



**Índice NYSE<sup>®</sup>FANG+<sup>™</sup>  
(NYFANG)**

Version 2.1  
Válido à partir  
de 15 de  
junho, 2018

## Índice

Histórico das Versões .....	1
1.1 Resumo do Índice .....	2
1.2 Símbolos e Variantes do Índice.....	3
2. Governança.....	4
3. Descrição do Índice.....	6
4. Divulgação .....	7
4.1 Divulgação dos valores do Índice na abertura, durante o pregão, no fechamento ou diariamente	7
4.2 Condições excepcionais de mercado e correções.....	8
4.3 Mudanças no Índice .....	8
5. Cálculo .....	11
5.1 Cálculo do Índice .....	11
6. Rebalanceamentos do Índice .....	12
6.1 Objectivo geral dos rebalanceamentos e frequência .....	12
6.2 Universo do Índice e critérios de seleção .....	12
6.3 Atualização periódica das ponderações .....	13
7. Ações Corporativas .....	14
7.1 Geral.....	14
8. Disclaimer .....	15

## Historico das Versões:

### **Versão 2.1 (Entrada em vigor 15 junho, 2018)**

Esta versão incorpora uma mudança no cronograma de divulgação de rebalanceamentos e adiciona um índice de valor de liquidação diário e os variantes de 2x, 1,5x, -1x, -2x, -1,5x o Preço Alavancado e Retorno Total.

### **Versão 2.0 (Entrada em vigor 20 abril, 2018)**

O novo formato da metodologia do Índice NYSE® FANG +™ (NYFANG) está sendo lançado para dar mais detalhes e oferecer maior clareza a respeito da governança, estrutura e manutenção do Índice. Também está sendo realizado uma atualização da data de divulgação dos rebalanceamentos trimestrais do Índice, a correção dos cálculos do Índice e a política de divulgação. Variantes do Índice em outras moedas também estão sendo incluídas na metodologia.

**Versão 1.0 (Entrada em vigor 26 setembro 2017)**

O documento da metodologia engloba o recém-lançado Índice NYSE® FANG +™.

## 1.1 Sumário do Índice

<b>Ficha Informativa</b>	
<b>Nomes Completos</b>	NYSE® FANG+™ Index
<b>Tipos e Símbolos do Índice</b>	Ver quadro abaixo
<b>Descrição do Índice</b>	<p>O Índice NYSE® FANG +™ é um índice em dólares igualmente ponderado, desenhado para representar um segmento dos setores de tecnologia e consumo discricionário composta por ações de crescimento de empresas de tecnologia, ou que usam tecnologia para desenvolver suas atividades, e que são altamente negociadas, como Facebook®, Apple®, Amazon®, Netflix®, and Google da Alphabet®. Os índices NYSE FANG + Leveraged e Inverse são projetados para oferecer exposição aos retornos diários alavancados ou inversos do Índice NYSE FANG + subjacente, de acordo com a proporção pertinente, sem incorporar os retornos provenientes de taxas de juros e / ou encargos de financiamento. Composições do Índice e ações corporativos, incluindo informações sobre rebalanceamento, podem ser acessados da NYSE Market Data na website <a href="https://www.theice.com/market-data/indices/equity-indices/products">https://www.theice.com/market-data/indices/equity-indices/products</a>.</p>
<b>Ações Elegíveis</b>	Ações ordinárias e ADRs listadas numa das principais bolsas de valores dos EUA (NYSE, NASDAQ, NYSE American)
<b>Número de Constituintes</b>	Varia, com um mínimo de 10 ações / o Índice tinha 10 ações no lançamento
<b>Ponderação</b>	Igualmente Ponderado
<b>Revisão da Composição</b>	Divulgado trimestralmente em marco, junho, setembro e dezembro após o fechamento da segunda sexta feira do mês.
<b>Data Efetiva do Rebalanceamento</b>	Trimestralmente após o fechamento na terceira sexta feira de março, junho, setembro e dezembro
<b>Data Base</b>	19 de setembro, 2014
<b>Nível Base</b>	1000.00
<b>Dados Históricos Disponíveis à Partir de</b>	19 de setembro, 2014

<b><i>Data do Lançamento</i></b>	26 de setembro, 2017
<b><i>Website</i></b>	<a href="https://www.theice.com/market-data/indices">https://www.theice.com/market-data/indices</a>

## 1.2 Símbolos dos Índices e Variantes

Tipo de Índice	Símbolo	Nome do Índice	Moeda	Frequência de Cálculo	Reuters	Bloomberg
Retorno do Preço	NYFANG	NYSE® FANG+™ Index	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.NYFANG	NYFANG INDEX
Retorno Total Bruto	NYFANGT	NYSE® FANG+™ Index (TR)	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.NYFANGT	NYFANGT INDEX
Valor de Liquidação da Abertura	NYFANGST	NYSE® FANG+™ Index	USD	Mensalmente na 3. sexta feira	.NYFANGST	NYFANGST INDEX
Valor de Liquidação da Abertura Diária	FANGST	NYSE® FANG+™ Index	USD	Uma vez por dia entre 09:30 & 18:00 ET	.FANGST	FANGST INDEX
Retorno do Preço	NYFANGJ	NYSE® FANG+™ Index (JPY)	JPY	Uma vez por dia após 10:00 JST	.NYFANGJ	NYFANGJ INDEX
Retorno Total Bruto	NYFANGJT	NYSE® FANG+™ Index TR (JPY)	JPY	Uma vez por dia após 10:00 JST	.NYFANGJT	NYFANGJT INDEX
2x Retorno do Preço	FANG2X	NYSE® FANG+™ Daily 2x Leveraged Index	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.FANG2X	FANG2X INDEX
1.5x Retorno do Preço	FANG15X	NYSE® FANG+™ Daily 1.5x Leveraged Index	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.FANG15X	FANG15X INDEX
-1x Retorno do Preço	DFANG1X	NYSE® FANG+™ Daily 1x Inverse Index	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.DFANG1X	DFANG1X INDEX
-2x Retorno do Preço	DFANG2X	NYSE® FANG+™ Daily 2x Inverse Index	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.DFANG2X	DFANG2X INDEX
-1.5x Retorno do Preço	DFNG15X	NYSE® FANG+™ Daily 1.5x Inverse Index	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.DFNG15X	DFNG15X INDEX
2x Retorno Total Bruto	FANGT2X	NYSE® FANG+™ Daily 2x Leveraged Index (TR)	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.FANGT2X	FANGT2X INDEX
1.5x Retorno Total Bruto	FANGT15X	NYSE® FANG+™ Daily 1.5x Leveraged Index (TR)	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.FANGT15X	FANGT15X INDEX
-1x Retorno Total Bruto	DFANGT1X	NYSE® FANG+™ Daily 1x Inverse Index (TR)	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.DFANGT1X	DFANGT1X INDEX

-2x Retorno Total Bruto	DFANGT2X	NYSE® FANG+™ Daily 2x Inverse Index (TR)	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.DFANGT2X	DFANGT2X INDEX
-1.5x Retorno Total Bruto	DFNGT15X	NYSE® FANG+™ Daily 1.5x Inverse Index (TR)	USD	15 segundos entre 09:30 & 18:00 ET	.DFNGT15X	DFNGT15X INDEX

## 2. Governança

### Patrocinador e Administrador do Índice

ICE Data Indices, LLC (“IDI”) é o Patrocinador e Administrador do Índice.

A IDI é responsável pela gestão diária do Índice, incluindo o exercício da responsabilidade primordial por todos os aspectos do processo de determinação do Índice, incluindo a implementação de governança e supervisão adequadas, conforme exigido pelos Princípios da Organização Internacional de Comissões de Valores Mobiliários para Benchmarks Financeiras (os Princípios da IOSCO). O Comitê de Governança é responsável por ajudar a garantir a conformidade geral da IDI com os Princípios da IOSCO, desempenhando a Função de Supervisão que inclui supervisionar o desenvolvimento do Índice, desenho, emissão e operação dos índices, bem como revisar a estrutura de controle. A IDI também é responsável pelas decisões relativas à interpretação dessas regras e o Comitê de Governança é responsável por revisar todas as modificações do manual de regras e mudanças nos constituintes do Índice para garantir que sejam feitas de forma objetiva, sem viés, e de acordo com a legislação e regulamentos aplicáveis e políticas e procedimentos da IDI. Consequentemente, todas as discussões e decisões da IDI e do Comitê de Governança são confidenciais até que sejam divulgadas ao público.

### Casos não contempladas pelas regras

Nos casos não expressamente contemplados nestas regras, ocorrerão ajustes operacionais em linha com o objetivo do Índice. Ajustes operacionais também podem ocorrer se, na opinião do Administrador do Índice, for desejável fazê-lo para manter um mercado justo e ordenado de derivativos neste Índice e / ou isso for nos melhores interesse dos investidores em produtos baseados no Índice e / ou o bom funcionamento dos mercados.

Quaisquer modificações descritas nesta seção ou o exercício de Juízo Especializado também serão regidos por quaisquer políticas, procedimentos e Diretrizes aplicáveis adotadas pela IDI naquele momento.

### Mudanças no Manual de Regras

O Comitê de Governança revisa todas as modificações do manual de regras e mudanças no Índice para garantir que sejam feitas de forma objetiva, sem viés, e de acordo com a legislação e regulamentações aplicáveis e as políticas e procedimentos da IDI. Essas regras podem ser complementadas e alteradas no todo ou em parte, revisadas ou retiradas a qualquer momento, de acordo com a legislação e regulamentos aplicáveis e as políticas e procedimentos aplicáveis da IDI. Suplementos, alterações, revisões e retiradas também podem levar a mudanças na forma como o Índice é compilado ou calculado ou afetar o Índice de outra forma.

### Limitações do Índice

Todos os índices da NYSE produzidos pela IDI (os "Índices da NYSE") podem estar sujeitos a limitações potenciais, como um declínio no conjunto de títulos elegíveis disponíveis devido aos avanços na tecnologia, mudanças nos gastos de diversos grupos demográficos ou na economia, mudanças nos regulamentos ou regras contábeis, movimentos de consolidação em certos setores ou indústrias, ou outros fatores. Outras limitações podem dizer respeito a capacidade do Benchmark de operar em mercados ilíquidos ou fragmentados.

Por definição, o foco do índice são as indústrias que representam o segmento de alto crescimento dos setores de tecnologia e consumo discricionário, como ações de internet e mídia. À medida que os mercados subjacentes se transformam devido à consolidação do setor e mudanças tecnológicas, as empresas incluídas no Índice irão se ajustar e portanto mudar sua forma de atuar.

A IDI busca gerenciar e mitigar essas limitações por meio do processo de desenho, revisão e supervisão do Benchmark.

### **3. Descrição do Índice**

O NYSE® FANG + Index™ ("NYFANG" ou "Índice") é um índice igualmente ponderado denominado em dólares, projetado para representar um segmento dos setores de tecnologia e consumo discricionário composta por ações de alto crescimento de empresas de tecnologia, ou que usam tecnologia para desenvolver suas atividades, e que são altamente negociadas, como Facebook, Apple, Amazon, Netflix e a Google da Alphabet. Os índices NYSE FANG + Leveraged e Inverse são projetados para oferecer exposição aos retornos diários alavancados ou inversos do Índice NYSE FANG + subjacente, de acordo com a proporção pertinente, sem incorporar os retornos provenientes de taxas de juros e / ou encargos de financiamento.

## **4. Divulgação**

### **4.1 A divulgação dos valores do Índice na abertura, durante o pregão, no fechamento ou diariamente.**

#### **Abertura**

O primeiro nível do Índice é calculado e divulgado por volta das 09:30 ET, na abertura do pregão regular das bolsas de valores dos EUA. Para calcular esse nível utiliza-se os preços mais atualizados disponíveis naquele momento. No caso de constituintes que não foram negociados, cuja negociação for interrompida ou suspensa, ou ainda não abriram, utiliza-se os preços de referência do dia anterior (fechamento oficial da bolsa primária) ou preços estimados (para IPOs, aquisições e ofertas de swap).

#### **Frequência de divulgação**

O nível de retorno do preço em USD e retorno bruto total em USD, preço alavancado em USD e índices de retorno total bruto são, em princípio, divulgados a cada 15 segundos no ICE Data Global Index Feed (ICE Data GIF). Os níveis de índice calculados incorporam o último preço negociado de cada componente no pregão regular, que normalmente ocorre das 09:30 às 16:00 ET. O Índice contém apenas ações listadas e negociadas nos EUA e, portanto, os cálculos intradiários do Índice incorporam as negociações de forma consolidada, de todas as bolsas, incluindo aquelas não designadas como bolsa primária oficial.

Os Índices em USD são calculados das 09:30 às 18:00 ET nos dias especificados como dias úteis do Índice. Os dias úteis do Índice serão classificados como sendo dias em que as bolsas de valores EUA (NYSE, NASDAQ e NYSE American) estão abertos para um pregão parcial ou completo.

O nível do retorno do preço em JPY e retorno bruto total dos Índices em JPY são calculados e publicados uma vez por dia, todos os dias da semana, logo após a divulgação das Cotações da Banco de Tóquio-Mitsubishi UFJ Exchange às 10:00 AM JST.

#### **Nível de fechamento**

O nível de fechamento é o último nível divulgado no dia do pregão e usa os preços oficiais de fechamento do mercado de listagem primária para cada constituinte. No caso de constituintes que não foram negociados, foram interrompidos ou suspensos, ou não abriram naquele dia, utiliza-se os preços de referência do dia anterior (fechamentos oficiais da bolsa primária) ou preços estimados (para IPOs, aquisições e ofertas de swap). Em condições excepcionais de mercado, o Administrador do Índice reserva-se o direito de utilizar outros preços no cálculo do nível de fechamento oficial, conforme indicado abaixo na Secção 4.2.

#### **Fontes de dados**

A Consolidated Tape System (CTS / UDTF) é a principal fonte de dados do mercado para cotações em tempo real e preços de fechamento no EUA. Fontes adicionais de dados menos comumente usados incluem fornecedores de dados de mercado, anúncios de empresas, anúncios de bolsas de valores e outras fontes oficiais. As cotações da Banco de Tokyo-Mitsubishi UFJ Exchange são utilizadas para a conversão cambial e cálculo das variantes do Índice cotadas em JPY.

## 4.2 Condições de mercado excepcionais e correções

O Administrador do Índice reserva-se o direito de atrasar a publicação do nível de abertura do Índice. Além disso, o Administrador do Índice reserva-se o direito de suspender a divulgação do nível do Índice se acreditar que as circunstâncias impedem o cálculo adequado do Índice.

Se os preços constituintes do Índice forem cancelados, o Índice não será recalculado a menos que o Administrador do Índice decida de outra forma.

Esforços razoáveis são feitos para garantir a exatidão e validade dos dados usados nos cálculos do Índice em tempo real. Se os dados incorretos de preços ou ações corporativas afetarem os valores de fechamento diários do Índice, eles serão corrigidos retroativamente o mais rápido possível e todas as revisões serão comunicadas ao público e aos provedores de dados de mercado.

Um evento que afeta a bolsa ou o mercado em geral pode impedir a realização do leilão de fechamento normal ou levar a indisponibilidade dos preços oficiais de fechamento. Nessas situações, o Administrador do Índice seguirá a orientação da (s) respectiva (s) bolsa (s) e endereçará a situação conforme as características específicas do acontecido. Eventos que afetam a bolsa ou o mercado em geral incluem, mas não estão limitados aos seguintes:

- Paradas de Volatilidade
  - LULD (Limite Para Cima / Limite Para Baixo)
  - Circuit Breaker Geral
- Problemas / Falhas Tecnológicas
- Desastre Natural ou Outro Evento Relacionado a PCN

## 4.3 Mudanças no Índice

### **Política de divulgação**

Mudanças na metodologia do Índice serão divulgadas por meio de um anúncio relacionado ao Índice que será distribuído pela IDI via <https://www.theice.com/market-data/indices/equity-indices> e NYSE Market Data em <https://www.theice.com/market-data/indices/equity-indices/products>.

Como regra geral, serão implementados os períodos de anúncio abaixo mencionados. No entanto, ações de Emergência, incluindo ações corporativas urgentemente necessários, muitas vezes resultantes de notificações tardias da empresa ou bolsa em questão, podem exigir que o Administrador do Índice desvie do cronograma de divulgação preestabelecido.

### **Inclusão de novos constituintes**

A inclusão de novas empresas no Índice normalmente ocorrerá apenas durante os rebalanceamentos trimestrais, embora possa haver exceções devido a uma ação corporativa específica que possa afetar um constituinte atual. A inclusão da nova empresa será anunciada

pelo menos uma semana antes da data efetiva da inclusão. Por exemplo, para um rebalanceamento que entra em vigor em 18 de junho de 2018, o anúncio ocorrerá após o fechamento em 6 de junho de 2018.

## **Remoção de Constituintes**

Os componentes serão removidos do Índice como consequência de ações corporativas periódicas, bem como dos resultados dos rebalanceamento trimestrais. Todas as remoções serão anunciadas pelo menos três dias úteis antes da data efetiva da remoção. Ressalte-se que, no caso de fusões e aquisições, todos os esforços serão feitos para remover a empresa em um prazo razoável antes da suspensão a negociação das ações da empresa adquirida. Haverá certas situações e ações corporativas que exigiriam a remoção de uma empresa que já encerrou suas atividades. Nesses casos a empresa será removida do Índice utilizando o último preço negociado ou, a critério do Administrador do Índice, um preço derivado que represente o seu valor pós-suspensão com mais precisão.

## **Ações corporativas**

No caso de um evento que possa afetar um ou mais constituintes, o Administrador do Índice declarará ao mercado como o evento se refletirá no Índice logo depois que os detalhes da empresa estiverem disponíveis e forem confirmados. Quando possível, a ação corporativa será anunciada, mesmo que as informações sejam incompletas, pelo menos um pregão antes da data efetiva da ação. Uma vez efetuada a ação corporativa, o Administrador do Índice confirmará as alterações em um anúncio separado.

## **Mudanças nas regras**

No futuro, exceto em circunstâncias excepcionais, o Administrador do Índice deve anunciar as mudanças propostas nas Regras aos stakeholders antes de serem implementadas. Os stakeholders também serão notificadas sobre quando as alterações entrarão em vigor.

## **Revisões do Índice**

A IDI realizará revisões regulares do Índice, da metodologia e do mercado que ele representa para garantir que continue a cumprir o objetivo do Índice, de acordo com as políticas e procedimentos da IDI. Caso sejam necessárias ou propostas mudanças no Índice, isso será comunicado aos stakeholders de acordo com as políticas e procedimentos da IDI.

## **Consultas**

A IDI pode, de tempos em tempos, consultar os stakeholders sobre as mudanças materiais propostas que afetam o Índice, de acordo com as políticas e procedimentos da IDI, incluindo a política de consultas da IDI: [https://www.theice.com/publicdocs/Consultation\\_Policy.pdf](https://www.theice.com/publicdocs/Consultation_Policy.pdf). Essas propostas devem ser comunicados aos Stakeholders e todos os comentários recebidos serão considerados pelo Administrador do Índice. Quaisquer mudanças resultantes no Índice serão anunciadas antes de sua implementação.

## **Rebalanceamento: Divulgação de Resultados**

A nova composição do Índice, incluindo as empresas que farão parte do Índice e suas correspondentes novas ações do Índice, pode ser acessada no NYSE Market Data no endereço <https://www.theice.com/market-data/indices/equity-indices/products>.

## 5. Cálculo

### 5.1 Cálculo do Índice

O índice é calculado com base no Retorno de Preço e Retorno Total Bruto. O nível atual do Índice será calculado dividindo a capitalização de mercado do índice modificado atual pelo divisor do índice. O divisor é determinado a partir da base de capitalização inicial do Índice e do nível de base. O divisor é atualizado como resultado de ações corporativas e mudanças na composição.

As variantes de Preço Alavancado e Retorno Total Bruto são calculadas multiplicando um fator de alavancagem pelo retorno total bruto em tempo real e aplicando-o ao fechamento do índice de retorno total bruto do dia anterior.

As variantes do Índice cotados em JPY são calculadas utilizando os níveis em USD do Índice e realizando uma conversão utilizando as Cotações do UFJ Exchange do Banco de Tokyo-Mitsubishi divulgadas às 10:00 AM JST.

Uma descrição completa das fórmulas usadas para calcular os valores do Índice pode ser encontrada em "NYSE Indices - Guide to Index Mathematics" no endereço <https://www.theice.com/market-data/indices/equity-indices/methodologies>.

## **6. Rebalanceamentos do Índice**

### **6.1 Objectivo geral de rebalanceamentos e frequência**

#### **Objectivo geral do rebalanceamento periódico**

O objectivo geral do rebalanceamento trimestral do Índice é garantir que a seleção e os pesos dos constituintes continuem a refletir da maneira mais fiel possível o objectivo do Índice de representar um segmento dos setores de tecnologia e consumo discricionário composta das ações mais negociadas de empresas de tecnologia e internet/mídia de empresas caracterizadas pelo seu alto crescimento como Facebook, Apple, Amazon, Netflix e Google da Alphabet. O Administrador do Índice se reserva o direito de, a qualquer momento, alterar o número de ações que compõem o Índice, adicionando ou excluindo uma ou mais ações, ou substituindo uma ou mais ações do Índice por uma ou mais ações substitutas de sua escolha, se a critério do Administrador do Índice, tal adição, exclusão ou substituição é necessária ou apropriada para manter a qualidade e / ou carácter do Índice. Tais alterações nos constituintes do Índice são revisadas pelo Comitê de Governança para garantir que sejam feitas de forma objetiva, sem viés e de acordo com a legislação e regulamentações aplicáveis e as políticas e procedimentos da IDI.

#### **Frequência**

Alterações nos constituintes do Índice podem ocorrer durante um rebalanceamento programado e como consequência da remoção de um constituinte do Índice.

Os rebalanceamentos do NYSE® FANG + Index™ entram em vigor após o fechamento da terceira sexta-feira de março, junho, setembro e dezembro. O anúncio do rebalanceamento será feito após o fechamento da segunda sexta-feira do mês (uma semana antes). A data de referência para todos os dados e informações específicos da empresa utilizados no processo de rebalanceamento será nesse mesmo dia, com exceção dos preços utilizados para determinar as ações que serão os da terceira sexta-feira.

### **6.2 Universo do Índice e os critérios de seleção**

#### **Universo do Índice**

O desenvolvimento e a manutenção do Universo de componentes para o NYSE® FANG + Index™ são realizados pela IDI. O Universo do Índice consistirá em todas as ações classificadas como Consumo Discricionário ou Tecnologia pela IDI que estão listadas em uma das principais bolsa de valores dos EUA como a NYSE, NASDAQ ou NYSE American e são representativas da indústria de tecnologia e Internet/mídia de alto crescimento. Os ADRs são elegíveis para inclusão no Índice. Essa determinação é concluída usando

informações disponíveis publicamente sobre emissores de títulos individuais, bem como sobre o setor. Também é fundamental nesta determinação a experiência dos funcionários da IDI em relação ao desenho e desenvolvimento do Índice e seu conhecimento à respeito do uso do Índice e feedback das stakeholders. A IDI pode alterar a composição do Universo a qualquer momento, para refletir as condições da indústria de tecnologia e Internet / mídia de alto crescimento, e para garantir que o conjunto de títulos componentes continue a representar a indústria, de acordo com os requisitos do Índice.

### **Seleção de constituintes**

A cada rebalanceamento trimestral, o Universo do Índice será rastreado utilizando uma metodologia proprietária. Serão executadas as etapas a seguir:

1. As ações devem ter uma capitalização de mercado (incluindo todas as classes de ações e ações não listadas) de pelo menos US \$ 5 bilhões
2. As ações devem ter um valor negociado diário médio de seis meses (ADTV / volume de negócios) de US \$ 50 milhões.
3. O Comitê de Governança da ICE Data Indices supervisionará um processo para selecionar ações da FANG e ações relacionadas a FANG. As ações da FANG incluem Facebook, Apple, Amazon, Netflix e Google da Alphabet. Outras ações selecionadas para o Índice devem ter características de ações de tecnologia e de internet / mídia de alto crescimento. O Comitê se preocupará em distinguir entre empresas tradicionais de tecnologia e serviços e empresas mais novas e inovadoras que utilizam tecnologia.

## **6.3 Atualização periódica da ponderação**

### **Determinando as ponderações dos constituintes nos Rebalanceamentos Trimestrais do Índice**

Todos os trimestres após o fechamento do mercado na terceira sexta-feira de março, junho, setembro e dezembro, a carteira do Índice é ajustada ponderando os constituintes de forma igualitária com base nos preços e capitalização de mercado do Índice no fechamento.

A carteira recém-ajustada torna-se a base para a determinação do valor do Índice que entrará em vigor no primeiro dia de negociação após os ajustes trimestrais. Se necessário, um ajuste do divisor é feito para garantir a continuidade do valor do Índice.

## 7. Ações Corporativas

### 7.1 Geral

O Índice pode ser ajustado para manter a continuidade do nível e da composição do Índice. O objetivo básico é de garantir que o Índice continue a refletir da forma mais fiel possível o objetivo do Índice de representar um segmento dos setores de tecnologia e consumo discricionário composta das ações de tecnologia e internet / mídia de alto crescimento mais negociadas, como as da Facebook, Apple , Amazon, Netflix e da Google da Alphabet.

Os ajustes são implementados em resposta a eventos envolvendo os constituintes, a fim de mitigar ou eliminar o efeito desse evento no desempenho do Índice.

Uma descrição completa de eventos de ação corporativa padrão e seu tratamento pode ser encontrada nos "Índices NYSE - Guia de Manuseio de Ação Corporativa" no endereço <https://www.theice.com/market-data/indices/equity-indices/methodologies>.

## 8. Disclaimer

Os produtos e serviços mencionados aqui exclusivamente em relação aos Índices da NYSE (cada um deles um "Índice") podem não estar disponíveis em todas as jurisdições. Este documento não constitui uma oferta de serviços em jurisdições ou circunstâncias onde a ICE Data Indices, LLC ("IDI") não possui as licenças ou aprovações necessárias ou apropriadas para a oferta dos produtos e serviços aqui descritos. Cada Índice oferece uma estratégia geral de investimento, não leva em consideração nenhuma das necessidades específicas ou circunstâncias financeiras de qualquer pessoa, entidade ou grupo de pessoas e não deve ser considerado um conselho de investimento. Todas as informações fornecidas pela IDI, incluindo, sem limitação, quaisquer materiais que descrevam qualquer Índice, são apenas de natureza geral.

O desenvolvimento ou criação de qualquer produto financeiro que seja baseado em, desenvolvido em conexão com, ou use direta ou indiretamente qualquer Índice de IDI, incluindo qualquer contrato bilateral, fundo, veículo de investimento ou emissão de valores mobiliários (um "Produto Investível"), é proibido sem o consentimento prévio e escrito da IDI. A IDI não é obrigada a celebrar ou promover Produtos Investíveis ou outras transações ou investimentos que estão vinculados a qualquer Índice ICE ou qualquer um de seus constituintes.

A IDI recebe compensação pelo licenciamento de seus índices a terceiros.

Não é possível investir em um Índice diretamente. A exposição a uma classe de ativos ou setor representado por um Índice ou uma participação que o Índice procura medir pode se feita através de Produtos Investíveis baseados naquele Índice. A IDI não patrocina, endossa, vende, promove ou gerencia, e não revisou ou repassou a legalidade ou adequação ao perfil de qualquer pessoa de qualquer Produto Investível oferecido por terceiros ou qualquer documento, literatura ou publicação associada, incluindo sem limitação, qualquer prospecto ou memorando de oferta. A IDI não garante que os Produtos Investíveis baseados em qualquer Índice replicarão com precisão o desempenho do Índice ou oferecerá retornos de investimento positivos ou não resultarão na perda de parte ou de todo o investimento em tais Produtos Investíveis. A IDI não faz nenhuma representação com relação à conveniência ou adequação de investir ou assumir qualquer risco em relação a tais Produtos investíveis.

Os produtos e serviços descritos neste documento podem não ser adequados para todos os fins e para todos os investidores e a IDI não faz qualquer representação em relação a (a) o nível em que qualquer Índice se encontra em um determinado momento em qualquer data específica, (b) a capacidade de qualquer Índice para acompanhar o desempenho do mercado correspondente (c) os resultados a serem obtidos por qualquer parte pelo uso de qualquer Índice ou quaisquer dados nele incluídos para fins de emissão de títulos ou realização de qualquer transação financeira ou (d) qualquer outro assunto.

A decisão de investir em qualquer Produto de Investimento não deve ser tomada com base em quaisquer das declarações contidas neste documento. Os potenciais investidores devem

considerar cuidadosamente, antes de tomar uma decisão de investir em qualquer Produto Investível, os riscos associados ao investimento em tal Produto Investível, conforme detalhado em um memorando de oferta ou documento semelhante que seja preparado por ou em nome do emissor ou devedor do Produto Investível e se é apropriado para seus propósitos e circunstâncias. Os investidores em potencial devem consultar um advogado, consultor tributário ou profissional de contabilidade a respeito de qualquer situação legal, tributária ou contábil específica, ou do impacto da tomada de qualquer decisão de investimento em particular. A inclusão de um título num Índice não é uma recomendação da IDI para comprar, vender ou manter tal título, nem é considerada um conselho de investimento.

A IDI não tem obrigação de manter ou calcular qualquer índice e pode cancelar ou interromper o cálculo de qualquer índice sem aviso prévio, sujeito aos regulamentos aplicáveis e suas políticas e procedimentos.

A IDI não assume qualquer obrigação ou dever para com qualquer parte em relação a qualquer Índice e em nenhuma circunstância a IDI assume qualquer relação de agência ou fideicomisso ou de natureza fiduciária para ou com qualquer parte. Quaisquer cálculos ou determinações com relação a qualquer Índice ou qualquer parte dele serão feitos pela IDI de acordo com os termos de sua metodologia no momento relevante e agindo de maneira razoável e de boa fé.

A menos que indicado de outra forma, esses materiais foram preparados exclusivamente para fins informativos com base em informações geralmente disponíveis ao público de fontes consideradas confiáveis e estão sujeitos a alterações sem aviso prévio. Nenhum conteúdo contido nestes materiais (incluindo dados de Índice, classificações, análises e dados relacionados a crédito, modelo, software ou produto derivado dele) ou qualquer parte dele ("Conteúdo") pode ser modificado, submetido a engenharia reversa, reproduzido ou distribuído em qualquer forma e por qualquer meio, ou armazenado em um banco de dados ou sistema de recuperação de informações, sem a permissão prévia por escrito da IDI. O Conteúdo não deve ser usado para quaisquer fins ilegais ou não autorizados. Em nenhum caso a IDI terá qualquer responsabilidade (seja por negligência ou de outra forma) para com qualquer pessoa em relação ao uso não autorizado de qualquer Índice ou Conteúdo por tal pessoa.

Salvo indicação em contrário, para fins de cálculo de qualquer Índice, o IDI se baseou em fontes disponíveis publicamente e não verificou independentemente as informações extraídas dessas fontes e não aceita qualquer responsabilidade ou obrigação em relação às mesmas. A IDI, suas empresas associadas e seus fornecedores terceirizados e licenciadores e parceiros de co-branding (quando aplicável) (coletivamente "Partes da IDI") não garantem que o Conteúdo seja preciso, completo, oportuno ou livre de erros e não deve ser considerado assim sendo. As Partes da IDI não são responsáveis por quaisquer erros, omissões ou interrupções, independentemente da causa, ou pelos resultados obtidos com o uso do Conteúdo. O CONTEÚDO É FORNECIDO "COMO ESTÁ". AS PARTES DA IDI ISENTAM-SE DE QUALQUER E TODAS AS GARANTIAS E CONDIÇÕES EXPRESSAS OU IMPLÍCITAS, INCLUINDO, MAS NÃO SE LIMITANDO A, QUAISQUER GARANTIAS DE

COMERCIABILIDADE OU ADEQUAÇÃO PARA UM DETERMINADO FIM OU USO, AUSÊNCIA DE VÍRUS, BUGS, WORMS, OUTROS COMPONENTES PREJUDICIAIS, OUTRAS LIMITAÇÕES DE PROGRAMAS, ERROS OU DEFEITOS DE SOFTWARE, QUE O FUNCIONAMENTO DO CONTEÚDO SERÁ ININTERRUPTO OU QUE O CONTEÚDO OPERARÁ COM QUALQUER CONFIGURAÇÃO DE SOFTWARE OU HARDWARE. Em nenhum caso as Partes da IDI serão responsáveis por qualquer das partes por quaisquer danos diretos, indiretos, incidentais, exemplares, compensatórios, punitivos, especiais ou consequenciais, custos, despesas, honorários advocatícios ou perdas (incluindo, sem limitação, perda de receita ou perda de lucros e custos de oportunidade) em conexão com qualquer uso do Índice e / ou Conteúdo, mesmo se informado da possibilidade de tais danos.

Quaisquer retornos de Índice disponíveis são hipotéticos e não representam os resultados da negociação real de Produtos Investíveis e, como tal, não representam o desempenho passado real e não são indicativos de qualquer investimento específico. O Conteúdo (incluindo qualquer produto derivada de quaisquer ferramentas ou modelos analíticos) não se destina a prever resultados reais, que podem diferir substancialmente daqueles refletidos. O desempenho passado não é necessariamente indicativo de resultados futuros.

Intercontinental Exchange, Inc., a empresa controladora final da IDI, mantém certas atividades de suas unidades de negócios separadas umas das outras, a fim de preservar a independência e objetividade de suas respectivas atividades. Como consequência, certas unidades de negócios da Intercontinental Exchange, Inc. podem ter informações que não estão disponíveis para outras unidades de negócios. A IDI estabeleceu políticas e procedimentos para manter a confidencialidade de certas informações não públicas recebidas em conexão com cada processo analítico. Não há qualquer obrigação por parte da IDI de divulgar as informações por ela detidas em relação a qualquer Índice a outras partes.

Os vários negócios da Intercontinental Exchange, Inc. fornecem uma ampla gama de produtos e serviços a um grupo diversificado de clientes e, como tal, a Intercontinental Exchange, Inc. enfrenta potenciais conflitos de interesse no curso normal de seus negócios. A Intercontinental Exchange, Inc. pode atuar em uma série de funções em conexão com Produtos Investíveis ou outras transações celebradas em relação à IDI. Intercontinental Exchange, Inc., agindo em tais capacidades em conexão com tais transações, terá apenas os deveres e responsabilidades expressamente acordados por ela em sua capacidade relevante e não será, em virtude de sua atuação em qualquer outra capacidade, ser considerada como tendo outros deveres ou responsabilidades ou ser considerado como tendo um padrão de cuidado diferente daquele expressamente observado em cada uma dessas capacidades. A IDI estabeleceu políticas e procedimentos desenhadas para identificar e resolver conflitos de interesse.

Além disso, a Intercontinental Exchange, Inc. oferece uma ampla gama de serviços para, ou relacionados a, muitas organizações, incluindo emissores de títulos, consultores de investimento, corretoras, bancos de investimento, outras instituições financeiras e intermediários financeiros e, portanto, pode receber taxas ou outros benefícios econômicos dessas organizações, incluindo organizações cujos títulos possam fazer parte de qualquer Índice ou outra avaliação que o IDI possa realizar.

**SOBRE INTERCONTINENTAL EXCHANGE.** Intercontinental Exchange, Inc. (NYSE: ICE) opera uma rede líder de bolsas e câmaras de compensação. As bolsas e câmaras de compensação do ICE, que incluem a Bolsa de Valores de Nova York, atendem aos mercados globais de commodities e de futuros financeiros e de ações. A Bolsa de Valores de Nova York é líder mundial em levantamento de capital e negociação de ações. ICE é um provedor líder de serviços de dados em mercados globais. As marcas registradas da ICE e / ou suas empresas associadas incluem Intercontinental Exchange, ICE, ICE block design, NYSE, New York Stock Exchange e Interactive Data. Informações sobre marcas registradas adicionais e direitos de propriedade intelectual da Intercontinental Exchange, Inc.,

e/ou suas subsidiárias podem ser encontradas no seguinte endereço:

<https://www.intercontinentalexchange.com/terms-of-use>. Apple® é uma marca registrada da Apple, Inc., Facebook® é uma marca registrada do Facebook, Inc., Amazon® é uma marca registrada da Amazon Technologies, Inc., Netflix® é uma marca registrada da Netflix, Inc., Google® é uma marca registrada da Google, Inc. Outros produtos, serviços ou nomes de empresas aqui mencionados são propriedade, e podem ser marcas de serviço ou marca comercial, de seus respectivos proprietários.

**SOBRE ICE DATA SERVICES** A ICE Data Services faz parte da Intercontinental Exchange (NYSE: ICE) e oferece soluções ponta a ponta para informações, serviços de índice analítico e conectividade, com uma gama de dados proprietários e ferramentas para mercados globais em renda fixa, ações, commodities, FX e opções.

ICE Data Services é o nome de marketing usado para ICE Data Services, Inc. e suas subsidiárias globalmente, incluindo ICE Data Pricing & Reference Data, LLC, Interactive Data (Europe) Ltd. e ICE Data Services Australia Pty Ltd. ICE Data Services também é o nome de marketing usado para ICE Data Derivatives, Inc. e suas subsidiárias globalmente, ICE Data Indices, LLC e alguns outros produtos e serviços de dados oferecidos por outras subsidiárias da Intercontinental Exchange, Inc. (NYSE: ICE).