

Metodologia de Limitação

v5.2

Este documento se aplica a qualquer série de índices em que o guia seja especificamente mencionado nos documentos de metodologia do índice.

Sumário

Seção 1 Apresentação.....	3
Seção 2 Políticas dos índices FTSE Russell.....	4
Seção 3 Títulos elegíveis.....	6
Seção 4 Metodologias de limitação	7
Seção 5 Ações e eventos corporativos	17
Apêndice A Lista de índices com limitação	19
Apêndice B Algoritmo de índice e método de cálculo	33
Apêndice C Mais informações	34

Seção 1

Apresentação

1. Apresentação

Este documento define a metodologia de limitação aplicada aos índices FTSE Russell calculados pela FTSE International Limited (FTSE). As metodologias de limitação incluídas neste documento são utilizadas para ajustar os pesos das empresas que integram o índice, a fim de respeitar os limiares de risco/concentração com base em diferentes exigências regulatórias vigentes no momento das revisões periódicas. Uma lista dos índices com limitação aplicada está incluída no Apêndice A.

- 1.1 Estas Regras Básicas devem ser lidas em conjunto com as Regras Básicas para a construção e gestão da FTSE Global Equity Index Series, dos Russell US Indexes, da FTSE UK Index Series, da FTSE Nareit US Real Estate Index Series, da FTSE TWSE Taiwan Index Series, e dos Renaissance IPO Indices, que estão disponíveis na FTSE Russell.

Em circunstâncias excepcionais, a metodologia de limitação será reavaliada fora do cronograma das revisões periódicas. Após realizar qualquer determinação deste tipo, a FTSE Russell informará o mercado de sua decisão o mais breve possível. Tal tratamento não será considerado alteração às Regras Básicas, nem estabelecerá precedente para medidas futuras; no entanto, a FTSE Russell avaliará se as Regras devem ser atualizadas posteriormente para proporcionar maior clareza.

1.2 FTSE Russell

- 1.2.1 A FTSE Russell vem por meio deste documento avisar aos usuários da série de índices de que é possível que determinadas circunstâncias, incluindo eventos externos fora do controle da FTSE Russell, possam exigir alterações ou o encerramento da série de índices e, portanto, quaisquer contratos financeiros ou outros instrumentos financeiros que façam referência à série de índices devem estar preparados para suportar ou, de outra forma, lidar com a possibilidade de alterações ou do encerramento da série de índices.

- 1.2.2 Os usuários dos índices que optarem por seguir esta série de índices ou comprar produtos que alegam seguir esta série de índices devem avaliar os méritos da metodologia baseada em regras do índice, e buscar orientação independente em investimentos, antes de investir seus próprios fundos ou os fundos de seus clientes. A FTSE Russell se isenta de qualquer responsabilidade, decorrente de negligência ou não, por perdas, danos, reivindicações e despesas sofridas por qualquer pessoa como resultado de:

- qualquer confiança nestas Regras Básicas, e/ou
- quaisquer imprecisões constantes nestas Regras Básicas, e/ou
- qualquer inobservância ou observância incorreta das políticas ou procedimentos descritos nestas Regras Básicas, e/ou
- quaisquer imprecisões na compilação do índice ou em quaisquer dados dos integrantes.

Seção 2

Políticas dos índices FTSE Russell

2. Políticas dos índices FTSE Russell

Este documento deve ser lido em conjunto com os seguintes documentos de política, que podem ser acessados usando os links abaixo:

2.1 Guia dos métodos de cálculo do FTSE Global Equity Index

O objetivo do guia é descrever como os índices são calculados, facilitar a replicação deles pelos usuários para ajudar a fundamentar as atividades de investimento e negociação, e ajudar esses usuários a compreender os fatores que influenciam o desempenho dos índices.

[FTSE_Global_Equity_Index_Series_Guide_to_Calc.pdf](#)

2.2 Guias de ações e eventos corporativos

Os detalhes na íntegra das alterações nas empresas integrantes decorrentes de ações e eventos corporativos podem ser consultados nos guias de ações e eventos corporativos, usando os links a seguir:

[Corporate Actions and Events Guide.pdf](#)

[Corporate Actions and Events Guide for Non Market Cap Weighted Indices.pdf](#)

2.3 Declaração de Princípios para os FTSE Russell Equity Indices (Declaração de Princípios)

Os índices devem sempre acompanhar as mudanças do mercado, e as Regras Básicas não preveem todas as eventualidades. Nos casos em que as Regras não abrangem totalmente dado evento ou acontecimento, a FTSE Russell determinará o tratamento adequado com base na declaração de princípios que resume a filosofia estrutural da abordagem da FTSE Russell à construção de índices. A Declaração de Princípios é revisada a cada ano, e todas as mudanças propostas pela FTSE Russell são apresentadas ao Conselho Consultivo de Políticas da FTSE Russell, para discussão, antes da aprovação pela Comissão de Governança de Índices da FTSE Russell.

A declaração de princípios pode ser acessada usando o seguinte link:

[Statement_of_Principles.pdf](#)

2.4 Dúvidas, reclamações e recursos

Uma empresa integrante ou candidata a integrante (ou um consultor profissional atuando em nome da empresa), uma organização nacional, ou um grupo de não menos que dez usuários dos Índices de diferentes organizações atuando em nível profissional, podem recorrer de decisões tomadas pela FTSE Russell.

O procedimento de reclamações da FTSE Russell pode ser usado acessando o seguinte link:

[Benchmark_Determination_Complaints_Handling_Policy.pdf](#)

O procedimento de recursos da FTSE Russell pode ser acessado usando o seguinte link:

[Appeals_Against_Decisions.pdf](#)

2.5 Política do índice para interrupções de negociação e fechamentos de mercados

- 2.5.1 A orientação para o tratamento de mudanças no índice no caso de interrupções na negociação ou fechamentos do mercado pode ser encontrada no seguinte link:

[Index Policy for Trading Halts and Market Closures.pdf](#)

2.6 Política do índice no caso de clientes incapazes de negociar mercado ou título

- 2.6.1 Os detalhes do tratamento dado a essa questão pela FTSE Russell podem ser acessados usando o seguinte link:

[Index Policy in the Event Clients are Unable to Trade a Market or a Security.pdf](#)

2.7 Política e diretrizes de recálculo

- 2.7.1 Os FTSE Capped Indices são recalculados sempre que ocorrem imprecisões consideradas significativas. Os usuários dos FTSE Capped Indices são notificados por meio dos canais apropriados.

Para mais informações, consulte o documento com a política e as diretrizes de recálculo da FTSE Russell, disponível no site da FTSE Russell pelo link abaixo ou por contato com info@ftserussell.com.

[Recalculation Policy and Guidelines Equity Indices.pdf](#)

2.8 Política de mudanças na metodologia de referência

- 2.8.1 Os detalhes da política de mudanças na metodologia de referência da FTSE Russell podem ser usadas acessando o seguinte link:

[Policy for Benchmark Methodology Changes.pdf](#)

2.9 Estrutura de Governança da FTSE Russell

- 2.9.1 Para supervisionar seus índices, a FTSE Russell emprega uma estrutura de governança que engloba a governança de produtos, serviços e tecnologias. A estrutura incorpora a estrutura de gestão de riscos das três linhas de defesa do London Stock Exchange Group e foi projetada para garantir a conformidade com os Princípios IOSCO para Índices Financeiros de Referência¹ e o regulamento europeu dos índices de referência². A Estrutura de Governança da FTSE Russell pode ser acessada usando o seguinte link:

[FTSE Russell Governance Framework.pdf](#)

2.10 Definições de situação em tempo real

- 2.10.1 Para índices calculados em tempo real, consulte o guia a seguir para obter detalhes das definições de situação em tempo real:

[Real Time Status Definitions.pdf](#)

¹ Relatório Final dos Princípios IOSCO para Índices Financeiros de Referência, FR07/13, julho de 2013.

² Regulamento (UE) 2016/1011 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 8 de junho de 2016, dos índices usados como referências em instrumentos e contratos financeiros, ou para medir o desempenho de fundos de investimento.

Seção 3

Títulos elegíveis

3. Títulos elegíveis

3.1 Os títulos elegíveis de cada um dos FTSE Capped Indexes são os integrantes dos índices definidos pela FTSE Global Equity Index Series, pelos Russell US Indexes, pela FTSE UK Index Series, pela FTSE Nareit US Real Estate Index Series, pela FTSE TWSE Taiwan Index Series, pelos Renaissance IPO Indices, e pelas Regras Básicas da Lista de Observação FTSE Global Equity Index Series e dos Índices de Transição (todos os índices subjacentes estão listados no Apêndice A).

3.2 Linhas múltiplas

3.2.1 Todas as linhas da mesma empresa são combinadas como parte do processo de limitação.

Seção 4

Metodologias de limitação

4. Metodologias de limitação

4.1 Datas de corte dos dados e datas de vigência

- 4.1.1 Para a maioria dos índices limitados, o cálculo dos fatores de limitação dos componentes (c) será baseado nos preços de fechamento da segunda sexta-feira do mês de revisão, utilizando o número de ações em circulação e os pesos de investibilidade, conforme designados para entrar em vigor após o fechamento da terceira sexta-feira do mês de revisão (isto é, com vigência a partir da abertura da segunda-feira seguinte). Para detalhes do preço e das datas de vigência dos índices limitados, consulte o Apêndice A para mais detalhes.
- 4.1.2 O cálculo levará em conta quaisquer ações/eventos corporativos que entrarem em vigência após o fechamento na segunda sexta-feira do mês de revisão, até e inclusive a data de vigência da revisão, se eles tiverem sido anunciados e confirmados até a segunda sexta-feira do mês de revisão.
- 4.1.3 Ações/eventos corporativos anunciados após a segunda sexta-feira do mês de revisão que entrarem em vigência até e inclusive a data de vigência da revisão não gerarão nenhum ajuste adicional.
- 4.1.4 Para integrantes de índices que não são negociados na sexta-feira, são utilizados os preços de fechamento do dia anterior, e a limitação é aplicada após o fechamento da terceira sexta-feira do mês de revisão (ou seja, com vigência a partir da abertura da segunda-feira seguinte).

4.2 Limitação regulatória

- 4.2.1 A metodologia de limitação a seguir foi criada levando em consideração os requisitos de diversificação previstos para o Investimento Europeu em Valores Mobiliários (UCITS) e a Sociedade de Investimento Regulamentada (RIC), bem como a definição de “Empresa Diversificada” pelo SEC.5.b(1) da Lei das Sociedades de Investimento de 1940 (Lei 40).

Para um fundo cuja política de investimento UCITS é replicar a composição de um índice, foram criados processos adicionais de limitação que restringem o peso das empresas usando limites de um ou dois níveis, usando as regras 4.3 e 4.4.

Aplicação da limitação nas revisões trimestrais

Meta de limitação

A limitação é aplicada aos integrantes do Índice limitado em questão em cada revisão periódica, tal que:

UCITS

- Todas as empresas com peso superior a 4,5% no agregado sejam, no máximo, 38% do índice;
- Nenhuma empresa do índice tenha peso maior que 9% do índice.

UCITS 30/18

- Se a maior empresa no índice tiver peso superior a 30%, ele será limitado a 30%.
- Quaisquer empresas restantes no índice que tenham peso superior a 18% serão limitadas a 18%.

RIC

- Todas as empresas com peso superior a 4,5% no agregado sejam, no máximo, 48% do índice;
- Nenhuma empresa no índice tenha peso superior a 20% do índice.

RIC 22,5/45

- Todas as empresas com peso superior a 4,5% no agregado sejam, no máximo, 45% do índice;
- Nenhuma empresa no índice tenha peso superior a 22,5% do índice.

RIC 6/45

- Todas as empresas com peso superior a 4,5% no agregado sejam, no máximo, 45% do índice;
- Nenhuma empresa no índice tenha peso superior a 6% do índice.

RIC 10/45

- Todas as empresas com peso superior a 4,5% no agregado sejam, no máximo, 45% do índice;
- Nenhuma empresa no índice tenha peso superior a 10% do índice.

RIC 10/48

- Todas as empresas com peso superior a 4,5% no agregado sejam, no máximo, 48% do índice;
- Nenhuma empresa no índice tenha peso superior a 10% do índice.

Lei 40

- Todas as empresas com peso superior a 4,5% no agregado sejam, no máximo, 22,5% do índice;
- Nenhuma empresa no índice tenha peso superior a 22,5% do índice.

Lei 40 15/22,5

- Todas as empresas com peso superior a 4,5% no agregado sejam, no máximo, 22,5% do índice;
- Nenhuma empresa sozinha no índice tenha peso superior a 15% do índice.

Metodologia de limitação

O índice é limitado pela seguinte metodologia:

Etapa 1: Limite no nível da empresa

Qualquer empresa cujo peso sem limitação no índice, $u\%$, seja superior a $y\%$ terá limitação a $y\%$. Onde y é igual a 9% para UCITS, 20% para RIC, 22,5% para RIC 22,5/45, 22,5% para a Lei 40, 6% para RIC 6/45, 10% para RIC 10/45, 10% para RIC 10/48 e 15% para os índices limitados 15/22,5 da Lei 40. Os pesos das empresas integrantes remanescentes são aumentados como consequência da redução dos pesos das empresas maiores. Os pesos das empresas integrantes não limitadas serão então verificados e, se excederem $y\%$, também serão limitados a $y\%$. Esse processo é repetido até que o peso de nenhuma empresa exceda $y\%$.

Se os pesos após a limitação a $y\%$ atenderem à meta de limitação ou se o índice tiver menos de 19 empresas para UCITS ou Lei 40, ou 20 empresas para a Lei 40 15/22,5, ou 15 empresas para RIC ou RIC 22,5/45, ou 17 empresas para RIC 10/48, ou 18 empresas para o RIC 10/45, ou 21 empresas para os índices limitados RIC 6/45, eles se tornam então os pesos finais do índice. Caso contrário, o processo de limitação segue para a próxima etapa.

Etapa 2: Selecionar o maior grupo de empresas

As empresas são classificadas em ordem decrescente de acordo com seu peso no índice limitado, e o peso cumulativo de cada empresa é calculado. As empresas são selecionadas para o maior grupo, G , por meio da seleção da empresa na interseção e as empresas dentro do percentil de $z\%$. Onde y é igual a 38% para

UCITS, 48% para RIC e RIC 10/48, 45% para RIC 22,5/45, RIC 6/45 e RIC 10/45, e 22,5% para índices limitados da Lei 40 e Lei 40 15/22,5. Os pesos limitados a y% na Etapa 1 são descartados.

Etapa 3: Etapa intermediária

Índices com 23 empresas ou mais

- 4.2.2 Qualquer empresa cuja peso sem limitação no índice seja superior a 4,5% será limitada a 4,5%. Os pesos das empresas integrantes remanescentes são aumentados como consequência da redução dos pesos das empresas maiores. Os pesos das empresas integrantes não limitadas serão então verificados e, se excederem 4,5%, também serão limitados a 4,5%. Esse processo é repetido até que o peso de nenhuma empresa exceda 4,5%. O valor w_i' representa o peso da empresa i após o processo de limitação descrito em 4.2.2 e é utilizado na Etapa 4 e nas etapas subsequentes 5a e 6.

Índices com menos de 23 empresas

Seja G o maior grupo de empresas, conforme definido na Etapa 2. É calculado um conjunto de pesos intermediários w' :

$$w_i' = \begin{cases} 4,5\% & , i \in G \\ \frac{w_i}{v} \times 4,5\% & , i \notin G \end{cases}$$

onde $v = \max(w_i : \forall i \notin G)$ é o maior peso sem limitação de todas as empresas que não estão no grupo maior G . Qualquer empresa cujo peso sem limitação no índice seja maior que w' terá limitação a w' , conforme descrito na fórmula acima. Os pesos das empresas integrantes remanescentes são aumentados como consequência da redução dos pesos das empresas maiores. Os pesos das empresas integrantes sem limitação são então verificados e, caso excedam w' também são limitados a w' . Esse processo é repetido até que o peso de nenhuma empresa exceda w' .

w' é utilizado na Etapa 4 e nas etapas subsequentes 5b e 6.

Etapa 4: Ajustar pesos para o grupo maior das empresas

Seja w_i o peso sem limitação para a empresa i, w_i' o peso ajustado da empresa i, e que G denote a coleção das maiores empresas definidas na etapa 2:

$$G = \{i: w_i \text{ está no grupo maior das empresas}\} \quad (\text{E.1})$$

Seja u o peso sem limitação mínimo no grupo dos maiores, G , e seja w_k' o peso ajustado de u da etapa 3.

As cinco maiores empresas que pertencem ao grupo G são então elevadas proporcionalmente a partir dos pesos limitados na Etapa 3, isto é, w' .

Com $u < 4,5\%$

$$w_j^* = w_j' + (z\% - \sum_{j \in G} w_j') \frac{|w_k' - u| + w_j - w_j'}{\sum_{j \in G} |w_k' - u| + w_j - w_j'}, j \in G \quad (\text{E.2.1})$$

Com $u \geq 4,5\%$

$$w_j^* = w_j' + (z\% - \sum_{j \in G} w_j') \frac{|w_j' - w_j|}{\sum_{j \in G} |w_j' - w_j|}, j \in G \quad (\text{E.2.2})$$

Se os pesos de todas as empresas não forem superiores a y%, isto é, $w_i^* \leq y\%, \forall w_i \in G$, então o processo de limitação prossegue para a Etapa 5. Caso contrário, atualize os pesos assim:

Com $u < 4,5\%$

$$w_i^* := \begin{cases} y\% & , w_i^* \geq y\% \\ w_i^* + (z\% - \sum_{w_j^* < y\%} w_j^* - y\%N) \frac{|w_k^* - u| + w_j - w_j^*}{\sum_{w_j^* < y\%} |w_k^* - u| + w_j - w_j^*} & , w_i^* < y\% \end{cases}, i \in G \quad (\text{E.3.1})$$

Com $u \geq 4,5\%$

$$w_i^* := \begin{cases} y\% & , w_i^* \geq y\% \\ w_i^* + \left(z\% - \sum_{w_j^* < y\%} w_j^* - y\%N \right) \frac{|w_i^* - w_j^*|}{\sum_{w_j^* < y\%} |w_j^* - w_j^*|} & , w_i^* < y\% \end{cases}, i, j \in G \quad (E.3.2)$$

Onde N é o número de empresas com pesos iguais ou maiores que y%. (E.3) é repetido até que os pesos de todas as empresas não sejam superiores a y%.

Etapa 5a: Ajustar os pesos das demais empresas (23 empresas ou mais)

Para índices com 23 empresas ou mais, a próxima etapa do processo de limitação ajusta os pesos de todas as empresas restantes cujos pesos sem limitação não correspondam a nenhuma das empresas do grupo G. Seja T o conjunto dessas empresas:

$$T = \{i: w_i \text{ NÃO é uma das empresas do grupo maior}\} \quad (E.4)$$

Então todas as empresas em T são ajustadas:

$$w_i^* = (1 - z\%) \left(\frac{w_i'}{\sum_{j \in T} w_j'} + a \times d_i \right), i \in T \quad (E.5)$$

Onde,

$$d_i = \frac{w_i}{\sum_{j \in T} w_j} - \frac{w_i'}{\sum_{j \in T} w_j'}, i, j \in T \quad (E.6)$$

é a diferença de peso normalizada entre os pesos limitados a 4,5% e os pesos não limitados, e

$$a = \frac{1}{d_h} \left(\frac{0,045}{1 - z\%} - \frac{w_h'}{\sum_{i \in T} w_i'} \right), i, j \in T \quad (E.7)$$

é um ajuste escalar com h denotando a empresa com o peso não limitado mais alto do grupo T.

Se d_h for zero, a limitação está concluída e esta etapa 5a é pulada.

Etapa 5b: Ajustar os pesos das demais empresas (menos de 23 empresas)

Para índices com menos de 23 empresas, a próxima etapa do processo de limitação ajusta os pesos de todas as empresas restantes cujos pesos sem limitação não correspondam a nenhuma das empresas do grupo G. Seja T o conjunto dessas empresas:

$$T = \{i: w_i \text{ NÃO é uma das empresas do grupo maior}\} \quad (E.8)$$

Então todas as empresas em T são ajustadas:

$$w_i^* = w_i' + a \times d_i, i \in T \quad (E.9)$$

Onde

$$d_i = \frac{4,5\% - w_i'}{\sum_{j \in T} (4,5\% - w_j')}, i \in T \quad (E.10)$$

é o ajuste normalizado, e

$$a = (1 - z\%) - \sum_{i \in T} w_i' \quad (E.11)$$

é um ajuste escalar.

Etapa 6: Calcular o fator de limitação

A limitação é concluída com os pesos finais w_i^* para a empresa i no Índice.

Para pesar as empresas no índice, um fator de limitação c_i é calculado para cada empresa i (vide Apêndice B).

$$c_i = \frac{w_i^*}{w_i} \quad (E.12)$$

4.3 Limitação em dois níveis

Etapas 1: Limitar o peso da maior empresa

Se o peso da maior empresa exceder x%, limite-o a x%.

Etapas 2: Calcular os pesos das empresas remanescentes

Qualquer empresa remanescente cujo peso no índice seja superior a y% é limitada a y%.

O excesso de peso gerado nas Etapas 1 e 2 é distribuído entre as empresas do índice que não sofreram limitação. Esse processo é repetido até que a maior empresa não ultrapasse x% e os pesos de todas as demais empresas não ultrapassem y%.

O fator de limitação ao integrante c_i (vide Apêndice B) é descrito na equação E.13.

4.4 Limitação de um nível à empresa

4.4.1 Qualquer empresa cujo peso no índice seja superior a y% será limitada a y%. Os pesos das empresas integrantes remanescentes são aumentados como consequência da redução dos pesos das empresas maiores. Os pesos das empresas integrantes não limitadas serão então verificados e, se excederem y%, também serão limitados a y%. Esse processo é repetido até que o peso de nenhuma empresa exceda y%.

O procedimento de limitação é aplicado usando o algoritmo a seguir:

Nota. O algoritmo é aplicado a cada integrante que requer limitação, isto é, qualquer componente cujo peso sem limitação seja superior a y%.

O fator de limitação ao integrante c_i (vide Apêndice B) é dado por:

$$c_i = \frac{y}{I \times (p_i \times s_i \times f_i)} \sum_{j \in J} (p_j \times s_j \times f_j) \quad (\text{E.13})$$

Onde i é o título a sofrer limitação, j é o título sem limitação, J é o subconjunto de títulos sem limitação, p é o preço de fechamento do título, s é o número de ações em circulação, f é o peso de investibilidade do título, I é a porcentagem do índice representada por todos os integrantes sem limitação e y é o nível percentual de limitação.

4.5 Limitação de três níveis

Fase 1

Qualquer empresa cujo peso for maior que 10% será limitada a 10%. Os pesos de todas as empresas em posições inferiores no ranking serão aumentados de forma correspondente. Os pesos das empresas em posições inferiores serão então verificados. Se eles excederem 10%, também serão limitados a 10%. Este processo é repetido até que o peso de nenhum integrante exceda 10%.

Fase 2

1. Limitar a maior empresa a 10%

Se mais de uma empresa for limitada a 10% na Fase 1, então os pesos de todas as empresas subsequentes anteriormente limitadas a 10% serão modificados de acordo com as regras detalhadas abaixo.

Por exemplo, se a segunda maior empresa for limitada a 10%, seu peso será reduzido a 9%, como explicado na Fase 2b abaixo. Portanto, apenas uma empresa terá um peso de 10% no índice.

2. Limitar a segunda maior empresa a 9%

Se o peso da segunda maior empresa for maior que 9%, então o peso da empresa será limitado a 9%, e os pesos das empresas restantes serão aumentados de forma correspondente.

Seguindo esse procedimento, se o peso total no índice das empresas cujos pesos individuais excedam 5% **NÃO** for superior a 40%, não será necessário aplicar nenhuma outra limitação.

No entanto, se o peso total no índice das empresas cujos pesos individuais excedam 5% **FOR** superior a 40%, o procedimento passa para a fase 2c.

Nota: onde o limiar de 40% for excedido, avançamos à fase 2c mesmo se a segunda maior empresa não tiver sofrido limitação.

3. Limitar a terceira maior empresa a 8%

Se o peso da terceira maior empresa for maior que 8%, então o peso dela será limitado a 8%, e os pesos das empresas restantes serão aumentados de forma correspondente.

Seguindo esse procedimento, se o peso total no índice das empresas cujos pesos individuais excedam 5% **NÃO** for superior a 40%, não será necessário aplicar nenhuma outra limitação.

No entanto, se o peso total no índice das empresas cujos pesos individuais excedam 5% **FOR** superior a 40%, o procedimento passa para a fase 2d.

Nota: onde o limiar de 40% for excedido, avançamos à fase 2d mesmo se a terceira maior empresa não tiver sofrido limitação.

4. Limitar a quarta maior empresa a 7%

Se o peso da quarta maior empresa for maior que 7%, então o peso dela será limitado a 7%, e os pesos das empresas restantes serão aumentados de forma correspondente.

Seguindo esse procedimento, se o peso total no índice das empresas cujos pesos individuais excedam 5% **NÃO** for superior a 40%, não será necessário aplicar nenhuma outra limitação.

No entanto, se o peso total no índice das empresas cujos pesos individuais excedam 5% **FOR** superior a 40%, o procedimento passa para a fase 2e.

Nota: onde o limiar de 40% for excedido, avançamos à fase 2e mesmo se a quarta maior empresa não tiver sofrido limitação.

5. Limitar a quinta maior empresa a 6%

Se o peso da quinta maior empresa for maior que 6%, então o peso dela será limitado a 6%, e os pesos das empresas restantes serão aumentados de forma correspondente.

Seguindo esse procedimento, se o peso total no índice das empresas cujos pesos individuais excedam 5% **NÃO** for superior a 40%, não será necessário aplicar nenhuma outra limitação.

No entanto, se o peso total no índice das empresas cujos pesos individuais excedam 5% **FOR** superior a 40%, o procedimento passa para a fase 2f.

Nota: onde o limiar de 40% for excedido, avançamos à fase 2f mesmo se a quinta maior empresa não tiver sofrido limitação.

6. Limitar a sexta maior empresa a 4%

Se os pesos da sexta maior empresa e de quaisquer outras empresas em posições inferiores forem maiores que 4%, então eles serão limitados a 4%, e os pesos das demais empresas em posições inferiores serão aumentados de forma correspondente.

O procedimento então segue para a Fase 3.

Fase 3

Após a aplicação da Fase 2, os pesos de todas as empresas são avaliados. Se o peso total no índice das empresas cujos pesos individuais excederem 5% for maior que 40% no agregado, então uma limitação adicional será necessária e a Fase 2 será repetida.

As empresas são limitadas usando preços vigentes no encerramento das atividades da segunda sexta-feira em março, junho, setembro e dezembro e nas ações em circulação e livre circulação ajustada para ações corporativas, como na segunda após a terceira sexta. A limitação é implementada depois do encerramento das atividades da terceira sexta-feira do mês de março, junho, setembro e dezembro.

4.6 Limitação ADX

Os índices são limitados trimestralmente tal que o peso da maior empresa não exceda **33%** e o peso de qualquer outra empresa não exceda **18%**.

4.7 Monitoramento diário

4.7.1 Índices com limitação selecionados são monitorados diariamente para garantir que os pesos de seus integrantes não ultrapassem os limiares estabelecidos. Os pesos dos integrantes do índice, utilizados para determinar se o limiar foi ultrapassado, são calculados com base nos preços de fechamento dos integrantes, ajustados para as ações corporativas em cada dia de cálculo, considerando as ações em circulação projetadas, os pesos de investibilidade (após a limitação) e os integrantes conforme designados para entrar em vigência em uma data futura. A data futura é específica para cada índice e consta da tabela na Regra 4.7.4. Por exemplo, o FTSE Latin America UCITS Capped Index considera o próximo dia de negociação (t+1) para determinar as informações dos integrantes.

4.7.2 No dia de cálculo em que um limiar for ultrapassado, o índice é recalculado utilizando a metodologia de limitação, conforme descrita no Apêndice A. A limitação terá base nos preços de fechamento dos integrantes, ajustados para ações corporativas no dia do cálculo, utilizando o número projetado de ações em circulação, pesos de investibilidade e os integrantes conforme designados para entrar em vigor na data futura.

4.7.3 Para índices limitados que ofereçam aviso prévio superior a t+1 (vide tabela na Regra 4.7.4), na revisão periódica da limitação o monitoramento diário não repetirá a limitação de um índice entre a data do cálculo dos fatores de limitação aos integrantes e sua data de vigência.

4.7.4 Os índices abrangidos pelo monitoramento diário estão listados na tabela abaixo.

Índice com limitação	Limiares	Data futura
FTSE Brazil UCITS Daily Capped Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Brazil UCITS Daily Capped Net Tax Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Brazil All Cap UCITS Daily Capped Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Brazil All Cap UCITS Daily Capped Net Tax Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE EPRA Nareit Developed Europe UCITS Daily Capped Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+2
FTSE EPRA Nareit Developed Green Low Carbon Target Select UCITS Capped Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Latin America UCITS Daily Capped Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Latin America UCITS Daily Capped Net Tax Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Latin America All Cap UCITS Daily Capped Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Latin America All Cap UCITS Daily Capped Net Tax Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Mexico UCITS Daily Capped Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1

Índice com limitação	Limiares	Data futura
FTSE Mexico UCITS Daily Capped Net Tax Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Mexico All Cap UCITS Daily Capped Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Mexico All Cap UCITS Daily Capped Net Tax Index	Nenhuma empresa é maior que 10%, e todas as empresas com peso superior a 5% no agregado não são mais que 40% do índice	T+1
FTSE Nareit Equity REITs 40 Act Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
FTSE Nareit Equity REITs 40 Act Capped JPY (TTM) Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell 1000 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell 1000 Growth 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell 1000 Value 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell 2500 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell 2500 Growth 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell 2500 Value 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell 3000 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell 3000 Growth 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell 3000 Value 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell Midcap 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell Midcap Growth 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell Midcap Value 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell Top 50 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell Top 200 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell Top 200 Growth 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell Top 200 Value 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3
Russell Top 500 40 Act Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+3

Índice com limitação	Limiares	Data futura
Russell 1000 Financials 40 Act 15/22.5 Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+4
Russell 1000 Consumer Discretionary 40 Act 15/22.5 Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+4
Russell 1000 Industrials 40 Act 15/22.5 Daily Capped Index	Todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado não são mais que 24% do índice	T+4

4.8 Revisão da limitação ao final do trimestre

- 4.8.1 Índices limitados selecionados ficam sujeitos a uma revisão única no final de cada trimestre corrido, a fim de garantir que os pesos dos integrantes do índice não ultrapassem os limiares estabelecidos. Essa revisão única é calculada com base nos preços de fechamento dos integrantes três dias de negociação antes do último dia útil do trimestre (T-3). Esses preços são ajustados para quaisquer ações corporativas com vigência até o dia T-3 inclusive, e incorporam integrantes projetados, ações em circulação e pesos de investibilidade (após a limitação) conforme designados para entrar em vigência no último dia útil do trimestre.
- 4.8.2 Caso a revisão identifique uma violação do limiar, o índice é limitado novamente utilizando a metodologia de limitação descrita no Apêndice A. A limitação é aplicada com base nos preços de fechamento da data do preço, ajustados para ações corporativas, e incorpora os componentes projetados não limitados, as ações em circulação e os pesos de investibilidade, conforme designado para entrar em vigor no último dia útil do trimestre.
- 4.8.3 Os índices sujeitos à revisão de limites máximos no final do trimestre estão incluídos na tabela abaixo.

Índice com limitação	Limiares	Data do preço	Data de vigência
FTSE Emerging ex China RIC 22.5/45 Capped Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun., set. e dez.
FTSE Emerging ex China RIC 22.5/45 Capped Net Tax (US RIC) Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun., set. e dez.
Russell 1000® Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell 1000® Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell Top 200® Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell Top 200® Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.

³ Se a Reconstituição Russell estiver programada para entrar em vigência após o fechamento do último dia útil de junho, o que significa que ela entrará em vigor na abertura do primeiro dia útil de julho, a verificação da limitação no final do trimestre não será realizada. Nesses casos, será aplicada a regra padrão de limitação nas revisões trimestrais, e os ajustes de limitação já anunciados entrarão em vigência simultaneamente à Reconstituição Russell.

Índice com limitação	Limiares	Data do preço	Data de vigência
Russell Midcap® Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell Midcap® Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell 3000E™ Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell 3000E™ Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell 3000® Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell 3000® Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell Top 500 Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell Top 500 Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell 2500™ Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell 2500™ Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell 2000® Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell 2000® Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell Small Cap Completeness® Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell Small Cap Completeness® Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell Microcap® Value Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.
Russell Microcap® Growth Index	Nenhuma empresa supera 24%, e todas as empresas com peso superior a 4,8% no agregado são, no máximo, 48% do índice	T-3	Último dia útil de mar., jun. ³ , set. e dez.

Seção 5

Ações e eventos corporativos

5. Ações e eventos corporativos

5.1 A íntegra dos detalhes das mudanças nas empresas integrantes devido a ações e eventos corporativos podem ser acessados nos guias de ações e eventos corporativos, usando o seguinte link:

[Corporate Actions and Events Guide.pdf](#)

[Corporate Actions and Events Guide for Non Market Cap Weighted Indices.pdf](#)

Uma “ação” corporativa é uma medida aos acionistas com data ex prescrita. O preço da ação fica sujeito a um ajuste na data ex. O seguinte se inclui:

- Reembolsos de capital;
- Emissão de direitos/ofertas de direitos;
- Conversão de ações;
- Desdobramentos (subdivisão)/grupamentos (consolidação);
- Emissões do tipo scrip (capitalização ou emissão bônus).

Um “evento” corporativo é uma reação a notícias sobre a empresa (evento) que pode impactar o índice, dependendo das regras do índice. Por exemplo, se uma empresa anuncia que um acionista estratégico está vendendo suas ações (oferta secundária de ações), isso pode causar uma alteração no peso free float do índice. Quando um ajuste no índice se faz necessário, a FTSE emite aviso orientando quanto ao cronograma da mudança.

5.2 Entradas rápidas

No caso dos índices que permitem adições durante a revisão, quando um título for adicionado ao índice subjacente como uma entrada rápida, ele também será adicionado ao índice limitado. Para determinar se é necessário aplicar limitação, o novo título é adicionado ao índice limitado com um fator de limitação igual a 1. Caso a inclusão do novo título viole a meta de limitação relevante (p. ex. se seu peso for superior a 10% em uma limitação de nível único à empresa), o índice será limitado de acordo com os procedimentos de limitação relevantes descritos Seção 4. Esse processo utilizará os preços ajustados para eventos corporativos, válidos no encerramento das atividades no primeiro dia de negociação oficial, com base nos integrantes do índice, nas ações em circulação e no free float no dia de negociação seguinte ao quinto dia de negociação oficial.

Quando não for necessário aplicar limitação, atribui-se ao título um fator de limitação igual a 1.

5.3 Cisões

Se uma empresa integrante sofrer cisão e formar duas ou mais empresas por meio da emissão de novas ações aos acionistas existentes, a empresa resultante da cisão seguirá o tratamento de seu índice subjacente. Quando for o caso, a empresa resultante da cisão será incluída no mesmo índice que a empresa de origem, conforme os termos, na data ex da distribuição. A empresa resultante da cisão permanecerá no índice com o mesmo fator de limitação que a empresa de origem até a próxima revisão

periódica. Caso a empresa resultante da cisão não tenha iniciado suas negociações no prazo de 20 dias úteis a partir da data ex da distribuição e nenhuma data definitiva de negociação tenha sido anunciada, ela será normalmente excluída com valor zero, com aviso prévio de T+2.

Apêndice A

Lista de índices com limitação

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
Índices baseados na FTSE UK Index Series					
FTSE 100 Capped 10% Index	FTSE 100 Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.4/ 10%
FTSE All-Share ex Investment Trusts 5% Capped Index	FTSE All-Share ex Investment Trusts	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.4 / 5%
FTSE All-Share Capped 10% Index	FTSE All-Share Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.4/10%
FTSE 100 Capped 5% Index	FTSE 100 Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.4 / 5%
FTSE All-Share Capped 5% Index	FTSE All-Share Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.4 / 5%
Índices baseados na FTSE Global Equity Index Series – Limitação RIC					
FTSE Asia Ex-Japan RIC Capped Index	FTSE Asia Pacific Ex-Japan, Australia, New Zealand Index ²	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Australia RIC Capped Index	FTSE Australia Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Brazil RIC Capped Index	FTSE Brazil Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Canada RIC Capped Index	FTSE Canada Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE China RIC Capped Index	FTSE China Index ²	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Developed Europe RIC Capped Index	FTSE Developed Europe Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Developed Europe RIC Capped Hedged to USD Index ²	FTSE Developed Europe Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
FTSE Emerging ex China RIC 22.5/45 Capped Index	FTSE Emerging ex China Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC 22,5/45
FTSE Emerging ex China RIC 22.5/45 Capped Net Tax (US RIC) Index	FTSE Emerging ex China Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC 22,5/45
FTSE France RIC Capped Index	FTSE France Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Germany RIC Capped Index	FTSE Germany Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Hong Kong RIC Capped Index	FTSE Hong Kong Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE India RIC Capped Index	FTSE India Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Italy RIC Capped Index	FTSE Italy Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Japan RIC Capped Index	FTSE Japan Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Japan RIC Capped Hedged to USD Index ³	FTSE Japan 100% Hedged to USD Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Latin America RIC Capped Index	FTSE Latin America Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Mexico RIC Capped Index	FTSE Mexico Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Saudi Arabia RIC Capped Index	FTSE Saudi Arabia Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE South Korea RIC Capped Index	FTSE South Korea Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Switzerland RIC Capped Index	FTSE Switzerland Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE Taiwan RIC Capped Index	FTSE Taiwan Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE UK RIC Capped Index	FTSE UK Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
Índices baseados na FTSE Global Equity Index Series – Limitação UCITS					

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
FTSE Asia Pacific ex Japan Capped Index	FTSE Asia Pacific ex Japan Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Brazil 30/18 Capped Index	FTSE Brazil Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.3 30%/18%
FTSE Brazil All Cap UCITS Daily Capped Index	FTSE Brazil All Cap Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Brazil All Cap UCITS Daily Capped Net Tax Index	FTSE Brazil All Cap Net Tax Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Brazil UCITS Daily Capped Index	FTSE Brazil Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Brazil UCITS Daily Capped Net Tax Index	FTSE Brazil Net Tax Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE China 30/18 Capped Index	FTSE China Index ¹	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2 30%/18%
FTSE India 30/18 Capped Index	FTSE India Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.3 30%/18%
FTSE Latin America All Cap UCITS Capped Index	FTSE Latin America All Cap Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Latin America All Cap UCITS Daily Capped Net Tax Index	FTSE Latin America All Cap Net Tax Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Latin America UCITS Daily Capped Index	FTSE Latin America Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Latin America UCITS Daily Capped Net Tax Index	FTSE Latin America Net Tax Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Mexico All Cap UCITS Capped Index	FTSE Mexico All Cap Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Mexico All Cap UCITS Daily Capped Net Tax Index	FTSE Mexico All Cap Net Tax Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Mexico UCITS Daily Capped Index	FTSE Mexico Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Mexico UCITS Daily Capped Net Tax Index	FTSE Mexico Net Tax Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
FTSE Korea 30/18 Capped Index	FTSE Korea Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.3 30%/18%
FTSE Kuwait All Cap 15% Capped Index	FTSE Kuwait All Cap Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.4 / 15%
FTSE Saudi Arabia UCITS Capped Index	FTSE Saudi Arabia Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE Saudi Arabia 30/18 Capped Index	FTSE Saudi Arabia Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.3 30%/18%
FTSE Taiwan 30/18 Capped Index	FTSE Taiwan Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.3 30%/18%
Índices baseados em FTSE EPRA Nareit					
FTSE EPRA Nareit Developed Europe UCITS Daily Capped Index	FTSE EPRA Nareit Developed Europe Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE EPRA Nareit Developed REITs UCITS Capped Index	FTSE EPRA Nareit Developed REITs Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE EPRA Nareit Developed Extended Opportunities RIC 6/45 Capped Index	FTSE EPRA Nareit Developed Extended Opportunities Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2 RIC 6/45
FTSE EPRA Nareit Developed Green Low Carbon Target Select UCITS Capped Index	FTSE EPRA Nareit Developed Green Low Carbon Target Select Index[1]	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Segunda após a 2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/UCITS
FTSE EPRA Nareit Ideal Ratings Developed REITs Islamic Green RIC Capped Index	FTSE EPRA Nareit Ideal Ratings Developed REITs Islamic Green Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
Índices baseados em FTSE Nareit					
FTSE Nareit Equity REITs 40 Act Capped Index	FTSE Nareit Equity REITs Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/Lei 40
FTSE Nareit Equity REITs 40 Act Capped JPY (TTM) Index	FTSE Nareit Equity REITs Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/Lei 40
Baseados em outros índices					
FTSE ADX 15 Index	FTSE ADX 15 Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.6
FTSE ADX 15 Islamic Index	FTSE ADX 15 Islamic Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.6

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
FTSE ADX ESG Screened Index	FTSE ADX General Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.6
FTSE All-World Dividend Growth Index	FTSE All-World Dividend Growth Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	4.4 / 5%
FTSE All-World Dividend Growth Net Index	FTSE All-World Dividend Growth Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	4.4 / 5%
FTSE BIVA Index	FTSE Mexico All Cap Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.4./15%
FTSE Gold Mines UCITS Capped Index	FTSE Gold Mines Index	Mensal	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.5/UCITS
FTSE Green Revenues Select Infrastructure and Industrials Index	FTSE Green Revenues Select Infrastructure and Industrials Uncapped Index ³	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC 6/45
FTSE South Africa RIC Capped Index	FTSE South Africa Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC
FTSE TWSE Taiwan 50 30% Capped Index	FTSE TWSE Taiwan 50 Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.4 / 30%
FTSE UK Listed Africa Index	FTSE UK Listed Africa Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.4 / 10%
Renaissance IPO Index	Renaissance IPO Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC 10/48
Renaissance International IPO Index	Renaissance International IPO Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC 10/48
Renaissance International IPO Net Index	Renaissance International IPO Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.2/RIC 10/48
FTSE Vietnam All Cap Inclusion 30/18 Capped Index	FTSE Global All Cap incl Vietnam Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta	Segunda após a 3ª sexta	Regra 4.3 30%/18%
Índices baseados em Russell – 40 ACT					
Russell 1000 40 Act Daily Capped Index	Russell 1000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell 1000 Growth 40 Act Capped Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2 Lei 40

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
Russell 1000 Growth 40 Act Daily Capped Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell 1000 Value 40 Act Daily Capped Index	Russell 1000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell 2500 40 Act Daily Capped Index	Russell 2500™ Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell 2500 Growth 40 Act Daily Capped Index	Russell 2500™ Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell 2500 Value 40 Act Daily Capped Index	Russell 2500™ Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell 3000 40 Act Daily Capped Index	Russell 3000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell 3000 Growth 40 Act Daily Capped Index	Russell 3000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell 3000 Value 40 Act Daily Capped Index	Russell 3000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell Midcap 40 Act Daily Capped Index	Russell Midcap® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell Midcap Growth 40 Act Daily Capped Index	Russell Midcap® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell Midcap Value 40 Act Daily Capped Index	Russell Midcap® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
Russell Top 50 40 Act Daily Capped Index	Russell Top 50® Mega Cap Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell Top 200 40 Act Daily Capped Index	Russell Top 200® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell Top 200 Growth 40 Act Daily Capped Index	Russell Top 200® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell Top 200 Value 40 Act Daily Capped Index	Russell Top 200® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell Top 500 40 Act Daily Capped Index	Russell Top 500 Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40
Russell 1000 Growth 40 Act 15/22.5 Capped Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40 15/22,5

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
Índices baseados em Russell – UCITS					
Russell 1000 Value UCITS Capped Index	Russell 1000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 1000 Growth UCITS Capped Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 1000 Value UCITS Capped Net Tax Index	Russell 1000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 1000 Growth UCITS Capped Net Tax Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 1000 Value UCITS 30/18 Capped Index	Russell 1000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 1000 Growth UCITS 30/18 Capped Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 1000 Value UCITS 30/18 Capped Net Tax 15% Index	Russell 1000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 1000 Growth UCITS 30/18 Capped Net Tax 15% Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 1000 Value UCITS 30/18 Capped Net Tax 30% Index	Russell 1000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 1000 Growth UCITS 30/18 Capped Net Tax 30% Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Russell 2000 UCITS 30/18 Capped Index	Russell 2000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
Russell 2000 UCITS Capped Index	Russell 2000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/UCITS
Índices baseados em Russell RIC					
Russell 2000 RIC Capped Index	Russell 2000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Top 50 RIC Capped Index	Russell Top 50® Mega Cap Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell 1000 RIC Capped Index	Russell 1000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell 1000 RIC Capped Net Tax Index	Russell 1000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell 1000 Growth RIC Capped Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell 1000 Value RIC Capped Index	Russell 1000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell 1000 Value RIC Capped Net Tax Index	Russell 1000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell 1000 Growth RIC 22.5/45 Capped Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Top 200 RIC Capped Index	Russell Top 200® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
Russell Top 200 RIC Capped Net Tax Index	Russell Top 200® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Top 200 Growth RIC Capped Index	Russell Top 200® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Top 200 Value RIC Capped Index	Russell Top 200® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Top 200 Value RIC Capped Net Tax Index	Russell Top 200® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Top 200 Growth RIC 22.5/45 Capped Index	Russell Top 200® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 1000 Hyper Growth RIC Capped Index	Russell 1000 Hyper Growth Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Midcap RIC Capped Index	Russell Midcap® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Midcap RIC Capped Net Tax Index	Russell Midcap® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Midcap Growth RIC Capped Index	Russell Midcap® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Midcap Growth RIC Capped Net Tax Index	Russell Midcap® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell Midcap Value RIC Capped Index	Russell Midcap® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
Russell Midcap Value RIC Capped Net Tax Index	Russell Midcap® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Sexta antes da 4ª sexta em jun., 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC
Russell 1000 Growth RIC 6/45 Capped Index	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	2ª sexta-feira do mês de revisão em mar., set. e dez. 3ª sexta-feira em jun. (a sexta-feira anterior à 4ª sexta-feira)	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 6/45
Russell 1000® Value Index ⁵	Russell 1000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 1000® Growth Index ⁵	Russell 1000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Top 200® Value Index ⁵	Russell Top 200® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Top 200® Growth Index ⁵	Russell Top 200® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Midcap® Value Index ⁵	Russell Midcap® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Midcap® Growth Index ⁵	Russell Midcap® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 3000E™ Value Index ⁵	Russell 3000E™ Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 3000E™ Growth Index ⁵	Russell 3000E™ Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 3000® Value Index ⁵	Russell 3000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
			sexta nos outros meses ⁴	sexta nos outros meses ⁴	
Russell 3000® Growth Index ⁵	Russell 3000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Top 500 Growth Index ⁵	Russell Top 500 Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Top 500 Value Index ⁵	Russell Top 500 Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 2500™ Value Index ⁵	Russell 2500™ Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 2500™ Growth Index ⁵	Russell 2500™ Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 2000® Value Index ⁵	Russell 2000® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 2000® Growth Index ⁵	Russell 2000® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Small Cap Completeness® Value Index ⁵	Russell Small Cap Completeness® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Small Cap Completeness® Growth Index ⁵	Russell Small Cap Completeness® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Microcap® Value Index ⁵	Russell Microcap® Value Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell Microcap® Growth Index ⁵	Russell Microcap® Growth Benchmark Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
			sexta nos outros meses ⁴	sexta nos outros meses ⁴	
Russell California Equity Index	Russell 3000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 10/45
Russell Florida Equity Index	Russell 3000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 10/45
Russell New York Equity Index	Russell 3000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 10/45
Russell Tennessee Equity Index	Russell 3000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 10/45
Russell Texas Equity Index	Russell 3000® Index	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 10/45
Índices baseados em Russell ICB					
Russell 1000 Technology RIC 22.5/45 Capped Index	Russell 1000® Index – Technology	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 1000 Telecommunications RIC 22.5/45 Capped Index	Russell 1000® Index - Telecommunications	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 1000 Health Care RIC 22.5/45 Capped Index	Russell 1000® Index - Health Care	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 1000 Financials 40 Act 15/22.5 Daily Capped Index	Russell 1000® Index - Financials	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40 15/22,5
Russell 1000 Consumer Discretionary 40 Act 15/22.5 Daily Capped Index	Russell 1000® Index - Consumer Discretionary	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40 15/22,5

Índice com limitação	Índice subjacente	Frequência de revisão	Data do preço	Data de vigência	Abordagem/nível de limitação
Russell 1000 Consumer Staples RIC 22.5/45 Capped Index	Russell 1000® Index - Consumer Staples	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 1000 Industrials 40 Act 15/22.5 Daily Capped Index	Russell 1000® Index - Industrials	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/Lei 40 15/22,5
Russell 1000 Basic Materials RIC 22.5/45 Capped Index	Russell 1000® Index - Basic Materials	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 1000 Energy RIC 22.5/45 Capped Index	Russell 1000® Index - Energy	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45
Russell 1000 Utilities RIC 22.5/45 Capped Index	Russell 1000® Index - Utilities	Trimestralmente em mar., jun., set. e dez.	Quarta antes da 3ª sexta em jun., quarta antes da 2ª sexta nos outros meses ⁴	Segunda após a 4ª sexta em jun., segunda após a 3ª sexta nos outros meses ⁴	Regra 4.2/RIC 22,5/45

Notas

1. O índice subjacente baseia-se no FTSE China Index, onde ações do tipo China A shares foram adicionadas a partir da revisão de setembro de 2018, as quais negociam sob a Northbound China Stock Connect Scheme Buy-and-Sell List, com peso de investibilidade de inclusão de 25%, isto é, o índice ficará alinhado à conclusão da fase 1 da inclusão das ações China A shares na FTSE Global Equity Index Series, na revisão semestral de junho de 2020.
2. Como parte da revisão de setembro de 2017, os índices FTSE RIC Capped incluíram as ações do tipo N shares com 100% de seu peso de investibilidade no índice subjacente, isto é, os índices não dividiram em faixas o peso das ações N.
3. Mensalmente, 100% da exposição cambial será coberta no cálculo dos índices com cobertura cambial.
4. Se a última sexta-feira de junho cair no dia 29 ou 30, a reconstituição ocorrerá na sexta-feira anterior, e a data do preço mudará uma semana antes. Para mais detalhes, consulte o guia de construção e metodologia dos Russell US Indices
5. Os Russell US Style Indices padrão passaram a aplicar a metodologia de limitação no início do pregão de 24 de março de 2025. Os índices subjacentes Russell US Style Benchmark são as versões sem limitação dos índices desse estilo. Antes de 24 de março de 2025, são idênticos os históricos do índice padrão Russell US Style e seu respectivo índice Benchmark sem limitação.

Apêndice B

Algoritmo de índice e método de cálculo

O índice com limitação é calculado usando o algoritmo descrito abaixo.

$$\sum_{i=1}^N \frac{(p_i \times e_i \times s_i \times f_i \times c_i)}{d}$$

Onde,

- $i=1, 2, \dots, N$;
- N é o número de títulos no índice;
- p_i é o preço de negociação mais recente do título integrante (ou o preço de fechamento do índice no dia anterior);
- e_i é a taxa de câmbio necessária para converter a moeda do título para a moeda base do índice;
- s_i é o número de ações em emissão usado pela FTSE Russell para o título, conforme definido nas Regras Básicas do índice subjacente;
- f_i é o Fator de Peso de Investibilidade a ser aplicado a um título para permitir alterações em seu peso, expresso como um número entre 0 e 1, onde 1 representa um free float de 100%. Esse fator é publicado pela FTSE Russell para cada título no índice subjacente;
- c_i é o fator de limitação a ser aplicado a um título para pesar esse título corretamente no índice. Esse fator mapeia a capitalização de mercado investível de cada ação para uma capitalização de mercado notional, a fim de sua inclusão no índice;
- d é o divisor, um número que representa o total do capital social emitido no índice na data base. O divisor pode ser ajustado para permitir alterações no capital social emitido de determinados títulos sem distorcer o índice.

Apêndice C

Mais informações

Um glossário de termos utilizados nos documentos de metodologia da FTSE Russell pode ser consultado no link a seguir:

[Glossary.pdf](#)

Mais informações sobre a Metodologia de Limitação da FTSE Russell estão disponíveis na FTSE Russell.

Para os dados de contato, acesse o site da FTSE Russell ou fale com o atendimento ao cliente da FTSE Russell pelo endereço info@ftserussell.com.

Site: www.lseg.com/en/ftse-russell/

Isonção de responsabilidade

© 2026 London Stock Exchange Group plc e seu grupo de empresas associadas ("LSEG"). O LSEG inclui (1) a FTSE International Limited ("FTSE"), (2) a Frank Russell Company ("Russell") e (3) a FTSE Global Debt Capital Markets Inc. "FTSE Canada", (4) FTSE Fixed Income LLC ("FTSE FI"), (5) FTSE (Beijing) Consulting Limited ("WOFE"), (6) FTSE EU SAS ("FES"). Todos os direitos reservados.

FTSE Russell® é um nome comercial da FTSE, da Russell, da FTSE Canada, da FTSE FI, da WOFE, da FES e de outras empresas que prestam serviços de Referências e Índices do LSEG. "FTSE®", "Russell®", "FTSE Russell®", "FTSE4Good®", "ICB®", "Refinitiv", "WMR™", "FR™" e todas as demais marcas comerciais e marcas de serviço utilizadas aqui (sejam elas registradas ou não) são marcas comerciais e/ou marcas de serviço de propriedade ou licenciadas pelo participante aplicável do LSEG ou por seus respectivos licenciadores.

A FTSE International Limited tem autorização de Administradora de Índices de Referência e é regulamentada no Reino Unido (UK) pela Autoridade de Conduta Financeira ("FCA"), de acordo com o Regulamento de Índices de Referência do Reino Unido, Número de Referência FCA 796803. A FTSE EU SAS tem autorização como Administradora de Índices de Referência e é regulamentada na União Europeia (UE) pela Autorité des Marchés Financiers ("AMF"), de acordo com o Regulamento dos Índices de Referência da UE.

Todas as informações são dadas exclusivamente para fins informativos. Todas as informações e dados nesta publicação foram obtidos pelo LSEG a partir de fontes consideradas exatas e confiáveis. Pela possibilidade de erro humano e imprecisão mecânica, bem como de outros fatores, tais informações e dados são mostrados "no estado em que se encontram", sem qualquer tipo de garantia. Nenhum participante do LSEG, nem seus respectivos diretores, representantes, funcionários, parceiros ou licenciadores fazem qualquer declaração, previsão, garantia ou representação de qualquer tipo, expressa ou implicitamente, seja quanto à precisão, tempestividade, completude ou comerciabilidade, de qualquer informação ou dos Produtos LSEG, nem dos resultados decorrentes do uso dos produtos LSEG, incluindo mas não se limitando a índices, taxas, dados e análises, ou o cabimento ou adequação dos produtos LSEG para fins específicos quaisquer para os quais possam ser empregados. O usuário da informação assume todo o risco de qualquer uso que possa fazer ou permitir fazer dessa informação.

Nenhuma responsabilidade ou culpabilidade pode ser atribuída a qualquer participante do LSEG, nem a seus respectivos diretores, representantes, funcionários, parceiros ou licenciadores, por: (a) qualquer perda ou dano, seja total ou parcial, causado por, resultante de, ou relacionado a qualquer erro (resultante de negligência ou não) ou outras circunstâncias envolvendo a compra e venda, coleta, compilação, interpretação, análise, edição, transcrição, transmissão, comunicação ou entrega de quaisquer informações ou dados, ou do uso deste documento ou de links para este documento, ou (b) quaisquer danos diretos, indiretos, especiais, consequenciais ou incidentais de qualquer tipo, mesmo que um participante do LSEG seja avisado antecipadamente da possibilidade de tais danos, resultantes do uso ou capacidade de uso de tais informações.

Nenhum participante do LSEG nem seus respectivos diretores, representantes, funcionários, parceiros ou licenciadores prestam consultoria de investimentos, e nada neste documento deve ser considerado como consultoria financeira ou de investimento. Nenhum participante do LSEG, nem seus respectivos diretores, representantes, funcionários, parceiros ou licenciadores fazem qualquer declaração sobre a conveniência de se investir em qualquer ativo, ou se tal investimento cria quaisquer riscos jurídicos e de conformidade para o investidor. A decisão de investir em qualquer desses ativos não deve ser tomada tendo por base as informações deste documento. Não é possível investir diretamente em índices e taxas. A inclusão de um ativo em um índice ou taxa não é recomendação para comprar, vender, ou manter esse ativo, nem é confirmação de que qualquer investidor possa legalmente comprar, vender ou manter o ativo, ou um índice ou taxa que contenha o ativo. As informações gerais contidas nesta publicação não devem ser utilizadas sem buscar consultoria jurídica, tributária e de investimentos com um profissional habilitado.

Nenhuma parte destas informações pode ser reproduzida, armazenada em um sistema de consulta ou transmitida de qualquer forma ou por quaisquer meios – eletrônicos, mecânicos, de fotocópia, gravação ou outros – sem autorização prévia por escrito do respectivo participante do LSEG. O uso e a distribuição dos dados do LSEG requerem autorização do LSEG e/ou de seus licenciadores.