

METODOLOGIA DO ÍNDICE SMALL CAP (SMML)

SUMÁRIO

1	OBJETIVO.....	3
2	TIPO DE ÍNDICE	3
3	ATIVOS ELEGÍVEIS.....	3
4	CRITÉRIOS DE INCLUSÃO.....	3
5	CRITÉRIOS DE EXCLUSÃO.....	4
6	CRITÉRIO DE PONDERAÇÃO	5

O SMLL é o resultado de uma carteira teórica de ativos, elaborada de acordo com os critérios estabelecidos nesta metodologia.

Os índices da B3 utilizam procedimentos e regras constantes do Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3 (Conceitos e Procedimentos), disponível em www.b3.com.br, Market Data e Índices (Índices de Segmentos e Setoriais, Índice Small Cap (SMLL)).

1 OBJETIVO

O objetivo do SMLL é ser o indicador do desempenho médio das cotações dos ativos de uma carteira composta de empresas de menor capitalização.

2 TIPO DE ÍNDICE

O SMLL é um índice de retorno total (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3).

3 ATIVOS ELEGÍVEIS

O SMLL é composto das ações e units exclusivamente de ações de companhias listadas na B3 que atendem aos critérios de inclusão descritos a seguir.

Não estão incluídos nesse universo BDRs e ativos de companhias em recuperação judicial ou extrajudicial, regime especial de administração temporária, intervenção ou que sejam negociados em qualquer outra situação especial de listagem (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3).

4 CRITÉRIOS DE INCLUSÃO

Serão selecionados para compor o SMLL os ativos que atendam cumulativamente aos critérios abaixo.

4.1 Estar entre os ativos que, em ordem decrescente, estejam classificados fora da lista dos que representam 85% (oitenta e cinco por cento) do valor

de mercado de todas as empresas listadas no mercado a vista (lote-padrão) da B3.

- 4.2 Estar entre os ativos elegíveis que, no período de vigência das 3 (três) carteiras anteriores, em ordem decrescente de Índice de Negociabilidade (IN), representem em conjunto 99% (noventa e nove por cento) do somatório total desses indicadores (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3).
- 4.3 Ter presença em pregão de 95% (noventa e cinco por cento) no período de vigência das 3 (três) carteiras anteriores.
- 4.4 Não ser classificado como “Penny Stock” (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3).

Um ativo que seja objeto de oferta pública realizada durante o período de vigência das 3 (três) carteiras anteriores ao rebalanceamento será elegível, mesmo sem estar listado todo o período, desde que:

- a) a oferta pública de distribuição de ações ou units, conforme o caso, tenha sido realizada antes do rebalanceamento imediatamente anterior;
- b) possua 95% (noventa e cinco por cento) de presença desde seu início de negociação;
- c) atenda cumulativamente aos critérios 4.1, 4.2 e 4.4.

A determinação das empresas cujos ativos serão elegíveis para a carteira definitiva do quadrimestre é realizada com base nos cálculos efetuados quando da apuração da segunda prévia dessa carteira.

5 CRITÉRIOS DE EXCLUSÃO

Serão excluídos da carteira os ativos que:

- 5.1 deixarem de atender aos critérios de inclusão 4.2, 4.3 ou 4.4 acima indicados;
- 5.2 estar entre os ativos que, em ordem decrescente, estejam classificados dentro da lista dos que representam 82% (oitenta e dois por cento) do valor

de mercado de todas as empresas listadas no mercado a vista (lote-padrão) da B3.

- 5.3 durante a vigência da carteira, passem a ser listados em situação especial (ver item 2, no Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3). Serão excluídos ao final de seu primeiro dia de negociação nesse enquadramento.

6 CRITÉRIO DE PONDERAÇÃO

No SMLL, os ativos são ponderados pelo valor de mercado do “free float” (ativos que se encontram em circulação) da espécie pertencente à carteira (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3).