

# INDEX GUIDELINE

*ÍNDICE GLOBAL DE LÍTIO SOLACTIVE*

*Versão 4.2*

*19 April 2024*



# 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 .....	5
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
2.4. Revisão contínua do padrão de listagem .....	8
3. Rebalanceamento .....	9
3.1. Rebalanceamento ordinário .....	9
3.2. Rebalanceamento extraordinário .....	9
4. Cálculo do Índice .....	11
4.1. Fórmula do Índice .....	11
4.2. Precisão .....	11
4.3. Ajustes .....	11
4.4. Ações empresariais .....	12
4.5. Recálculo .....	13
4.6. Perturbação do Mercado .....	13
5. Disposições diversas .....	14
5.1. Critério .....	14
5.2. Revisão da Metodologia .....	14
5.3. Alterações no método de cálculo .....	14
5.4. Término .....	15
5.5. Supervisão .....	15
6. Definições .....	16
Contato .....	19



## INTRODUÇÃO

Este documento (a “**DIRETRIZ**”) deve ser usado como uma diretriz em relação à composição, ao cálculo e à manutenção do Índice Global de Lítio 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	Ações
Estratégia	Representação de empresas ativas em mineração de lítio, exploração ou atividades relacionadas e/ou produção de baterias de lítio.
Alocação regional	Mercados Desenvolvidos e Mercados Emergentes.
Taxa de rebalanceamento	-
Frequência de rebalanceamento	Semi-Anual

## 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 Global de Lítio Solactive	DE000A1EY8J4	USD	NTR*	.SOLLIT	Índice SOLLIT

\*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/>

Para os ÍNDICES NTR, as alíquotas de retenção de imposto fonte (WHT) aplicadas a empresas constituídas nos EUA serão reduzidas da alíquota padrão da Solactive (listada no site da SOLACTIVE <https://www.solactive.com>) para 0%.

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 100 no fechamento da negociação em 09/07/2010, a DATA DE INÍCIO.



## 1.4. FREQUÊNCIA DE PREÇOS E CÁLCULO

O nível do ÍNDICE é calculado em cada DIA DE CÁLCULO das 01:00 h às 22:30 h (horário da Europa Central) baseado nos PREÇOS DE NEGOCIAÇÃO na BOLSA DE VALORES onde os COMPONENTES DO ÍNDICE estão listados. PREÇOS DE NEGOCIAÇÃO dos COMPONENTES DOS ÍNDICE não listados no ÍNDICE DE MOEDAS são convertidos usando a taxa de câmbio estrangeira 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. Cada COMPONENTE DO ÍNDICE será atribuído um peso como descrito na Seção 2.3. Uma revisão posterior dos COMPONENTES DO ÍNDICE ocorrerá seguindo as regras descritas na Seção 2.4.

Além disso, há uma Revisão do Índice uma vez por ano no DIA DA REVISÃO em abril, onde os constituintes existentes serão verificados se ainda cumprem os REQUISITOS DO UNIVERSO DO ÍNDICE conforme refletido na Seção 2.1 abaixo.

### 2.1. REQUISITOS DO UNIVERSO DO ÍNDICE

O UNIVERSO DO ÍNDICE está compreendido em todos os instrumentos financeiros que cumprem com os requisitos abaixo

(os "**REQUISITOS DO UNIVERSO DO ÍNDICE**"):

- 1) Listagem primária em um dos países que fazem parte dos Mercados Desenvolvidos e Mercados Emergentes (excluindo a Índia), conforme definido pela Classificação de Países Solactive (<https://www.solactive.com/documents/>). As ações A da China são elegíveis para inclusão, desde que estejam disponíveis através do programa Stock Connect. Estes critérios relativos ao Índice estão sujeitos a uma revisão regular pelo Administrador do Índice.
- 2) Operações comerciais em mineração de lítio (EMPRESA DE MINERAÇÃO) ou produção de baterias de lítio (EMPRESA DE BATERIA) nas quais as rendas significativas sejam geradas ou espera-se que sejam geradas de um ponto de vista relativo (por ex., em termos de rendas totais da empresa) ou absoluto (po ex., em termos de tamanho absoluto das rendas, empresa não puramente do setor)
- 3) Capitalização de Mercado de Flutuação Livre de, pelo menos, US\$ 50 milhões para empresas que não estão no Índice no Dia da Seleção, e US\$ 25 milhões para empresas que estão no Índice no Dia de Seleção.
- 4) Valor médio diário negociado em todos os câmbios nacionais dentro do país listado de, pelo menos, US\$ 200 mil durante o PERÍODO DE MEDIÇÃO DE NEGOCIAÇÃO para empresas que não estão no Índice no Dia de Seleção, e US\$ 100 mil para empresas que estão no Índice no Dia de Seleção.
- 5) Para serem consideradas para inclusão, as ofertas públicas iniciais ("IPOs") com menos de três meses corridos do histórico de negociação a partir do DIA DE SELEÇÃO devem ter sido listadas pelo menos 10 dias corridos antes do DIA DA SELEÇÃO, se considerado como IPO SIGNIFICATIVO, e três meses corridos antes do DIA DA SELEÇÃO, no caso de outros IPOs.



O COMITÊ DE SUPERVISÃO pode decidir incluir empresas no UNIVERSO DO ÍNDICE que não cumpram com o critério de liquidez.

## 2.2. SELEÇÃO DOS COMPONENTES DO ÍNDICE

Baseado no UNIVERSO DO ÍNDICE, a composição inicial, assim como os ajustes contínuos do ÍNDICE, são determinados no DIA DA SELEÇÃO de acordo com as seguintes regras (os "**REQUISITOS DO COMPONENTE DO ÍNDICE**").

- 1) As empresas UNIVERSO DO ÍNDICE estão classificadas na ordem decrescente de acordo com a sua CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO DE FLUTUAÇÃO LIVRE expressa em US\$. As empresas com classificações mais altas são então escolhidas como COMPONENTES DO ÍNDICE e o novo ÍNDICE determinado dessa forma é válido, com início no DIA DO AJUSTE imediatamente posterior.
- 2) O número exigido de COMPONENTES DO ÍNDICE é 20 e o número máximo de COMPONENTES DO ÍNDICE é 40. O COMITÊ DE SUPERVISÃO pode decidir aumentar o número máximo de COMPONENTES DO ÍNDICE em um DIA DE SELEÇÃO. No caso da classificação atribuída a uma empresa, que seja no momento um COMPONENTE DO ÍNDICE em um DIA DE SELEÇÃO, não for suficiente para ser selecionada como um COMPONENTE DO ÍNDICE, deverá ser removida apenas do ÍNDICE se sua classificação exceda o número máximo de COMPONENTES DO ÍNDICE em mais de dez classificações. A empresa com a classificação mais baixa que for selecionada como COMPONENTE DO ÍNDICE neste DIA DE SELEÇÃO, mas que não for atualmente um COMPONENTE DO ÍNDICE no DIA DE SELEÇÃO, não é incluída no ÍNDICE neste caso.
- 3) Se o número de COMPONENTES DO ÍNDICE for acima de 20, o COMITÊ DE SUPERVISÃO pode decidir limitar o número de empresas que não sejam exclusivamente do setor no ÍNDICE a fim de garantir a representação apropriada do SETOR DE LÍTIOS no ÍNDICE.
- 4) Se o número de empresas que cumpram o CRITÉRIO DE LIQUIDEZ RELATIVA for menor do que o número mínimo dos COMPONENTES DO ÍNDICE, as empresas que estão no momento no ÍNDICE, apenas serão excluídas se tiverem um número de dias não negociados significativos.
- 5) O número de COMPONENTES DO ÍNDICE será limitado a 30% para listagens na Shanghai-Hong Kong Stock Connect e Shenzhen-Hong Kong Stock Connect. Isso significa que se houver 40 COMPONENTES DO ÍNDICE apenas 30% (12 em termos absolutos) dos COMPONENTES DO ÍNDICE pode ser listadas tanto em Shanghai-Hong Kong Stock Connect quanto em Shenzhen-Hong Kong Stock Connect. Para esclarecer, no caso de que haja menos de 40 COMPONENTES DO ÍNDICE por ex. 39 COMPONENTES DO ÍNDICE, o número limitado de COMPONENTES DO ÍNDICE seria arredondado para baixo ao número integral mais próximo dos COMPONENTES DO ÍNDICE, por ex. 11,7 seria arredondado para 11 COMPONENTES DO ÍNDICE.



## 2.3. PONDERAÇÃO DOS COMPONENTES DO ÍNDICE

Em cada DIA DE SELEÇÃO cada COMPONENTE DO ÍNDICE do Índice Global de Lítio Solactive terá o peso proporcional de acordo com a CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO DE FLUTUAÇÃO LIVRE. As seguintes restrições de limitação e ponderação são, então, aplicadas:

- 1) O peso percentual de um COMPONENTE DO ÍNDICE que seja uma EMPRESA DE MINERAÇÃO será limitado a 20%. O peso percentual de um COMPONENTE DO ÍNDICE que seja uma EMPRESA DE BATERIA será limitado a 4,75%. O peso percentual coletivo dos COMPONENTES DO ÍNDICE com peso percentual de mais de 4,75% será limitado a 44,5%. O peso excedente será alocado proporcionalmente a todos os COMPONENTES DO ÍNDICE cujo peso percentual não esteja limitado.
- 2) O peso percentual agregado dos COMPONENTES DO ÍNDICE que não cumpra o CRITÉRIO DE LIQUIDEZ será ajustado apropriadamente. O peso excedente será alocado proporcionalmente a todos os COMPONENTES DO ÍNDICE cujo peso percentual não esteja limitado. Isso é realizado ao se implementar as ações como determinado com base nos pesos calculados nos dados do fechamento do mercado no DIA DA SELEÇÃO ou DIA DE REVISÃO.
- 3) O COMITÊ DE SUPERVISÃO pode decidir no DIA DE SELEÇÃO que os atuais COMPONENTES DO ÍNDICE e ponderações ainda estão compatíveis com os regulamento do produto financeiro aplicável e se o ÍNDICE ainda representa de forma válida o mercado de cobre (em particular, nenhum componente precisa ser adicionado ou removido) que não haverá nenhuma mudança nos COMPONENTES DO ÍNDICE e as ponderações no próximo DIA DO AJUSTE ou DIA DE REVISÃO DO AJUSTE, quando aplicável.

A metodologia da limitação pode ser alterada pelo COMITÊ DE SUPERVISÃO periodicamente para garantir a representação apropriada do Índice e a conformidade do Índice aos regulamentos do produto financeiro.

Após os novos pesos serem determinados, aplica-se a seção 2.4.

## 2.4. REVISÃO CONTÍNUA DO PADRÃO DE LISTAGEM

Em cada DIA DE MONITORAMENTO DE SELEÇÃO, os COMPONENTES DO ÍNDICE serão revisados em caso de violação dos seguintes critérios ("**PADRÕES DE LISTAGEM CONTÍNUOS**");

- 1) O peso máximo no topo do COMPONENTE DO ÍNDICE não pode ser superior a 25%. Se o critério for violado, a ação será limitada a 22% e o peso excedente será redistribuído a outras ações não limitadas. Note que o peso de um COMPONENTE DO ÍNDICE que seja uma EMPRESA DE MINERAÇÃO será limitado a 20% de acordo com a seção 2.3.
- 2) O peso agregado máximo dos 5 principais COMPONENTES DO ÍNDICE não pode exceder 60%. Se este critério for violado, as ações serão limitadas proporcionalmente a 55% e o peso excedente será redistribuído entre outras ações não limitadas.
- 3) O peso máximo dos COMPONENTES DO ÍNDICE com uma liquidez de mercado abaixo de 250.000 ações negociadas (média mensal dos últimos 6 meses ou histórico disponível se menor) e US\$ 25 milhões





de valor diário médio negociado (média mensal dos últimos 6 meses ou histórico disponível se menor) não deve exceder 30%. Se este critério for violado, as ações com liquidez de mercado abaixo de 250.000 ações negociadas (média mensal dos últimos 6 meses ou histórico disponível se menor) e US\$ 25 milhões de valor diário médio negociado (média mensal dos últimos 6 meses ou histórico disponível se menor) serão limitadas a 25% e o peso excedente será redistribuído entre outras ações não limitadas.

- 4) O peso máximo dos COMPONENTES DO ÍNDICE com uma CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO abaixo de US\$ 100 milhões não deve contar para mais de 10%. Se este critério for violado, as ações com CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO abaixo de 100 milhões serão limitadas proporcionalmente a 9% e o peso excedente será redistribuído entre outras ações não limitadas.

O processo de nova ponderação será repetido até que nenhum PADRÃO DE LISTAGEM CONTÍNUO seja violado. No caso de os critérios dos PADRÕES DE LISTAGEM CONTÍNUOS não puderem ser satisfeitos usando os limites descritos acima, a ponderação será revisada pelo COMITÊ DE SUPERVISÃO. Após a revisão, uma decisão será anunciada publicamente.

## 3. REBALANCEAMENTO

### 3.1. REBALANCEAMENTO ORDINÁRIO

A fim de refletir a nova seleção dos COMPONENTES DO ÍNDICE determinados no DIA DA SELEÇÃO e DIA DE REVISÃO (de acordo com a Seção 2), o ÍNDICE é ajustado no DIA DO AJUSTE e DIA DE REVISÃO DO AJUSTE após o FECHAMENTO DOS NEGÓCIOS.

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

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

Se a empresa incluída no Índice Global de Lítio Solactive for removida do ÍNDICE entre dois DIAS DE AJUSTE devido a um Evento Extraordinário, se necessário, o COMITÊ DE SUPERVISÃO designará uma sucessora.



O Índice Global de Lítio Solactive será ajustado no mesmo dia. Isso será anunciado na página da Solactive na Seção "Avisos", disponível em <https://www.solactive.com/news/announcements/>, após o FECHAMENTO DOS NEGÓCIOS no dia em que a nova composição do ÍNDICE for determinado pelo COMITÊ DA SUPERVISÃO.



## 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 Ações, 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.

Quaisquer dividendos ou outras distribuições são reinvestidas na cesta integral dos COMPONENTES DO ÍNDICE por meios de um divisor na abertura da data efetiva (conhecida como ex-data) 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 6 casas decimais. Os PREÇOS DE NEGOCIAÇÃO e as taxas de câmbio serão arredondados a 6 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 uma ação empresarial (como especificado na Seção 4.4 abaixo) ocorre 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 referidos como 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 desde o cum-day ao ex-day 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 corporativa, 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 dado)
- > 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).
- > Delisting (ações da empresa não são mais negociadas publicamente em uma bolsa de valores)



- > Nacionalização de uma empresa (controle efetivo de uma pessoa jurídica é assumida 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 por 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 precise 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 à 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 que julgue ser 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 um método de cálculo seja aplicado 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 o último DIA ÚTIL em outubro. Se esse dia não for um DIA DE CÁLCULO, o DIA DE AJUSTAMENTO será o segundo DIA DE CÁLCULO seguinte.

“**EMPRESA DE BATERIA**” são empresas ativas na produção baterias de lítio ou atividades relacionadas.

“**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. Um dia em que a Bolsa de Valores de Nova Iorque (NYSE), a NASDAQ ou a Bolsa de Valores de Londres não estejam abertas para negócios gerais não é um DIA DE CÁLCULO.

“**FECHAMENTO DOS NEGÓCIOS**” é o tempo de cálculo do nível de fechamento do ÍNDICE como atribuído 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.

“**PADRÕES DE LISTAGEM CONTÍNUAS**” deve conter o significado como definido na Seção 2.3.

“**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.

“**CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO DE FLUTUAÇÃO LIVRE**” é em relação a cada ação no UNIVERSO DO ÍNDICE ou no ÍNDICE em um DIA DE SELEÇÃO ou DIA DE SELEÇÃO DE REVISÃO a CAPITALIZAÇÃO DO MERCADO para esse dia multiplicado pela razão do (A) número de ações em circulação e (B) número de ações em circulação da classe de ações da empresa respectiva.

“**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.

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

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

“**SETOR DE LÍTI**O” inclui EMPRESAS DE MINERAÇÃO e EMPRESAS DE BATERIA.

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

A “**CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO**” é em relação a cada título que cumpre os REQUISITOS DO COMPONENTE DO ÍNDICE em um DIA DE SELEÇÃO ou DIA DE SELEÇÃO DE REVISÃO da 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.

“**EMPRESA DE MINERAÇÃO**” são empresas envolvidas em mineração de lítio, exploração ou uma atividade relacionada.

“**DIA DO MONITORAMENTO DO AJUSTE**” é o último DIA DE CÁLCULO em janeiro, abril, julho e outubro. Se esse dia não for um DIA DE CÁLCULO, o DIA DE AJUSTAMENTO será o segundo DIA DE CÁLCULO seguinte.

“**DIA DE MONITORAMENTO DE SELEÇÃO**” é o DIA ÚTIL 10 DIAS ÚTEIS antes do DIA DO MONITORAMENTO DO AJUSTE.

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

“**CRITÉRIO DE LIQUIDEZ RELATIVA**” implica que o valor diário médio negociado de um COMPONENTE DE ÍNDICE nos 3 meses anteriores a um DIA DE AJUSTE precisa estar alto o suficiente relativo à sua CAPITALIZAÇÃO DE MERCADO DE FLUTUAÇÃO LIVRE e à porcentagem ponderada para permitir a manutenção do índice. Caso esse critério não seja cumprido pelo COMPONENTE DO ÍNDICE, o COMITÊ DE SUPERVISÃO pode decidir limitar ou aumentar a porcentagem ponderada de tais COMPONENTES DO ÍNDICE.

“**DIA DA REVISÃO DO AJUSTE**” é o último DIA ÚTIL em abril. Se esse dia não for um DIA DE CÁLCULO, o DIA DE AJUSTAMENTO será o segundo DIA DE CÁLCULO seguinte.

“**DIA DE REVISÃO**” são 10 DIAS ÚTEIS antes do último DIA ÚTIL em abril.

“**DIA DE SELEÇÃO**” são 10 DIAS ÚTEIS antes do último DIA ÚTIL em outubro.

“**IPO SIGNIFICATIVO**” é cada IPO com um nível de capitalização de mercado total de nível da empresa maior do que o nível total de capitalização de mercado da empresa de pelo menos 50% dos componentes atuais do índice a partir do dia anterior de seleção.

“**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 "**PERÍODO DE MEDIÇÃO DE NEGOCIAÇÃO**" em relação a uma segurança a partir do DIA DE SELEÇÃO aplicável é:

- a) No caso de uma empresa que tenha concluído uma oferta pública inicial ("IPO") menos de três meses antes do DIA DE SELEÇÃO que são IPOs significativos, o período desde o primeiro dia de negociação do título até o DIA DA SELEÇÃO;
- b) No caso de todas as outras empresas, os três meses anteriores ao Dia da Seleção.

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