

# METODOLOGIA DO ÍNDICE DO SETOR INDUSTRIAL (INDX)

Visite o site da BM&FBOVESPA

[bmfbovespa.com.br](http://bmfbovespa.com.br)

## METODOLOGIA DO ÍNDICE DO SETOR INDUSTRIAL (INDX)

Fruto-Resultado de um convênio entre a Fiesp e a BM&FBOVESPA, o INDX foi desenvolvido com o objetivo de medir o desempenho das ações mais representativas do setor industrial, importante segmento da economia brasileira. Sua carteira teórica é composta das ações mais representativas da indústria.

Os índices da BM&FBOVESPA utilizam procedimentos e regras constantes do Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da BM&FBOVESPA.

### 1 Objetivo

O objetivo do INDX é ser o indicador do desempenho médio das cotações dos ativos de maior negociabilidade e representatividade dos setores da atividade industrial compreendidos por materiais básicos, bens industriais, consumo cíclico, consumo não cíclico, tecnologia da informação e saúde.

### 2 Tipo de Índice

O INDX é um índice de retorno total (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da BM&FBOVESPA).

### 3 Ativos Elegíveis

O INDX é composto das ações e units exclusivamente de ações de companhias listadas na BM&FBOVESPA 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 BM&FBOVESPA).

## 4 Critérios de Inclusão

Serão selecionados para compor o INDX os ativos que atendam cumulativamente aos critérios 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), ocupem as 150 primeiras posições (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da BM&FBOVESPA).

**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 classificado como “Penny Stock” (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da BM&FBOVESPA).

**4.4** Pertencer aos setores da atividade industrial compreendidos por materiais básicos, bens industriais, consumo cíclico, consumo não cíclico, tecnologia da informação e saúde.

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, 4.3 e 4.4.

## 5 Critérios de Exclusão

Serão excluídos da carteira os ativos que:

**5.1** deixarem de atender a qualquer um dos critérios de inclusão acima indicados;

**5.2** durante a vigência da carteira passem a ser listados em situação especial (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da BM&FBOVESPA). Serão excluídos ao final de seu primeiro dia de negociação nesse enquadramento;

**5.3** forem emitidos por uma empresa que, durante a vigência da carteira, altere sua área de atuação principal para um setor diferente do objetivo do índice.

## **6 Critério de Ponderação**

No INDX, 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 BM&FBOVESPA).

Ressalta-se que a participação dos ativos de uma companhia no índice (considerando todas as espécies e classes de ações ou units que tenham como lastro tais ações da companhia, conforme o caso) não poderá ser superior a 20% (vinte por cento), quando de sua inclusão ou nas reavaliações periódicas.

Caso isso ocorra, serão efetuados ajustes para adequar o peso dos ativos da companhia a esse limite, redistribuindo-se o excedente proporcionalmente aos demais ativos da carteira.

 [linkedin.com/company/bm&fbovespa](https://linkedin.com/company/bm&fbovespa)

 [twitter.com/bmfbovespa](https://twitter.com/bmfbovespa)

 [facebook.com/bolsapravoce](https://facebook.com/bolsapravoce)

Visite o site da BM&FBOVESPA

[bmfbovespa.com.br](https://bmfbovespa.com.br)