

# INDEX GUIDELINE

*ÍNDICE DE GENÔMICA DA SOLACTIVE*

*Version 1*

*29 September 2022*



# ÍNDICE

Introdução .....	3
1. Especificações do índice .....	4
1.1. Escopo do índice.....	4
1.2. Identificadores e Publicação .....	4
1.3. Nível Inicial do Índice .....	4
1.4. Frequência de preços e cálculo .....	4
1.5. Licenciamento.....	5
2. Seleção do Índice .....	6
2.1. Requisitos do Universo do Índice .....	6
2.2. Seleção dos Componentes do Índice .....	7
2.3. Ponderação dos Componentes do Índice .....	8
3. Rebalanceamento .....	9
3.1. Rebalanceamento ordinário .....	9
3.2. Rebalanceamento extraordinário.....	9
4. Cálculo do Índice.....	10
4.1. Fórmula do Índice .....	10
4.2. Precisão .....	10
4.3. Ajustes.....	10
4.4. Ações empresariais.....	11
4.5. Recálculo.....	12
4.6. Perturbação do Mercado.....	12
5. Disposições diversas.....	13
5.1. Critério.....	13
5.2. Revisão da Metodologia.....	13
5.3. Alterações no método de cálculo .....	13
5.4. Término.....	14
5.5. Supervisão.....	14
6. Definições.....	15
Contato.....	17



## INTRODUÇÃO

Este documento (a "**DIRETRIZ**") deve ser usado como uma diretriz com relação à composição, cálculo e manutenção do Índice de Genômica da Solactive (o "**ÍNDICE**"). Todas as alterações às regras feitas na DIRETRIZ são aprovadas pelo COMITÊ DE SUPERVISÃO especificado na Seção 5.5. O ÍNDICE é de propriedade, calculado, administrado e publicado pela Solactive AG ("**SOLACTIVE**") que assume a função de administrador (o "**ADMINISTRADOR DO ÍNDICE**") nos termos do Regulamento (UE) 2016/1011 (o "**REGULAMENTO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA**" ou "**RIR**"). O nome "Solactive" é uma marca registrada.

*O texto usa termos definidos que são formatados em "SMALL CAPS". Esses termos terão o significado atribuído a eles como especificado na Seção 6 (Definições).*

**A DIRETRIZ e os documentos das políticas e da metodologia aos quais se faz referência neste instrumento contêm as regras e os princípios fundamentais relativos à estrutura e à operação do ÍNDICE. A SOLACTIVE não oferece nenhuma garantia explícita ou tácita, nem relativa aos resultados do uso do ÍNDICE nem ao nível do ÍNDICE em um determinado momento ou em qualquer outro aspecto. A SOLACTIVE se esforça na medida do possível para garantir a exatidão do cálculo. Não há obrigação da SOLACTIVE – independentemente das possíveis obrigações com os emissores – de informar terceiros, incluindo investidores e/ou intermediários financeiros, a respeito de quaisquer erros do ÍNDICE. A publicação do ÍNDICE pela SOLACTIVE não constitui uma recomendação de investimento de capital e não contém nenhuma garantia ou opinião da SOLACTIVE em relação a um possível investimento em um instrumento financeiro com base nesse ÍNDICE.**



# 1. ESPECIFICAÇÕES DO ÍNDICE

## 1.1. ESCOPO DO ÍNDICE

<b>Categoria</b>	<b>Descrição</b>
Classe de ativos	Patrimônio
Estratégia	Representação de empresas que são ativas no campo da genômica
Alocação regional	Mercados globais
Taxa de rebalanceamento	-
Frequência de rebalanceamento	Trimestral

## 1.2. IDENTIFICADORES E PUBLICAÇÃO

O ÍNDICE é publicado sob os seguintes identificadores:

<b>Nome</b>	<b>ISIN</b>	<b>Moeda</b>	<b>Tipo</b>	<b>RIC</b>	<b>Ticker BBG</b>
Índice de Genômica da Solactive	DE000SLA7166	USD	NTR	.SOLGNOM	Índice SOLGNOM

\*NTR significa que o Índice é calculado como um Índice de retorno líquido total como descrito na Metodologia do Índice de Patrimônio, disponível na página da SOLACTIVE: <https://www.solactive.com/documents/equity-index-methodology/>

O ÍNDICE está publicado na página do ADMINISTRADOR DO ÍNDICE (<https://www.solactive.com/>) e, além disso, está disponível por meio dos serviços de marketing de preços da Boerse Stuttgart GmbH e pode ser distribuído a todos os fornecedores. Cada fornecedor decide individualmente como distribuirá ou divulgará o ÍNDICE por meio de seus sistemas de informação.

Qualquer publicação em relação ao ÍNDICE (por ex., avisos, alterações da DIRETRIZ) será disponibilizada na página do ADMINISTRADOR DO ÍNDICE: <https://www.solactive.com/news/announcements/>.

## 1.3. NÍVEL INICIAL DO ÍNDICE

O ÍNDICE é baseado em 1000 no fechamento da negociação em 26/03/2019, a DATA DE INÍCIO.

## 1.4. FREQUÊNCIA DE PREÇOS E CÁLCULO

O nível do ÍNDICE é calculado em cada DIA DE CÁLCULO das 9:00 às 22:30 CET baseado nos PREÇOS DE NEGOCIAÇÃO das TROCAS nas quais os COMPONENTES DO ÍNDICE são listados. PREÇOS DE NEGOCIAÇÃO dos



COMPONENTES DOS ÍNDICE não listados no ÍNDICE DE MOEDAS são convertidos usando a taxa de câmbio atual do CÂMBIO Intercontinental (ICE). Se não houver nenhum PREÇO DE NEGOCIAÇÃO atual para um COMPONENTE DE ÍNDICE, o último entre: (i) o mais recente PREÇO DE FECHAMENTO; ou (ii) o último PREÇO DE NEGOCIAÇÃO disponível para o DIA DE NEGOCIAÇÃO anterior será usado no cálculo.

Além do cálculo do intraday, também é calculado um nível de fechamento do ÍNDICE para cada DIA DE CÁLCULO. O nível de fechamento é baseado nos PREÇOS DE FECHAMENTO para os COMPONENTES DO ÍNDICE na respectiva BOLSA DE VALORES onde os COMPONENTES DO ÍNDICE estão listados. Os PREÇOS DO FECHAMENTO dos COMPONENTES DO ÍNDICE não listados no ÍNDICE DE MOEDAS são convertidos usando a cotação do WM Fixing da Reuters às 16h (horário de Londres). Se não houver WM Fixing às 16h (horários de Londres) para o DIA DE CÁLCULO pertinente, o último WM Fixing às 16h (horário de Londres) disponível será usado para o cálculo do nível de fechamento.

## 1.5. LICENCIAMENTO

As licenças para o uso do ÍNDICE como valor fundamental dos instrumentos financeiros, fundos de investimentos e contratos financeiros podem ser emitidas a bolsa de valores, bancos, fornecedores de serviços financeiros e casas de investimentos pela SOLACTIVE.



## 2. SELEÇÃO DO ÍNDICE

Em cada DIA DE SELEÇÃO, o ADMINISTRADOR DO ÍNDICE revisará a composição do ÍNDICE.

Primeiro, o ADMINISTRADOR DO ÍNDICE determina o UNIVERSO DO ÍNDICE de acordo com a Seção 2.1. O UNIVERSO DO ÍNDICE compreende todos aqueles instrumentos financeiros que cumprem os REQUISITOS DO UNIVERSO DO ÍNDICE (como especificado na Seção 2.1) e constituirá um pool inicial de onde os componentes do ÍNDICE serão selecionados. Baseado nesse UNIVERSO DO ÍNDICE, a nova composição do ÍNDICE será determinada, aplicando as regras descritas na Seção 2.2. Uma revisão trimestral dos COMPONENTES DO ÍNDICE ocorrerá seguindo as regras descritas na Seção 2.3.

A cada COMPONENTE DO ÍNDICE será atribuído um peso, como descrito na Seção 2.4.

### 2.1. REQUISITOS DO UNIVERSO DO ÍNDICE

O UNIVERSO DO ÍNDICE é composto por todos os instrumentos financeiros que cumprem os requisitos abaixo (os "**REQUISITOS DO UNIVERSO DO ÍNDICE**");

- 1) Listagem em uma BOLSA DE VALORES na forma de ações negociáveis para investidores estrangeiros sem restrições nos países desenvolvidos ou países emergentes, como determinado pela Estrutura de Classificação de Países da SOLACTIVE. Além disso, ADRs de qualquer empresa cuja listagem primária está em um país que faça parte dos Mercados Emergentes são elegíveis. A estrutura e as listas de países estão disponíveis na página da SOLACTIVE: <https://www.solactive.com/documents/solactive-country-classification/>
- 2) CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO de, pelo menos, US\$ 200 milhões para empresas que não são COMPONENTES DO ÍNDICE no Dia da Seleção respectivo. Empresas que são COMPONENTES DO ÍNDICE no DIA DA SELEÇÃO respectivo são sujeitas a uma CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO mínima de pelo menos US\$ 160 milhões.
- 3) Valor de comercialização diário médio mínimo de pelo menos US\$ 2 milhões em 6 meses antes e inclusive no Dia da Seleção, para empresas que não são COMPONENTES DO ÍNDICE no DIA DA SELEÇÃO respectivo. Empresas que são COMPONENTES DO ÍNDICE no DIA DA SELEÇÃO respectivo, são sujeitas a um valor de comercialização diário médio mínimo de pelo menos US\$ 1,4 milhão em 6 meses antes e inclusive no DIA DA SELEÇÃO.
- 4) Percentual de FLUTUAÇÃO LIVRE do total de ações restantes de pelo menos 10% ou uma capitalização de mercado de FLUTUAÇÃO LIVRE mínima de US\$ 1 bilhão.
- 5) Somente empresas classificadas como economia de "assistência médica" no sistema de classificação FactSet Industries and Economic Sectors são elegíveis.

A determinação do UNIVERSO DO ÍNDICE é baseada integralmente em regras e o ADMINISTRADOR DO ÍNDICE não pode tomar decisões discricionárias.



## 2.2. SELEÇÃO DOS COMPONENTES DO ÍNDICE

Baseado no UNIVERSO DO ÍNDICE, a composição inicial do ÍNDICE é determinada no DIA DA SELEÇÃO de acordo com as seguintes regras (os "**REQUISITOS DO COMPONENTE DO ÍNDICE**").

- 1) Usando as empresas no UNIVERSO DO ÍNDICE como definido na Seção 2.1, a seleção é feita com base na avaliação de informações publicamente disponíveis, como sites financeiros, motores de busca ou publicações de empresas usando um algoritmo de processamento de língua natural.
- 2) Usando palavras chaves que descrevam o tema do ÍNDICE, o algoritmo identifica empresas que tenham ou esperam ter uma exposição significativa nas áreas da genômica.
- 3) Então, o algoritmo classifica as empresas de acordo com a frequência com que se faz referência à empresa em relação às palavras chaves específicas ("Pontuação do Índice"). Então, as empresas são revisadas para garantir a importância ao segmento com base nas operações comerciais. As empresas que não têm exposição relevante aos negócios do tema são elegíveis para remoção nesta fase.
- 4) As empresas só são elegíveis se gerarem pelo menos 50% de suas receitas a partir de operações comerciais relacionadas à genômica e/ou forem classificadas como sendo de "biotecnologia", de acordo com o sistema de classificação FactSet Industries and Economic Sectors. As operações comerciais da genômica incluem o seguinte: (i) edição de genes (ii) sequenciamento genômico (iii) desenvolvimento e teste de medicina/terapia genética e/ou (iv) genômica computacional e diagnóstico genético. Se uma empresa for uma potencial candidata para inclusão devido à sua classificação como sendo de "biotecnologia", sua exposição ao campo da genômica é avaliada mais a fundo e confirmada pela análise das despesas de P&D da empresa, pipeline de produtos e segmentos operacionais de negócios. As empresas restantes são classificadas pela sua pontuação no ÍNDICE, e as 40 empresas com melhor classificação são definidas como constituintes do ÍNDICE final.
- 5) Se houver duas ou mais empresas que dividem a última classificação, a preferência será dada à empresa com o maior volume diário médio nos últimos 6 meses.

Para qualquer seleção futura, as regras seguintes se aplicam:

- A) Uma empresa que esteja atualmente no ÍNDICE só é excluída se não tiver mais uma pontuação positiva no ÍNDICE ou gerar menos que 50% das suas receitas de operações comerciais relacionadas à genômica e/ou não for mais classificada como sendo de "biotecnologia".
- B) Caso haja houver 40 constituintes no dia da seleção, uma nova empresa só é adicionada se sua pontuação no ÍNDICE estiver na 10ª posição ou superior e ela derivar pelo menos 50% da sua receita



da genômica, e/ou for classificada como sendo de "biotecnologia" e passar a análise adicional. Nesse caso, a empresa com classificação em último na seleção atual é removida.

A seleção dos COMPONENTES DO ÍNDICE é baseada integralmente em regras e o ADMINISTRADOR DO ÍNDICE não pode tomar decisões discricionárias.

### 2.3. PONDERAÇÃO DOS COMPONENTES DO ÍNDICE

Cada COMPONENTE DO ÍNDICE do ÍNDICE de genômica da Solactive é ponderado de acordo com a Capitalização de Mercado de Flutuação Livre, sujeito aos seguintes critérios:

- 1) O peso máximo de uma empresa é 4,0%.
- 2) O peso máximo de uma empresa com capitalização de mercado maior que US\$ 50 bilhões é 2,0%.
- 3) O peso mínimo de uma empresa é 0,3%.
- 4) Se uma empresa estava sujeita à restrição b) no dia da seleção anterior e sua capitalização de mercado não estiver abaixo de US\$ 40 bilhões no dia da seleção atual, o peso máximo da empresa é de 2,0%.

O peso excedente que resulte da implementação dessas restrições será redistribuído proporcionalmente de tal forma que nenhuma dessas restrições seja violada.





## 3. REBALANCEAMENTO

### 3.1. REBALANCEAMENTO ORDINÁRIO

A fim de refletir a nova seleção dos COMPONENTES DO ÍNDICE determinados no DIA DA SELEÇÃO (de acordo com a Seção 2.1 e 2.2) o ÍNDICE é ajustado no DIA DO AJUSTE após o FECHAMENTO DOS NEGÓCIOS.

Isso é realizado ao se implementar as ações como determinado no DIA DA SELEÇÃO com base nas ponderações calculadas no DIA DA SELEÇÃO.

Para mais informações sobre o procedimento de rebalanceamento, consulte a Metodologia do Índice de Patrimônio, que está incorporada como referência e disponível na página da Solactive: <https://www.solactive.com/documents/equity-index-methodology/>.

A SOLACTIVE publicará quaisquer alterações feitas nos COMPONENTES DO ÍNDICE com aviso suficiente antes do DIA DO REBALANCEAMENTO na página da SOLACTIVE nos termos da seção "Avisos", disponível em <https://www.solactive.com/news/announcements/>.

### 3.2. REBALANCEAMENTO EXTRAORDINÁRIO

O ÍNDICE não será rebalanceado extraordinariamente.



## 4. CÁLCULO DO ÍNDICE

### 4.1. FÓRMULA DO ÍNDICE

O ÍNDICE é calculado como um Índice de retorno total líquido.

O cálculo é feito de acordo com a Metodologia do Índice de Patrimônio, disponível no site da SOLACTIVE: <https://www.solactive.com/documents/equity-index-methodology/>. A fórmula do divisor do Índice estipula que o nível do Índice muda com base na alteração dos preços dos seus Componentes do Índice, levando em conta o seu peso no Índice e toda conversão de moedas no caso do preço de um Componente do Índice cotado em uma outra moeda que não a Moeda do Índice.

Todos os dividendos e demais distribuições são reinvestidas na cesta integral dos COMPONENTES DO ÍNDICE por meios de um divisor na abertura da data efetiva (conhecida como data ex) do pagamento de tal dividendo ou outra distribuição.

Uma descrição mais detalhada do mecanismo da fórmula do cálculo do ÍNDICE pode ser encontrada na Metodologia do ÍNDICE de Patrimônio na Seção 1.2.

### 4.2. PRECISÃO

O nível do ÍNDICE será arredondado a 4 casas decimais. Os divisores serão arredondados a seis casas decimais. Os PREÇOS DE NEGOCIAÇÃO e as taxas de CÂMBIO serão arredondados a seis casas decimais.

### 4.3. AJUSTES

Em certas circunstâncias, um ajuste do ÍNDICE pode ser necessário entre dois DIAS DE REBALANCEAMENTO regulares. Esse ajuste deve ser feito se ocorrer uma ação empresarial (como especificado na Seção 4.4 abaixo) em relação a um COMPONENTE DO ÍNDICE. Esse ajuste pode ser feito em relação a um COMPONENTE DO ÍNDICE e/ou pode afetar o número de COMPONENTES DE ÍNDICE e/ou a ponderação de alguns COMPONENTES DO ÍNDICE e será feito em conformidade com a Metodologia do Índice do Patrimônio da Solactive, que está incorporada como referência e disponível na página da SOLACTIVE: <https://www.solactive.com/documents/equity-index-methodology/>.

A Solactive anunciará o ajuste do Índice notificando em um período de, pelo menos, dois Dias de Negociação (relativo ao Componente do Índice afetado) na página da Solactive na Seção "Avisos", disponível em <https://www.solactive.com/news/announcements/>. Os ajustes do ÍNDICE serão implementados no dia efetivo especificado no aviso respectivo.



## 4.4. AÇÕES EMPRESARIAIS

Como parte da manutenção do ÍNDICE, a SOLACTIVE considerará vários eventos – também denominados ações empresariais – que resultem em um ajuste do ÍNDICE entre dois rebalanceamentos regulares. Esses eventos têm um impacto material no preço, na ponderação ou na integridade em geral dos COMPONENTES DO ÍNDICE. Conseqüentemente, precisam ser contabilizados no cálculo do ÍNDICE. Ações empresariais serão implementadas da data cum à data ex da ação empresarial, para que o ÍNDICE coincida com a ocorrência do preço efetivo da respectiva ação empresarial.

Os ajustes do ÍNDICE que contam para ações empresariais serão feitos em conformidade com a Metodologia do Índice de Patrimônio, disponível na página da SOLACTIVE: <https://www.solactive.com/documents/equity-index-methodology/>. Este documento contém uma definição curta para cada ação empresarial, e especifica o ajuste relevante às variáveis do ÍNDICE.

Embora a SOLACTIVE tenha o objetivo de criar e manter sua metodologia para tratamento das ações empresariais o mais genérica e transparente possível e em linha com os requisitos regulatórios, ela retém o direito, de acordo com a Metodologia do Índice do Patrimônio, de se desviar desses procedimentos padrão no caso de ação empresarial incomum ou complexa, ou caso esse desvio seja feito para preservar a comparabilidade e a representatividade do ÍNDICE ao longo do tempo.

A **Solactive** CONSIDERA A SEGUINTE LISTA NÃO EXAUSTIVA DE AÇÕES CORPORATIVAS COMO RELEVANTES PARA A MANUTENÇÃO DO **Índice**:

- > Distribuições do Caixa (por ex., pagamento de dividendo)
- > Distribuições de Ações (por ex., pagamento de um dividendo na forma de ações adicionais)
- > Distribuições de ações de outra empresa (por ex., pagamento de um dividendo na forma de ações adicionais de outra empresa (por ex., de uma subsidiária))
- > Fracionamento de Ações (as ações atuais da empresa são divididas e conseqüentemente multiplicadas por um fator determinado)
- > Reversão do fracionamento (as ações atuais da empresa são efetivamente incorporadas)
- > Aumento de capital (tais como emissão de ações adicionais)
- > Recompra de ação (uma empresa oferece a seus acionistas a opção de vender suas ações a um preço fixo)
- > Spin-offs (a empresa fraciona suas atividades empresariais em duas ou mais entidades e distribui novas ações patrimoniais nas entidades criadas aos acionistas da entidade antiga)
- > Incorporações e Aquisições (transação em que a propriedade de uma empresa (ou outras organizações empresariais) são transferidas ou consolidadas a outras entidades, por ex. fusão de duas ou mais empresas separadas em uma entidade).
- > Delistagem (as ações da empresa não são mais negociadas de maneira aberta em uma BOLSA DE VALORES)



- > Nacionalização de uma empresa (o controle efetivo de uma pessoa jurídica é assumido por um estado)
- > Insolvência

## 4.5. RECÁLCULO

A SOLACTIVE faz grandes esforços para calcular e manter seus índices com precisão. Entretanto, podem ocorrer erros na determinação do processo de tempos em tempos por várias razões (internas ou externas) e, por isso, não podem ser completamente descartados. A Solactive se esforça em corrigir todos os erros que sejam identificados dentro de um prazo de tempo razoável. O entendimento de "um prazo de tempo razoável", assim como medidas gerais a serem tomadas, depende, em geral, do fundamento e está especificado na Política de Correção da Solactive, que está incorporada como referência e disponível na página da Solactive: <https://www.solactive.com/documents/correction-policy/>.

## 4.6. PERTURBAÇÃO DO MERCADO

Em tempos de estresse no mercado, a SOLACTIVE calcula seus índices seguindo arranjos pré-definidos e exaustivos como descritos na Política de Perturbação da Solactive, que está incorporada como referência e está disponível na página da SOLACTIVE: <https://www.solactive.com/documents/disruption-policy/>. Esse estresse do mercado pode surgir por várias razões, mas geralmente resulta em preços sem precisão ou com atraso para um ou mais COMPONENTES DO ÍNDICE. A determinação do ÍNDICE pode ser limitada ou prejudicada em tempos de mercados ilíquidos ou fragmentados e estresse do mercado.



## 5. DISPOSIÇÕES DIVERSAS

### 5.1. CRITÉRIO

Qualquer critério que deva ser exercido em relação à determinação do ÍNDICE (por exemplo, a determinação do UNIVERSO DO ÍNDICE (se aplicável), a seleção dos COMPONENTES DO ÍNDICE (se aplicável) ou qualquer outra decisão relevante em relação ao ÍNDICE) deve ser feita de acordo com regras rígidas relativas ao exercício do critério ou julgamento do especialista.

### 5.2. REVISÃO DA METODOLOGIA

A metodologia do ÍNDICE está sujeita a revisão regular, pelo menos anualmente. Caso uma necessidade de alteração da metodologia tenha sido identificada em tal revisão (por ex., o mercado subjacente ou a realidade econômica tenham sido alterados desde o lançamento do ÍNDICE, por ex., se a presente metodologia tem como base premissas e fatores obsoletos e não mais reflete a realidade de forma precisa, confiável e apropriada como anteriormente), tal alteração será feita de acordo com a Política de Metodologia da Solactive, que está incorporada como referência e disponível na página da SOLACTIVE: <https://www.solactive.com/documents/methodology-policy/>.

Tal alteração na metodologia será anunciada na página da SOLACTIVE na Seção "Avisos", disponível em <https://www.solactive.com/news/announcements/>. A data da última alteração deste ÍNDICE está na DIRETRIZ.

### 5.3. ALTERAÇÕES NO MÉTODO DE CÁLCULO

A aplicação do ADMINISTRADOR DO ÍNDICE do método descrito acima neste documento será definitiva e obrigatória. O ADMINISTRADOR DO ÍNDICE aplicará o método descrito acima para a composição e cálculo do ÍNDICE. Entretanto, não se pode excluir que razões do ambiente do mercado, supervisionais, jurídicas e financeiras ou tributárias possam exigir quer sejam feitas mudanças neste método. O ADMINISTRADOR DO ÍNDICE pode também alterar termos e condições do ÍNDICE e o método aplicado para calcular o ÍNDICE como julgar necessário e desejável para prevenir erro óbvio ou demonstrável ou para reparar, corrigir, ou suplementar termos e condições incorretos. O ADMINISTRADOR DO ÍNDICE não está obrigado a prestar informações de tais modificações ou alterações. Apesar das modificações ou alterações, o ADMINISTRADOR DO ÍNDICE tomará medidas apropriadas para garantir que se aplique um método de cálculo que seja consistente com o método descrito acima.



## 5.4. TÉRMINO

A SOLACTIVE faz grandes esforços para garantir a resiliência e a integridade contínua de seus índices ao longo do tempo. Quando necessário, a SOLACTIVE segue um procedimento transparente e definido de forma clara para adaptar metodologias de ÍNDICE em mercados subjacentes em mudança (veja Seção 5.2 "Revisão da Metodologia") a fim de manter a confiabilidade contínua e comparabilidade dos índices. No entanto, se não há outras opções disponíveis, o término ordenado do ÍNDICE será indicado. Geralmente ocorre quando o mercado fundamental ou a realidade econômica que o ÍNDICE foi estabelecido para medir ou refletir muda substancialmente e de forma imprevisível no momento de criação do ÍNDICE, das regras do ÍNDICE e, particularmente, dos critérios de seleção, não podendo mais ser aplicado de forma coerente, ou quando o ÍNDICE não é mais usado como valor subjacente para instrumentos financeiros, fundos de investimentos e contratos financeiros.

A SOLACTIVE estabeleceu e mantém as diretrizes claras sobre como identificar situações em que o encerramento de um ÍNDICE é inevitável, como as partes interessadas são informadas e consultadas, além dos procedimentos a serem seguidos no caso do término ou transição a um ÍNDICE alternativo. Os detalhes estão especificados na Política de Término da Solactive, que está incorporada como referência e disponível na página da SOLACTIVE: <https://www.solactive.com/documents/termination-policy/>.

## 5.5. SUPERVISÃO

Um comitê de supervisão composto por pessoal da SOLACTIVE e suas subsidiárias (o "**COMITÊ DE SUPERVISÃO**") são responsáveis pelas decisões relativas a quaisquer alterações das regras do ÍNDICE. Qualquer alteração, que pode resultar em alteração da DIRETRIZ, deve ser submetida ao COMITÊ DE SUPERVISÃO para aprovação prévia e será feita em conformidade com a Política de Metodologia, disponível na página da SOLACTIVE: <https://www.solactive.com/documents/methodology-policy/>.



## 6. DEFINIÇÕES

“**DIA DO AJUSTE**” é a segunda sexta-feira de novembro, se essa sexta-feira de novembro não for um DIA DE NEGOCIAÇÃO, o rebalanceamento é adiado para o DIA DE NEGOCIAÇÃO.

“**REGULAMENTO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA**” deve conter o significado como definido na Seção "Introdução".

“**RIR**” deve conter o significado como definido na Seção "Introdução".

“**DIA ÚTIL**” é qualquer dia da semana de segunda-feira a sexta-feira.

“**DIA DO CÁLCULO**” é todo dia da semana de segunda-feira a sexta-feira.

“**FECHAMENTO DOS NEGÓCIOS**” é o tempo de cálculo do nível de fechamento do ÍNDICE como estabelecido na Seção 1.4.

O “**PREÇO DE FECHAMENTO**” em relação a um COMPONENTE DO ÍNDICE e um DIA DE NEGOCIAÇÃO é o PREÇO DE NEGOCIAÇÃO final de um título em horário regular, publicado pela BOLSA DE VALORES e determinado de acordo com os regulamentos da BOLSA DE VALORES. Se a BOLSA DE VALORES não tem nenhum ou não publicou um PREÇO DE FECHAMENTO segundo as regras da BOLSA DE VALORES para um COMPONENTE DO ÍNDICE, o último PREÇO DE NEGOCIAÇÃO será usado.

“**BOLSA DE VALORES**” significa, em relação ao ÍNDICE e cada COMPONENTE DO ÍNDICE, a respectiva BOLSA DE VALORES em que o COMPONENTE DO ÍNDICE esteja listado como determinado, de acordo com as regras da Seção 2.

A “**FLUTUAÇÃO LIVRE**” é, em relação a cada título que cumpre os REQUISITOS DO COMPONENTE DO ÍNDICE em um DIA DE SELEÇÃO, a fração de classe de ação específica do número total de ações de cada classe de ação que esteja disponível para negociação pelos participantes do mercado, não bloqueada pelos titulares de longo prazo, como informado por fornecedores de dados.

A “**CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO**” é, em relação a cada título que cumpre os REQUISITOS DO COMPONENTE DO ÍNDICE em um DIA DE SELEÇÃO, a capitalização de mercado da classe de ação específica. É calculado pela multiplicação das ações em circulação com o PREÇO DE FECHAMENTO da classe de ação no respectivo DIA DE SELEÇÃO.

“**DIRETRIZ**” deve conter o significado como definido na Seção "Introdução".

“**ÍNDICE**” deve conter o significado como definido na Seção "Introdução".

“**ADMINISTRADOR DO ÍNDICE**” deve conter o significado como definido na Seção "Introdução".

“**COMPONENTE DO ÍNDICE**” significa cada título refletido no ÍNDICE.

“**REQUISITOS DO COMPONENTE DO ÍNDICE**” terá o significado definido na Seção 2.2.

“**MOEDA DO ÍNDICE**” é a moeda especificada na coluna "Moeda" na tabela da Seção 1.2.

“**REQUISITOS DO UNIVERSO DO ÍNDICE**” deve conter o significado como definido na Seção 2.1.



“**UNIVERSO DO ÍNDICE**” é a soma de todos os instrumentos financeiros que cumprem os REQUISITOS DO UNIVERSO DO ÍNDICE.

“**DATA DO LANÇAMENTO**” deve conter o significado como definido na Seção 1.3.

“**COMITÊ DE SUPERVISÃO**” deve conter o significado como definido na Seção 5.5.

“**DIA DA SELEÇÃO**” são 12 DIAS ÚTEIS antes do DIA DO AJUSTE, desconsiderando qualquer potencial mudança do **DIA DO AJUSTE**.

“**SOLACTIVE**” deve conter o significado como definido na Seção "Introdução".

“**DATA DE INÍCIO**” terá o significado definido na Seção 1.3.

“**DIA DE NEGOCIAÇÃO**” diz respeito a um COMPONENTE DO ÍNDICE incluído no ÍNDICE no DIA DE REBALANCEAMENTO, bem como todo COMPONENTE DO ÍNDICE incluído no ÍNDICE no DIA DE CÁLCULO imediatamente seguinte ao DIA DO REBALANCEAMENTO (esclarecendo: o objetivo desta disposição é capturar os DIAS DE NEGOCIAÇÃO para os títulos a serem incluídos no ÍNDICE como novos COMPONENTES DO ÍNDICE ao encerramento do pregão na BOLSA DE VALORES relevante no DIA DO REBALANCEAMENTO), um dia em que a BOLSA DE VALORES relevante estiver aberta para negociação (ou um dia que poderia ter sido como tal, se não tivesse ocorrido uma perturbação no mercado), excluindo dias em que a negociação possa ter cessado antes do horário de fechamento programado da BOLSA DE VALORES, bem como dias em que a BOLSA DE VALORES estiver aberta por um período programado reduzido. O ADMINISTRADOR DO ÍNDICE será o responsável final se um certo dia for um DIA DE NEGOCIAÇÃO.

O “**PREÇO DE NEGOCIAÇÃO**” relativo a um COMPONENTE DO ÍNDICE e um DIA DE NEGOCIAÇÃO será o preço publicado mais recente ao qual o COMPONENTE DO ÍNDICE foi negociado na respectiva BOLSA DE VALORES.



# CONTATO

**Solactive AG**  
**German Index Engineering**

Platz der Einheit 1  
60327 Frankfurt am Main  
Alemanha

Tel.: +49 (0) 69 719 160 00

Fax: +49 (0) 69 719 160 25

E-mail: [info@solactive.com](mailto:info@solactive.com)

Website: [www.solactive.com](http://www.solactive.com)

© Solactive AG