

# **METODOLOGIA DO ÍNDICE DIVERSIDADE B3 (IDIVERSA B3)**

# METODOLOGIA DO ÍNDICE DIVERSIDADE B3 (IDIVERSA B3)

## Sumário

<b>1</b>	<b>OBJETIVO.....</b>	<b>3</b>
<b>2</b>	<b>TIPO DE ÍNDICE .....</b>	<b>3</b>
<b>3</b>	<b>DISPONIBILIZAÇÃO DO ÍNDICE .....</b>	<b>ERRO! INDICADOR NÃO DEFINIDO.3</b>
<b>4</b>	<b>ATIVOS ELEGÍVEIS .....</b>	<b>3</b>
<b>5</b>	<b>CRITÉRIOS DE INCLUSÃO .....</b>	<b>4</b>
<b>6</b>	<b>CRITÉRIOS DE EXCLUSÃO.....</b>	<b>5</b>
<b>7</b>	<b>CRITÉRIOS DE PONDERAÇÃO .....</b>	<b>5</b>
	<b>ANEXOS .....</b>	<b>7</b>

# METODOLOGIA DO ÍNDICE DIVERSIDADE B3 (IDIVERSA B3)

O Índice de Diversidade B3 (IDIVERSA B3) 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 <https://www.b3.com.br>, Market Data e Índices, Índices de Sustentabilidade, Índice de Diversidade B3.

## 1 OBJETIVO

O objetivo do IDIVERSA B3 é ser o indicador de desempenho médio das ações dos ativos de empresas listadas que se destacam no critério de diversidade, baseado no Score de Diversidade, desenvolvido pela B3.

## 2 TIPO DE ÍNDICE

O IDIVERSA B3 é um índice de retorno total (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3, em item 1.2: Definições, Índice Retorno Total) com reinvestimento na própria carteira.

## 3 ATIVOS ELEGÍVEIS

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

Não estão inclusos nesse universo BDRs e ativos de companhias em recuperação judicial ou extrajudicial, regime especial de administração temporária, intervenção ou que sejam negociadas em qualquer outra situação especial de listagem (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3, em item 3.2: Procedimentos Especiais, Companhias em situação especial).

# METODOLOGIA DO ÍNDICE DIVERSIDADE B3 (IDIVERSA B3)

## 4 CRITÉRIOS DE INCLUSÃO

Serão selecionados para compor o IDIVERSA B3 os ativos que atendam cumulativamente aos critérios descritos abaixo.

- 4.1** 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).
- 4.2** Ter presença em pregão de 95% (noventa e cinco por cento) no período de vigência das 3 (três) carteiras anteriores.
- 4.3** Não ser classificada como "Penny Stock" (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3).
- 4.4** Apresentar um Score Diversidade B3 (ver Anexo) maior ou igual a média subtraída do desvio padrão do Setor Econômico B3<sup>1 2 3 4</sup>.
- 4.5** Ter pelo menos um representante dos grupos subrepresentados no CA (Conselho de Administração), como membro efetivo.
- 4.6** Ter pelo menos um representante dos grupos subrepresentados na Diretoria Estatutária.

---

<sup>1</sup> Para cálculo da média e do desvio padrão dos setores, só serão considerados os ativos elegíveis pelos critérios de liquidez (4.1, 4.2 e 4.3).

<sup>2</sup> Caso o setor econômico possua até 2 representantes, o cálculo da média e desvio padrão do Score Diversidade será a partir de todos os ativos elegíveis por liquidez.

<sup>3</sup> A classificação setorial das empresas listadas se encontra em <https://www.b3.com.br>, Produtos e serviços, Negociação, Renda Variável, Ações, Saiba Mais, Consultas, Classificação setorial.

<sup>4</sup> Calculamos a Média e Desvio padrão considerando o nível de empresas.

## METODOLOGIA DO ÍNDICE DIVERSIDADE B3 (IDIVERSA 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 cotas 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, 4.3, 4.4, 4.5, 4.6.

### 5 CRITÉRIOS DE EXCLUSÃO

Serão excluídos da carteira do IDIVERSA B3:

- 5.1** Os ativos que deixarem de atender a qualquer um dos critérios de inclusão acima indicados;
- 5.2** Os ativos que, durante a vigência da carteira, passem a ser listados em situação especial (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3). Serão excluídos ao final de seu primeiro dia de negociação nesse enquadramento;

### 6 CRITÉRIOS DE PONDERAÇÃO

Na carteira do IDIVERSA B3 os ativos são ponderados pelo Score Diversidade B3, com limite de participação baseado no 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).

Dessa forma, a representatividade de um ativo no índice, quando dos rebalanceamentos periódicos, não poderá ser superior a 3 (três) vezes a participação que o ativo teria caso a carteira fosse ponderada pela

## METODOLOGIA DO ÍNDICE DIVERSIDADE B3 (IDIVERSA B3)

representatividade do valor de mercado de “free float” do ativo. Caso isso ocorra, serão efetuados ajustes para adequar o peso dos ativos das companhias a esse limite, redistribuindo o excedente proporcionalmente aos demais ativos da carteira<sup>5</sup>.

---

<sup>5</sup> O processo de redistribuição será realizado iterativamente de três vezes. Essa será considerada a ponderação final.

# METODOLOGIA DO ÍNDICE DIVERSIDADE B3 (IDIVERSA B3)

## ANEXOS

### 1 COLETA DE DADOS

Os dados serão extraídos dos itens 7.1 alínea “d” e 10.1 e alínea “a” do Formulário de Referência (FRE) previamente preenchido pelas empresas, conforme definido pela Resolução CVM 80 de 29/03/2022.

### 2 SCORE DIVERSIDADE B3

O Score Diversidade B3 calcula quão próximo à diversidade da população brasileira a companhia analisa está, ou seja, quanto menor o Score de Diversidade menos diversa e mais distante da distribuição populacional para o gênero feminino, pessoas negras (pretas e pardas) e indígenas, de acordo com os dados divulgados pelo Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE).

Desenvolvido pela B3, levando em consideração os dados disponíveis no Formulário de Referência (FRE), visa identificar quais empresas que apresentam no seu quadro de funcionários uma participação relevante dos grupos subrepresentados, tendo como foco dois grandes critérios: (i) gênero, analisando gênero feminino; e (ii) racial, tanto negros<sup>6</sup> quanto indígenas.

No cálculo do Score Diversidade B3, serão aplicados pesos de acordo com a representatividade de gênero e de raça/cor em quatro categorias funcionais: (i) conselho de administração (membros efetivos); (ii) diretoria estatutária; (iii) cargos de liderança e; (iv) cargos de não-liderança, considerando também a proporção de cada grupo subrepresentado na população brasileira.

---

<sup>6</sup> Seguindo o Estatuto da Igualdade Racial, a população negra é definida pelo conjunto de pessoas que se autodeclaram pretas e pardas

## METODOLOGIA DO ÍNDICE DIVERSIDADE B3 (IDIVERSA B3)

Pesos dos grupos subrepresentados no Score Diversidade B3, tabela abaixo representa os pesos de cada cruzamento.

		Categoria funcional				
		CA Efetivo (35%)	Diretoria Estatutária (35%)	Liderança (20%)	Não Liderança (10%)	
Grupo Subrepresentado	Gênero (50%)	Feminino (50%)	17,5%	17,5%	10%	5%
	Raça/Cor (50%)	Negros (49,58%)	17,35%	17,35%	9,92%	4,96%
		Indígenas (0,42%)	0,15%	0,15%	0,08%	0,04%

Onde:

- Os grupos subrepresentados estão de acordo com as categorias do Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE).
- População Negra é equivalente a soma da população Preta e Parda.

### Cálculo do Score diversidade

O cálculo do Score de diversidade é feito através da fórmula abaixo:

$$ScoreDiversidade_i = \sum_{j,k}^{J,K} (Peso_{j,k} * \frac{(n_{j,k}/N_k) * 100}{\%BR_j})$$

Onde:

- $ScoreDiversidade_i$  é o Score Diversidade da empresa  $i$
- $Peso_{j,k}$  é o peso do grupo subrepresentado  $j$  e da categoria funcional  $k$ , citada na tabela acima (peso score diversidade).



## METODOLOGIA DO ÍNDICE DIVERSIDADE B3 (IDIVERSA B3)

- $n_{j,k}$  é a quantidade de funcionários do grupo subrepresentado  $j$  na categoria funcional  $k$
- $N_k$  é a quantidade de funcionários na categoria funcional  $k$
- $\%BR_j$  é a proporção do grupo subrepresentado  $j$  no Brasil, segundo dados divulgados pelo Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE)

Observação: para os casos em que a proporção  $\frac{(n_{j,k}/N_k)*100}{\%BR_j}$  for maior que 100 (cem), aplica-se o valor 100 (cem).