestados por meio da Central de Atendimento Banco do Brasil S.A., conforme telefones abaixo:

Central de Atendimento BB

Atendimento 24 horas, 7 dias por semana

4004 0001 ou 0800 729 0001

(para serviços transacionais: saldo, extratos, pagamentos, resgates, transferências, demais transações, informações e dúvidas)

Serviços de Atendimento ao Consumidor - SAC

Atendimento 24 horas, 7 dias por semana

0800 729 0722 (para atendimento de: reclamações, cancelamentos, informações e dúvidas gerais)

+ 55 11 2845 7823 (ligações do exterior, inclusive a cobrar)

Deficiente Auditivo ou de Fala

Atendimento 24 horas, 7 dias por semana

0800 729 0088

Ouvidoria BB

Atendimento em dias úteis, das 8h às 18h

0800 729 5678

(reclamações não solucionadas nos canais habituais de atendimento - agências, SAC e demais pontos)

Suporte Técnico

Atendimento 24 horas, 7 dias por semana

0800 729 0200

(orientações técnicas para o uso adequado dos canais de atendimento)

Rio de Janeiro, 27 de junho de 2025.

BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

ANEXO AO REGULAMENTO DO FUNDO BB ETF ÍNDICE DAP5 B3 FUNDO DE ÍNDICE RESPONSABILIDADE LIMITADA

CAPÍTULO I - DA CLASSE

Artigo 1º - A classe única do fundo **BB ETF ÍNDICE DAP5 B3 FUNDO DE ÍNDICE RESPONSABILIDADE LIMITADA**, pertencente à categoria Fundo de Índice de Renda Variável, aqui doravante designado de forma abreviada **CLASSE**, tem como objetivo refletir as variações e rentabilidade, deduzidas taxas e despesas do Índice DAP5 B3 ("IDAP5 B3" ou "ÍNDICE"), calculado pela B3 S.A. Brasil, Bolsa Balcão.

Parágrafo único - O objetivo descrito no *caput*, o qual a **GESTORA** perseguirá, não se caracteriza como uma promessa, garantia ou sugestão de rentabilidade.

Artigo 2º - A **CLASSE** é de regime aberto, com prazo de duração indeterminado.

CAPÍTULO II - DA RESPONSABILIDADE LIMITADA

Artigo 3º - A responsabilidade dos cotistas é limitada ao valor por eles subscrito e/ou integralizado.

Artigo 4º - Caso a **ADMINISTRADORA** verifique que o patrimônio líquido da **CLASSE** de cotas está negativo, os seguintes procedimentos serão imediatamente adotados:

- a) fechamento da **CLASSE** para resgates e não realização de amortização de cotas;
- b) não realização de novas subscrições de cotas;
- c) comunicação da existência do patrimônio líquido negativo à **GESTORA**;
- d) divulgação de fato relevante, nos termos da regulamentação vigente e
- e) cancelamento dos pedidos de resgate pendentes de conversão.

Artigo 5º - Além dos procedimentos acima, a **ADMINISTRADORA** adotará em até 20 (vinte) dias:

- a) elaboração de um plano de resolução do patrimônio líquido negativo, em conjunto com a **GESTORA**, do qual conste, no mínimo:
 - I - análise das causas e circunstâncias que resultaram no patrimônio líquido negativo;
 - II - balancete; e
 - III - proposta de resolução para o patrimônio líquido negativo, que, a critério dos prestadores de serviços essenciais, pode contemplar as possibilidades previstas nos itens abaixo, assim como a possibilidade de tomada de empréstimo pela classe, exclusivamente para cobrir o patrimônio líquido negativo; e,
- b) convocação de assembleia de cotistas, para deliberar acerca do plano de resolução do patrimônio líquido negativo de que trata o item "a" acima, em até 2 (dois) dias úteis após concluída a elaboração do plano, encaminhando o plano junto à convocação.

Parágrafo 1º - Caso após a adoção das medidas adotadas de caráter imediato os prestadores de serviços essenciais, em conjunto, avaliem, de modo fundamentado, que a ocorrência do patrimônio líquido negativo não representa risco à solvência da classe de cotas, a adoção das medidas a serem adotadas em até 20 dias se torna facultativa.

Parágrafo 2º - Caso anteriormente à convocação da assembleia, a **ADMINISTRADORA** verifique que o patrimônio líquido deixou de estar negativo, a **GESTORA** e a **ADMINISTRADORA** ficam dispensados de prosseguir com os procedimentos previstos acima, devendo a **ADMINISTRADORA** divulgar novo fato relevante, no qual devem constar o patrimônio líquido atualizado e, ainda que resumidamente, as causas e circunstâncias que resultaram no patrimônio líquido negativo.

Parágrafo 3º - Caso posteriormente à convocação da assembleia, e anteriormente à sua realização, a **ADMINISTRADORA** verifique que o patrimônio líquido deixou de estar negativo, a assembleia deve ser realizada para que a **GESTORA** apresente aos cotistas o patrimônio líquido atualizado e as causas e circunstâncias que resultaram no patrimônio líquido negativo.

Artigo 6º - Na assembleia, em caso de não aprovação do plano de resolução do patrimônio líquido negativo, os cotistas devem deliberar sobre as seguintes possibilidades:

- I - cobertura do patrimônio líquido negativo, mediante aporte de recursos, próprios ou de terceiros, em montante e prazo condizentes com as obrigações da **CLASSE**, hipótese na qual seria permitida a subscrição de novas cotas;
- II - cisão, fusão ou incorporação da **CLASSE** a outro fundo que tenha apresentado proposta já analisada pelos prestadores de serviços essenciais;
- III - liquidação da **CLASSE** que estiver com patrimônio líquido negativo, desde que não remanesçam obrigações a serem honradas pelo seu patrimônio; ou
- IV - determinação de que a **ADMINISTRADORA** entre com pedido de declaração judicial de insolvência da classe de cotas.

Parágrafo 1º - A **GESTORA** deve comparecer à assembleia, na qualidade de responsável pela gestão da carteira de ativos, observado que a ausência da **GESTORA** não impõe à **ADMINISTRADORA** qualquer óbice quanto a sua realização.

Parágrafo 2º - Na assembleia, é permitida a manifestação dos credores, nessa qualidade, desde que prevista na ata da convocação ou autorizada pela mesa ou pelos cotistas presentes.

Parágrafo 3º - Caso a assembleia não seja instalada por falta de quórum ou os cotistas não deliberem em favor de quaisquer das possibilidades previstas no artigo 6º, a **ADMINISTRADORA** deve ingressar com pedido de declaração judicial de insolvência da **CLASSE**.

CAPÍTULO III - DA PRESTAÇÃO DOS SERVIÇOS DE CUSTÓDIA E CONTROLADORIA

Artigo 7º - O responsável pelos serviços de Registro escritural de cotas, tesouraria, controladoria e custódia dos ativos financeiros integrantes da carteira da **CLASSE** é o **BANCO DO BRASIL S.A.**, sociedade de economia mista, com sede em Brasília (DF), na SAUN Quadra 5, Bloco B, Torre I, II e III, Torre I SL S101 à S1602, Torre II SL C101 à C1602 e Torre III SL N101 à N1602 - Ed. Banco do Brasil, Asa Norte, inscrito no CNPJ sob n.º 00.000.000/0001-91, devidamente credenciado pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM como prestador de serviços de Custódia de Valores Mobiliários por meio do Ato Declaratório nº 5.821, de 03 de fevereiro de 2000.

Artigo 8º - O custodiante deve:

- a) acatar somente as ordens emitidas pela **ADMINISTRADORA, GESTORA** e, se houver, cogestor, ou por seus representantes legais ou mandatários, devidamente autorizados;
- b) executar somente as ordens que estejam diretamente vinculadas às operações da **CLASSE**; e
- c) realizar conciliação diária entre as posições mantidas nas contas de custódia e aquelas fornecidas pelo depositário central, assegurando que os valores mobiliários custodiados e os direitos provenientes destes valores mobiliários estejam registrados em nome do investidor junto ao depositário central, quando for o caso.

CAPÍTULO IV - DA POLÍTICA DE INVESTIMENTO

Artigo 9º - A **CLASSE** deverá apresentar, isolada ou cumulativamente, a composição abaixo, em relação ao seu patrimônio líquido (PL):

Composição da Carteira	Mínimo	Máximo
1. Ativos financeiros que integrem o ÍNDICE , em qualquer proporção, ou em posições compradas no mercado futuro do ÍNDICE , de forma a refletir a variação e a rentabilidade do ÍNDICE , observados os limites definidos no presente Regulamento.	95%	100%
2. ativos financeiros que não façam parte do ÍNDICE , mas que sejam de mesma natureza daqueles, porém de diferentes emissões, conforme disposto no artigo 41, § 11 da Resolução CVM nº 175/22.	0%	20%

3. títulos públicos de emissão do Tesouro Nacional; e/ou 4. títulos de renda fixa de emissão de instituições financeiras; e/ou 5. cotas de fundos de investimento administrados ou não pela ADMINISTRADORA ou por pessoa a ela ligadas classificados como renda fixa “Simples”, “Curto Prazo” ou “Referenciado”; e/ou 6. operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais, de acordo com a regulamentação expedida pelo Conselho Monetário Nacional - CMN; e/ou 7. operações com derivativos distintas da prevista no inciso II do art. 41 do Anexo Normativo V da Resolução CVM nº 175/2022 (posição líquida em contratos futuros), realizadas em mercado organizado de valores mobiliários, exclusivamente para administração dos riscos inerentes à carteira do FUNDO ou dos ativos financeiros subjacentes; e/ ou 8. Ativos financeiros com liquidez não incluídos no ÍNDICE ; e/ou 9. cotas de outros fundos de índice.	0%	5%
Política de Utilização de Derivativos		
Hedge e posicionamento	Permitido	
Exposição ao Risco de Capital medido pelo limite de margem	Até 20%	
Operações de empréstimo dos valores mobiliários que compõem sua carteira	Vedado	

Parágrafo 1º - Os contratos futuros previstos no caput devem ser negociados em bolsa de mercadorias e de futuros contar com garantia de liquidação por entidade operadora de infraestrutura do mercado financeiro autorizada pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM ou pelo Banco Central do Brasil – BACEN para efetuar a compensação e liquidação das operações.

Parágrafo 2º - Tendo em vista a metodologia de cálculo e divulgação do **ÍNDICE**, bem como o objetivo e a política de investimento da **CLASSE**, a **ADMINISTRADORA**, mediante instrução da **GESTORA**, poderá ajustar a composição da carteira da **CLASSE** sempre que a composição do **ÍNDICE** sofrer ajustes devido a qualquer evento que afete ou modifique a composição da carteira teórica do **ÍNDICE**, respeitando a regulação vigente.

Parágrafo 3º - Quando da distribuição de proventos relacionados aos ativos financeiros subjacentes à Carteira, a **ADMINISTRADORA**, sempre que possível, seguirá a mesma política utilizada no cálculo do **ÍNDICE**. Nesse sentido, a **CLASSE** incorporará ao seu patrimônio os rendimentos porventura advindos de ativos e/ou operações que integrem a Carteira. O pagamento de eventuais rendimentos e amortizações realizados por meio da B3 seguirão seus prazos e procedimentos operacionais, bem como abrangerão todas as Cotas nela custodiadas eletronicamente, de forma igualitária, sem distinção entre os Cotistas, conforme aplicável.

Parágrafo 4º - Para atingir o objetivo previsto no Parágrafo 3º acima, a **CLASSE** poderá negociar os créditos relativos a quaisquer proventos declarados e ainda não efetivamente pagos, observadas as disposições da Resolução CVM n.º 175/22, conforme aplicável.

Parágrafo 5º - Durante o Período de Rebalanceamento do **ÍNDICE**, a **ADMINISTRADORA** poderá suspender as integralizações por prazo determinado, conforme aplicável.

Parágrafo 6º - Casos excepcionais de desenquadramento da carteira serão justificados por escrito pela **ADMINISTRADORA** à Comissão de Valores Mobiliários - CVM no prazo máximo de 5 (cinco) dias úteis, a contar da data de sua ocorrência.

Parágrafo 7º - Os resultados obtidos pela variação diária dos ativos financeiros componentes da Carteira, bem como de quaisquer outros proventos recebidos, serão incorporados ao patrimônio líquido do **CLASSE**, de acordo com as demais disposições deste Regulamento.

Parágrafo 8º - A **ADMINISTRADORA**, bem como os fundos de investimento e carteiras por ela administrados ou pessoas a ela ligadas, poderão atuar como contraparte em operações realizadas pela **CLASSE**.

Artigo 10 - A rentabilidade da **CLASSE** é determinada em função do valor de mercado dos ativos financeiros que compõem sua Carteira. Esses ativos apresentam alterações de preço, o que configura a possibilidade de ganhos, mas também de perdas. Desta forma, eventualmente, poderá haver perda do capital investido, não cabendo à **ADMINISTRADORA**, nem ao Fundo Garantidor de Crédito - FGC, garantir qualquer rentabilidade ou o valor originalmente investido.

Parágrafo único - Os resultados obtidos pela variação diária dos ativos financeiros componentes da Carteira e quaisquer outros proventos recebidos impactarão o valor da Cota.

CAPÍTULO V - DO ÍNDICE DAP5 B3

Artigo 11 - O objetivo do **ÍNDICE** é ser o indicador de retorno total de uma carteira teórica composta por contratos de Futuro de Cupom IPCA (DAP). A rolagem e

reavaliação de ponderação é anual e o caixa é investido em ativos indexados à taxa DI Over de 1 (um) dia ou à taxa Selic Over, observados os critérios estipulados na metodologia do **ÍNDICE**.

Parágrafo 1º - O **ÍNDICE** será baseado nos contratos elegíveis do contrato futuro de cupom IPCA (DAP) e adotará um critério de rolagem, conforme período e pesos definidos na metodologia do **ÍNDICE**.

Parágrafo 2º - Todas as informações acima dispostas sobre o **ÍNDICE** foram obtidas nos documentos disponíveis na página oficial da B3. A **CLASSE**, a **ADMINISTRADORA**, a **GESTORA** e suas coligadas, bem como qualquer outro prestador de serviço que preste serviços ao **FUNDO** não serão responsáveis por quaisquer falhas destas informações ou, ainda, por incorreções no cálculo do **ÍNDICE**.

Parágrafo 3º - A **CLASSE**, a **ADMINISTRADORA** e a **GESTORA** não são responsáveis pela gestão, cálculo, divulgação e manutenção do **ÍNDICE**.

Parágrafo 4º - Caso a B3 S.A. deixe de realizar a gestão, cálculo, divulgação e manutenção do **ÍNDICE**, a **ADMINISTRADORA** divulgará tal fato, na forma da regulamentação aplicável, e convocará uma Assembleia Geral de Cotistas a fim de deliberar acerca de eventual mudança no objetivo previsto no CAPÍTULO I do Anexo deste Regulamento, caso contrário, pela liquidação e encerramento da **CLASSE**, nos termos deste Regulamento.

Parágrafo 5º - Caso os Cotistas não aprovem, em uma assembleia geral de cotistas devidamente convocada ou em qualquer futura convocação de tal assembleia, uma mudança no objetivo de investimento da **CLASSE**, a **ADMINISTRADORA** deverá dar início aos procedimentos de liquidação da **CLASSE**, em conformidade com o presente Regulamento.

CAPÍTULO VI - DOS FATORES DE RISCO

Artigo 12 - Os ativos financeiros que compõem a carteira da **CLASSE** e das **classes investidas** sujeitam-se, em especial, aos seguintes riscos.

- a) **Risco de mercado** - O risco de mercado é definido como o potencial resultado negativo decorrente da mudança de preços dos ativos no mercado. Neste sentido, um risco de mercado diretamente observado na aquisição de Cotas da **CLASSE** decorre da potencial alteração no preço de negociação desta Cota no mercado secundário. Adicionalmente, o valor dos ativos financeiros que integram a Carteira também poderá aumentar ou diminuir, de acordo com as flutuações de preços e cotações das commodities e ações investidas no mercado, alterações nas taxas de juros e/ou dos resultados das empresas cujos valores mobiliários compõem a Carteira. Em caso de queda do valor dos ativos que compõem a Carteira, seu patrimônio líquido poderá ser afetado negativamente. A queda dos preços dos ativos financeiros integrantes da Carteira e/ou do valor da Cota

da **CLASSE** negociado no mercado secundário pode ser temporária, não existindo, no entanto, garantia de que não se estenda por períodos longos e/ou indeterminados;

- b) **Risco proveniente do uso de derivativos** - Os preços dos contratos de derivativos são influenciados por diversos fatores que não dependem exclusivamente da variação do preço do ativo objeto. Dessa forma, operações com derivativos, mesmo com objetivo exclusivo de proteger posições, podem ocasionar perdas para a **CLASSE** e, consequentemente, para seus cotistas;
- c) **Risco de investimento em títulos indexados à inflação** – o valor dos ativos financeiros pode aumentar ou diminuir de acordo com a variação do índice de inflação ao qual está atrelado. Em caso de queda do valor desses ativos, o patrimônio líquido da **CLASSE** pode ser afetado negativamente;
- d) **Risco de taxa de juros** - A rentabilidade da **CLASSE** pode ser impactada em função de flutuações nos valores de mercado das posições detidas pela **CLASSE**, ocasionadas pela variação das taxas de juros praticadas no mercado;
- e) **Risco de liquidez das Cotas negociadas na B3** - As Cotas podem ser vendidas no mercado secundário. Não há como garantir que seja mantido volume mínimo de negociação das Cotas e não se podem prever os níveis de preço pelos quais as Cotas poderão ser negociadas. Também não há como garantir que as Cotas tenham padrão de negociação ou de preço similar àqueles das cotas negociadas em bolsa de valores, emitidas por fundos ou empresas de investimento no Brasil ou em outras jurisdições, ou que tenham como referência outros índices de mercado, que não o Índice. Dessa forma, os Cotistas podem ter dificuldade em realizar a venda das suas Cotas no mercado secundário ou, ainda, obter preços reduzidos na venda das Cotas. Os resgates somente serão feitos mediante a entrega de uma Cesta de ativos pela **CLASSE** ao Cotista que tiver solicitado o resgate, cuja composição obedecerá às regras constantes do Regulamento;
- f) **Risco de vinculação a um índice de referência** - O **ÍNDICE** da **CLASSE** poderá se sujeitar a períodos de volatilidade expressiva, o que poderá afetar o preço das Cotas negativamente, implicando em perdas para o **CLASSE**;
- g) **Risco de descasamento em relação ao índice de referência** - A performance do **FUNDO** pode não refletir integralmente a performance do **ÍNDICE**, visto que a implementação do objetivo de investimento do **FUNDO** está sujeita a uma série de limitações. Relações imprecisas entre a Carteira e a composição do **ÍNDICE**, arredondamento de preços, alterações das características do **ÍNDICE** e exigências e limitações regulatórias aplicáveis ao **FUNDO**, mas não ao **ÍNDICE**, poderão fazer com que a performance do **FUNDO** divirja da performance do **ÍNDICE**. Tais erros de aderência também poderão ser causados em virtude de a **CLASSE** se sujeitar a taxas e despesas não aplicáveis ao **ÍNDICE**. Se o erro de aderência for superior ao

permitido pelo Regulamento e/ou pela regulação aplicável, a **ADMINISTRADORA** deverá convocar Assembleia Geral às suas expensas, com a finalidade de deliberar a alteração da política de investimento, substituição da **GESTORA**, ou liquidação da **CLASSE**. Tal fato pode impactar negativamente a perspectiva de investimento e o retorno esperado pelos Cotistas;

- h) **Risco de Liquidez de ativos que compõem a carteira** - Os Cotistas que resgatarem Cotas (ou seja, não optarem por vender suas Cotas no mercado secundário e, alternativamente, optarem por resgatar as Cotas) receberão apenas ativos pertencentes à carteira teórica, e conforme o caso, outros ativos não incluídos no **ÍNDICE** que compõem a Cesta. É possível que os Cotistas que resgatarem Cotas não consigam vender os ativos financeiros que eventualmente façam parte da Cesta após o resgate, caso não haja liquidez no mercado para negociação de tais ativos e nem receber qualquer valor pelos demais ativos que façam parte da Cesta quando do resgate. Cabe ressaltar que o resgate de Cotas somente é possível para Cotistas que detenham o Lote Mínimo de Cotas determinado pela **ADMINISTRADORA**;
- i) **Risco de concentração** - Consiste no risco de perdas, decorrentes da pouca diversificação de emissores dos ativos financeiros componentes da Carteira. Se os valores mobiliários que integrem o **ÍNDICE** estiverem concentrados em determinadas companhias ou em um determinado segmento ou setor, o **FUNDO** estará sujeito a maior volatilidade e a adversidades econômicas, o que pode afetar adversamente sua performance;
- j) **Risco de ágio e deságio na negociação das Cotas em relação ao Valor Patrimonial** - O Valor Patrimonial da **CLASSE** poderá diferir do preço de negociação das cotas da **CLASSE** na B3. Enquanto o Valor Patrimonial das cotas da **CLASSE** refletir o valor de mercado da carteira da **CLASSE**, os preços de negociação das cotas da **CLASSE** na B3 poderão ser inferiores ou superiores ao seu respectivo Valor Patrimonial. O preço de negociação das cotas da **CLASSE** pode flutuar baseando-se principalmente no Valor Patrimonial da **CLASSE** e na oferta e procura de suas cotas, as quais irão variar com base nas condições de mercado e outros fatores, tais como a conjuntura econômica do Brasil e a confiança do investidor e suas expectativas relacionadas ao mercado de capitais brasileiro. Contudo, não há nenhuma garantia de que isso ocorra ou continue ocorrendo. Ainda, não é possível garantir que investidores irão de fato ou sempre que necessário utilizar os mecanismos de emissão e o resgate de cotas da **CLASSE**, destinados à manutenção do preço de negociação das cotas em níveis semelhantes ao Valor Patrimonial das cotas da **CLASSE**, quando tais desvios ocorrerem ou de que estas emissões e resgates irão de fato reduzir a diferença entre o preço de negociação das cotas da **CLASSE** na B3 e o seu respectivo Valor Patrimonial;

- k) **Risco de juros pós-fixados** - os preços dos ativos podem variar em virtude dos spreads praticados nos ativos indexados ao CDI ou à TMS;
- l) **Risco de conjuntura** - Possibilidade de perdas decorrentes de mudanças verificadas nas condições políticas, culturais, sociais, econômicas ou financeiras do Brasil ou de outros países;
- m) **Risco sistêmico** - Provém de alterações econômicas de forma geral e que podem afetar todos os investimentos, não conseguindo ser reduzido, mesmo através de uma política de diversificação;
- n) **Risco regulatório** - a eventual interferência de órgãos reguladores no mercado como o Banco Central do Brasil - BACEN e a Comissão de Valores Mobiliários - CVM, podem impactar os preços dos ativos ou os resultados das posições assumidas.

CAPÍTULO VII – DAS OPERAÇÕES DE EMPRÉSTIMO DE AÇÕES

Artigo 13 – Está vedado à **CLASSE** realizar operações de empréstimos de ativos da Carteira da Classe.

CAPÍTULO VIII – REPRESENTAÇÃO DIRETA: DAS OPERAÇÕES DE EMPRÉSTIMO DE ATIVOS AOS COTISTAS PARA VOTO

Artigo 14 - Em decorrência da natureza dos ativos investidos preponderantemente pela **CLASSE**, conforme a composição do **ÍNDICE**, a **CLASSE** não realizará operações de empréstimos dos valores mobiliários que compõem sua Carteira para que os Cotistas possam exercer direito de voto nas assembleias de seus emissores.

Rio de Janeiro, 27 de junho de 2025.

BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

**APÊNDICE AO ANEXO DA CLASSE BB ETF ÍNDICE DAP5 B3 FUNDO DE
ÍNDICE RESPONSABILIDADE LIMITADA**

CAPÍTULO I - DO PÚBLICO-ALVO E RESPONSABILIDADE DOS COTISTAS

Público-alvo	Investidores em geral, inclusive fundos de investimento e carteiras administradas devidamente autorizados a adquirir cotas do FUNDO pela respectiva legislação aplicável de sua jurisdição, e que aceitem todos os riscos inerentes ao investimento no FUNDO , em busca de rentabilidade compatível com o objetivo do FUNDO , conforme descrito em sua política de investimento e composição de carteira.
Responsabilidade	Limitada

CAPÍTULO II - DA REMUNERAÇÃO

Artigo 1º - A **ADMINISTRADORA** e a **GESTORA** receberão, pela prestação de seus serviços, remuneração anual, incidente sobre o patrimônio líquido da **CLASSE**, calculada e cobrada, por dia útil, à razão de 1/252, conforme tabela abaixo:

Taxa de Administração	0,0800% a.a.
Taxa de Gestão	0,1200% a.a.
Taxa Máxima de Distribuição	0,000% a.a.
TOTAL	0,20% a.a.

Parágrafo 1º - A remuneração prevista acima, compreende as taxas de administração e gestão da **CLASSE** e das **Classes/Subclasses** nas quais a **CLASSE** investe.

Parágrafo 2º - Não serão consideradas, para fins de cálculo da taxa máxima de administração e gestão da **CLASSE**, as taxas de administração e gestão cobradas: (i) pelas classes/subclasses investidas geridas por partes não relacionadas ao gestor da classe investidora; e (ii) pelas classes/subclasses investidas cujas cotas sejam admitidas à negociação em mercado organizado, se aplicável.

Artigo 2º - Não haverá cobrança de taxa de performance pela **CLASSE**.

Artigo 3º - O **CUSTODIANTE** receberá, pela prestação de seu serviço, remuneração correspondente à porcentagem anual de 0,01% (um centésimo por cento) ao ano sobre o valor do patrimônio líquido do **CLASSE**, calculada, provisionada e cobrada todo Dia Útil, à razão de 1/252.

Artigo 4º - Não serão cobradas taxas de ingresso e de saída na **CLASSE**.

CAPÍTULO III - DAS COTAS DA CLASSE

Artigo 5º - As cotas da **CLASSE** correspondem a frações ideais do patrimônio líquido do **CLASSE**, assumem a forma nominativa e são escrituradas em nome de seus titulares.

Parágrafo único - A condição de Cotista é caracterizada pela inscrição no registro de cotistas mantido pelo prestador de serviços de escrituração de Cotas.

Artigo 6º - As Cotas serão admitidas à negociação no mercado de bolsa administrado pela B3 e poderão ser adquiridas ou vendidas no mercado secundário por qualquer corretora de títulos e valores mobiliários e/ou distribuidora de títulos e valores mobiliários, autorizada a atuar nos mercados financeiro e de capitais intermediando a negociação de títulos e valores mobiliários entre investidores e tomadores de recursos, que tenha celebrado contrato de Agente Autorizado. A **ADMINISTRADORA**, as empresas a ela ligadas, bem como seus respectivos diretores e funcionários, poderão adquirir e negociar as Cotas a qualquer tempo.

Parágrafo único - Não obstante o disposto no caput deste Artigo 6º, a Gestora não poderá atuar como formadora de mercado para as Cotas, porém poderá contratar, em nome do **FUNDO**, formador de mercado para as Cotas do **CLASSE**.

Artigo 7º - O valor patrimonial das Cotas será o valor resultante da divisão do patrimônio líquido da **CLASSE** pelo número de Cotas existentes, calculado ao final de cada Dia Útil ("**Valor Patrimonial**").

Artigo 8º - Para fins de Ordens de Integralização e Ordens de Resgate de Cotas, a **ADMINISTRADORA** deverá utilizar o Valor Patrimonial apurado no encerramento do Dia Útil em que a respectiva solicitação foi processada, sendo que as ordens deverão ser liquidadas no prazo estipulado para liquidação de operações na B3.

Parágrafo 1º - A **ADMINISTRADORA** e/ou **GESTORA** e os demais prestadores de serviço complementares envolvidos na distribuição de cotas da **CLASSE** poderão, a seu exclusivo critério, recusar o investimento de determinados investidores, levando em conta aspectos de prevenção à lavagem de dinheiro, adequação ao perfil do investidor e os melhores interesses dos cotistas, dentre outros.

Parágrafo 2º - A liquidação de uma Ordem de Integralização ocorrerá até o 1º Dia Útil subsequente ao recebimento da referida ordem, observados os termos e condições previstos neste Regulamento. Ainda, a liquidação de uma Ordem de Resgate ocorrerá no prazo exigido para a liquidação de operações na B3 atualmente efetuado até o 4º Dia Útil subsequente. Qualquer alteração do referido prazo de liquidação por parte da B3 será prontamente divulgada na página eletrônica do **FUNDO**.

Artigo 9º - As Cotas poderão ser objeto de empréstimo e de garantia, na forma da regulamentação em vigor e deste Regulamento, conforme aplicável.

Parágrafo Único – As Cotas objeto das operações previstas no *caput* deste Artigo devem estar depositadas em custódia nas entidades prestadoras de serviços de compensação e liquidação, registro e custódia de títulos e valores mobiliários autorizadas pela CVM, devendo o Cotista autorizar, prévia e expressamente, a realização de operações desta natureza. Aplicam-se, no que couber ao empréstimo de Cotas, as normas em vigor para empréstimo de valores mobiliários.

Artigo 10 - As cotas da **CLASSE** poderão ser inicialmente objeto de distribuição pública nos termos da RCVN 175 ou outra regulamentação aplicável, intermediada por instituição integrante do sistema de distribuição, distribuídas e liquidadas por meio do Sistema de Distribuição de Ativos (DDA) ou pela Central Depositária da B3. Após a listagem da **CLASSE**, liquidação da distribuição pública, e início da negociação das Cotas no mercado secundário de bolsa, novas Cotas serão emitidas e resgatadas somente em Lotes Mínimos de Cotas ou em múltiplos de Lotes Mínimos de Cotas, por meio dos Agentes Autorizados, utilizando-se a Central Depositária Online (CAC) da B3.

Parágrafo 1º - O Lote Mínimo de Cotas será determinado e divulgado pela **ADMINISTRADORA** ao mercado antes da abertura da negociação de Cotas, na página eletrônica do **FUNDO**.

Parágrafo 2º - Tanto na emissão quanto no resgate das cotas será utilizado o **Valor Patrimonial** apurado no fechamento do dia de sua solicitação (“**Cota de Fechamento**”).

Parágrafo 3º – O Lote Mínimo de Cotas somente poderá ser emitido e resgatado com uma ordem de integralização ou de resgate devidamente submetida por um Agente Autorizado e mediante a entrega de uma cesta ao **FUNDO**, conforme aplicável, observado o disposto no Artigo 11 deste Regulamento (respectivamente, “**Cesta**”, “**Ordem de Integralização**” e “**Ordem de Resgate**”).

Parágrafo 4º – As Cotas somente poderão ser integralizadas ou resgatadas por Agentes Autorizados.

Parágrafo 5º – A lista com informações atualizadas a respeito dos Agentes Autorizados e suas informações para contato será divulgada diariamente na página eletrônica do **FUNDO** na *internet*.

Parágrafo 6º - O Lote Mínimo de Cotas somente poderá ser emitido e resgatado com uma ordem de integralização ou de resgate devidamente submetida por um Agente Autorizado.

Parágrafo 7º - A forma de integralização e resgate de cotas no mercado primário será "*In Cash*"- mediante a entrega de moeda corrente nacional à **CLASSE**, conforme aplicável.

Artigo 11 - A Cesta será composta por valores em moeda corrente nacional para fins de uma Ordem de Integralização ou de uma Ordem de Resgate, e será divulgada na página eletrônica do **FUNDO** pela **ADMINISTRADORA**.

Parágrafo 1º - A **ADMINISTRADORA**, a seu exclusivo critério, poderá definir Cestas com composição distinta daquela prevista no *caput*. Quaisquer alterações na composição da Cesta devem ser efetuadas e divulgadas ao mercado antes da abertura da negociação das Cotas, na forma prevista pela regulamentação, sendo vedadas alterações durante o horário de negociação.

Parágrafo 2º - Em situações excepcionais de dificuldade na execução de Ordens de Integralização ou Ordens de Resgate, devida à baixa liquidez de uma ou mais ativos do **ÍNDICE** que componham a Cesta, caso haja alteração na composição de sua carteira teórica, a **ADMINISTRADORA**, a seu exclusivo critério, poderá alterar a Cesta, observados os limites de composição da Cesta previstos na Resolução CVM 175/22.

Parágrafo 3º – A integralização e o resgate das Cotas serão efetuados sem a cobrança de qualquer taxa, exceto àquelas oriundas de operações em moeda corrente, onde serão calculadas por operação de integralização ou resgate e cobradas diretamente do Cotista que disponibilizou os recursos para a integralização ou que solicitou o resgate.

Artigo 12 - Será divulgado diariamente na página do **FUNDO** na *Internet*, um arquivo contendo a composição da Cesta de Ativos a ser entregue por ocasião de ordens de Integralização e Resgate, descrevendo a sua composição para o próximo pregão da B3.

Artigo 13 - Ordens de Integralização e Ordens de Resgate serão recebidas e processadas pela **ADMINISTRADORA** somente em dias úteis em horário previamente divulgado na página eletrônica do **FUNDO** na *internet*.

Parágrafo Único- Ordens de Integralização e Ordens de Resgate recebidas após o horário acima não serão aceitas pela **ADMINISTRADORA**.

Artigo 14 - A integralização e o resgate de Lotes Mínimos de Cotas utilizarão o Valor Patrimonial apurado no fechamento do dia da solicitação, nos termos do Artigo 7º deste Apêndice, sendo que qualquer alteração do referido prazo de liquidação por parte da B3 será prontamente divulgada na página eletrônica do **FUNDO** na *internet*.

Parágrafo 1º - Os Agentes Autorizados submeterão a Ordem de Integralização ou Ordem de Resgate, que somente será considerada aceita após a

ADMINISTRADORA, por meio da B3, apresentar ao Agente Autorizado confirmação por escrito ou meio eletrônico de que a respectiva Ordem foi aceita.

Parágrafo 2º - Qualquer Cotista sujeito à tributação que solicite a um Agente Autorizado o resgate de Cotas deverá fornecer ao respectivo Agente Autorizado as notas de corretagem e demais documentos necessários para que a **ADMINISTRADORA** apure o custo de aquisição das Cotas a serem resgatadas, devendo o Agente Autorizado entregar tais documentos à **ADMINISTRADORA** até o dia e horário devidamente divulgados na página eletrônica do **FUNDO** na *internet*. Caso a **ADMINISTRADORA** não receba tais documentos até o horário e data estabelecidos, o pedido de resgate será cancelado.

Artigo 15 - Durante o Período de Rebalanceamento, a **ADMINISTRADORA** poderá aceitar ou entregar, no momento da integralização e resgate de Lote Mínimo de Cotas, se assim o Agente Autorizado solicitar, uma Cesta composta:

- a) apenas por um determinado ativo do **ÍNDICE** ou por alguns determinados ativos do **ÍNDICE**; ou
- b) por determinado(s) ativos(s) considerado(s) líquido(s) que esteja(m) sendo incluído(s) ou excluído(s) em uma nova composição da carteira teórica do **ÍNDICE**, de acordo com as previsões para a nova composição do **ÍNDICE** conforme divulgadas pela **B3**.

Parágrafo único - Na hipótese descrita neste artigo, caso o número de Ordens de Integralização ou de Resgate venha a exceder a quantidade de ativos necessárias para ajustar a carteira, a aceitação de tais ativos será feita proporcionalmente à quantidade de ativos oferecidas por parte de cada Agente Autorizado que tenha encaminhado tais ordens ficando ressalvado que o número de Cotas a ser atribuído ou a quantidade de ativos correspondente a cada Agente Autorizado corresponderá sempre a um número inteiro.

Artigo 16 - As cotas do **FUNDO** serão listadas para negociação na B3 e poderão ser adquiridas ou vendidas por qualquer Corretora habilitada perante a B3 para operar em seus sistemas de negociação.

Parágrafo único - a **ADMINISTRADORA**, bem como pessoas físicas e jurídicas ligadas à **ADMINISTRADORA** poderão, desde que permitido pela regulamentação em vigor, adquirir e negociar as cotas da **CLASSE** a qualquer tempo.

Rio de Janeiro, 27 de junho de 2025.

BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.