

20 de junho de 2023
100/2023-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado e Balcão B3

Ref.: **Tratamento de Posições de Empréstimo, Termo, Opções, Falha de Entrega, Recompra, Ativos Depositados em Garantia e Carteiras de Índices em virtude de OPA para Conversão de Registro de Companhia Aberta e Saída do Novo Mercado da EDP - Energias do Brasil S.A.**

A EDP – Energias do Brasil S.A. (ENBR3) divulgou Fato Relevante, em 31/05/2023, no qual informa a aprovação, por parte da CVM, de registro de Oferta Pública de Aquisição (OPA) de ações ordinárias para fins de conversão de registro de companhia aberta na categoria A para companhia aberta na categoria B e saída do Novo Mercado da B3, a ser realizada em 11/07/2023, conforme edital publicado em 31/05/2023.

Ocorrendo a aceitação da OPA em percentual que possibilite a conversão de sua categoria de registro de companhia aberta e mediante a aprovação da conversão de registro pela CVM com a consequente deslistagem de ENBR3, o tratamento das posições de empréstimo de ativos, termo de ações, opções, falha de entrega, recompra e ativos depositados em garantia ocorrerá de acordo com o indicado abaixo.

1. Posições de empréstimo de ativos

O comitente doador do empréstimo de ativos que desejar participar da OPA deverá realizar a liquidação antecipada de seu contrato, respeitada a

característica de reversibilidade, em tempo hábil para receber o ativo e depositá-lo na carteira específica na Central Depositária da B3. O comitente doador deve considerar nesse processo os prazos de liquidação e possíveis falhas de entrega do ativo.

Os contratos que ainda estejam ativos em D+3 da última data de negociação de ENBR3, quando da aprovação da conversão de registro pela CVM, serão, no dia útil seguinte, removidos do sistema da Câmara B3, ocorrendo nessa data a liquidação financeira entre tomador (débito) e doador (crédito) através da janela de liquidação multilateral da Câmara B3.

A liquidação financeira dos contratos de ENBR3 será efetuada com o preço determinado por ocasião da OPA, sendo este corrigido da data de liquidação da oferta até a data de liquidação financeira dos contratos de empréstimos de ativos, de acordo com o critério estabelecido pela Companhia no edital da oferta, multiplicado pela quantidade em aberto de cada contrato.

Os comitentes que optarem pela liquidação antecipada dos contratos de empréstimo de ativos deverão solicitá-la até o prazo-limite cuja data de liquidação seja inferior à data de liquidação financeira dos contratos em aberto. Dessa forma, pedidos de liquidação antecipada com data liquidação igual ou superior a data de liquidação financeira dos contratos em aberto serão desconsiderados e os contratos serão liquidados financeiramente.

Por ocasião da liquidação financeira dos contratos, os valores referentes a taxas e emolumentos serão calculados e liquidados na data de liquidação financeira, utilizando o preço de referência de cada contrato e considerando o prazo entre a data de abertura de cada contrato e a data de liquidação financeira.

Não será permitida a contratação de empréstimos a partir de D+4 da última data de negociação de ENBR3.

2. Termo de ações

O comprador a termo que desejar participar da OPA deverá realizar a liquidação antecipada de seu contrato, em tempo hábil para receber o ativo e depositá-lo na carteira específica na Central Depositária da B3. O comprador a termo deve considerar nesse processo os prazos de liquidação e possíveis falhas de entrega do ativo.

Para os contratos de termo de ações que estiverem ativos em D+3 da última data de negociação de ENBR3, quando da aprovação da conversão de registro pela CVM, a B3 procederá, nessa data, o pedido de liquidação antecipada desses contratos para o dia útil seguinte. Os contratos que, em D+3 da última data de negociação ENBR3, possuírem pedidos de liquidação antecipada em andamento para datas posteriores, terão a liquidação adiantada para o dia útil seguinte.

Para os contratos de termo de ações que estiverem ativos em D+3 da última data de negociação de ENBR3, porém ainda não cobertos, será realizada a liquidação financeira da posição pela diferença entre o preço a termo e o preço dado por ocasião da OPA, sendo este corrigido da data de liquidação da oferta até D+4 da última data de negociação de ENBR3, de acordo com o critério estabelecido pela Companhia no edital. Em caso de resultado positivo, o valor da liquidação financeira será debitado do comprador a termo e creditado ao vendedor a termo, em caso de resultado negativo, o valor da liquidação financeira será debitado do vendedor a termo e creditado ao comprador a termo. A liquidação financeira ocorrerá em D+4 da última data de negociação de ENBR3 através da janela de liquidação multilateral da Câmara B3.

3. Opções

Para as posições de opções de ações que ainda estejam em aberto em D+3 da última data de negociação de ENBR3, quando da aprovação da conversão de registro pela CVM, a B3 procederá, nesta data, a antecipação do vencimento de todas as posições, com a remoção do sistema da Câmara B3, no encerramento do dia, de todas as posições em aberto de opção sobre ENBR3.

A liquidação financeira entre lançador (débito) e titular (crédito) das posições vencidas no dia útil anterior é efetuada no quarto dia útil subsequente à última data de negociação de ENBR3, conforme descrito a seguir.

Opção de compra

$$VL = \text{Máximo}(PA - PE, 0) * Q$$

Opção de venda

$$VL = \text{Máximo}(PE - PA, 0) * Q$$

Onde:

VL = valor de liquidação da posição;

PA = preço da ação determinado por ocasião da OPA, sendo este corrigido da data de liquidação da oferta até a data de liquidação financeira dos contratos de opção, de acordo com o critério estabelecido pela Companhia no edital da oferta;

PE = preço de exercício da série da opção;

Q = quantidade da posição.

Não poderá ocorrer exercício de opções de ENBR3 cuja data de liquidação seja maior ou igual à data de liquidação financeira das posições.

4. Ações depositadas em garantia

A partir da abertura do pregão do dia 11/07/2023, o ativo ENBR3 deixará de ser elegível para constituição de garantias na Câmara B3.

5. Posições de falha de entrega e de recompra

As posições de falha de entrega e de recompra que estiverem em aberto em D+3 da última data de negociação de ENBR3, serão revertidas, com liquidação no dia útil seguinte, utilizando-se o preço determinado por ocasião da OPA, sendo este corrigido da data de liquidação da oferta até a data de liquidação financeira da reversão, de acordo com o critério estabelecido pela Companhia no edital da oferta

6. Tratamento para posições de derivativos de opções flexíveis de Balcão com CCP

Para as posições de opções flexíveis com CCP de ações de ENBR3 que ainda estejam em aberto em D+1 da última data de negociação, quando da aprovação da conversão de registro pela CVM, deverá ocorrer a antecipação das posições conforme definido pelas partes. A antecipação da posição é obrigação do Participante de Registro, caso não haja manifestação em D+1 da última data de negociação de ENBR3, a B3 irá realizar a antecipação nesta data baseando-se no disposto no Manual de Normas de Operação com Derivativo.

7. Procedimentos nas carteiras dos índices

7.1. Sucesso para conversão de registro

Ocorrendo o sucesso da OPA para conversão de registro da categoria, após o encerramento da sessão regular de negociação de 11/07/2023, o ativo ENBR3 será excluído das carteiras dos índices mencionados abaixo ao preço do Leilão da OPA.

- Índice de Ações com Governança Corporativa Diferenciada (IGCX)
- Índice de Governança Corporativa – Novo Mercado (IGNM)
- Índice de Governança Corporativa Trade (IGCT)
- Índice Bovespa B3 (IBOV)
- Índice Brasil Amplo BM&FBOVESPA (IBRA)
- Índice Brasil 100 (IBXX)
- Índice Carbono Eficiente (ICO2)
- Índice de Ações com Tag Along Diferenciado (ITAG)
- Índice de Energia Elétrica (IEEX)
- Índice Small CAP (SMLL)
- Índice Utilidade Pública BM&FBOVESPA (UTIL)
- Índice de Sustentabilidade Empresarial (ISEE)
- Índice Dividendos BM&FBOVESPA (IDIV)

7.2. Sucesso para saída do Novo Mercado

Caso a aceitação atinja a quantidade de valores mobiliários entre 1/3 (um terço) e 2/3 (dois terços) do total habilitado, somente a OPA para saída do Novo Mercado será considerada bem-sucedida, e o ativo ENBR3 será excluído dos índices abaixo.

- Índice de Ações com Governança Corporativa Diferenciada (IGCX)
- Índice de Governança Corporativa – Novo Mercado (IGNM)
- Índice de Governança Corporativa Trade (IGCT)

Para as seguintes carteiras, a quantidade será diminuída em 82.009.394 ações, permanecendo com a quantidade de 164.018.790.

- Índice Bovespa B3 (IBOV)
- Índice Brasil Amplo BM&FBOVESPA (IBRA)
- Índice Brasil 100 (IBXX)
- Índice Carbono Eficiente (ICO2)
- Índice de Ações com Tag Along Diferenciado (ITAG)
- Índice Small CAP (SMLL)
- Índice Utilidade Pública BM&FBOVESPA (UTIL)

Para o **Índice Dividendos BM&FBOVESPA (IDIV)**, a quantidade será diminuída em 133.437.967 ações, permanecendo com a quantidade de 266.875.936. Para o **Índice de Sustentabilidade Empresarial (ISEE)**, a quantidade será diminuída em 167.053.254 ações, permanecendo com a quantidade de 334.106.511.

O preço de retirada das ações de todas as carteiras acima será determinado pelo preço do leilão. A quantidade restante permanecerá nas carteiras ao preço de fechamento de ENBR3 no mercado a vista do dia 11/07/2023.

7.3. Aceitação insuficiente

Caso a aceitação não atinja a quantidade mínima de valores mobiliários correspondente a 1/3 (um terço) do total habilitado, o ativo ENBR3 permanecerá nas carteiras dos índices acima, sem nenhum ajuste na quantidade teórica.

Esses procedimentos serão divulgados, diariamente, por meio da Agência de Notícias, nas telas de negociação e no site www.b3.com.br, em Market data e Índices, Índices, Índices Amplos, Índice Bovespa (Ibovespa B3), Agência de notícias.

Caso não ocorra aceitação mínima à OPA que possibilite a conversão de registro, não serão aplicados os procedimentos descritos neste Ofício Circular para as posições de empréstimo, termo, opções, recompra e ativos depositados em garantia.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Suporte aos Processos e Serviços de Liquidação, pelo telefone (11) 2565-5013 ou pelo e-mail liquidacao.posicoes@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

Mario Palhares
Vice-Presidente de Operações –
Negociação Eletrônica e CCP