



20 de dezembro de 2022
189/2022-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Tratamento das Posições, Garantias e Carteiras de Índices da B3 em virtude do Evento de Incorporação da Sul América S.A. pela Rede D'Or São Luiz S.A.**

Em 20/12/2022, por meio de Fatos Relevantes, a Sul América S.A. (Sul América) e a Rede D'Or São Luiz S.A. (Rede D'Or) divulgaram os procedimentos para a operacionalização da incorporação da Sul América pela Rede D'Or, conforme aprovado em assembleias realizadas em 14/04/2022 nas companhias.

Conforme divulgado, em virtude da incorporação, cada ação ordinária ou preferencial de emissão da Sul América será substituída por 0,255078 ação ordinária Rede D'Or e cada unit da Sul América, composta por 1 ação ordinária e 2 ações preferenciais, será substituída por 0,765234 ação ordinária Rede D'Or, considerando os negócios realizados até o pregão de 23/12/2022, inclusive.

Dessa forma, a partir de **26/12/2022**, as ações e as units de emissão da Sul América deixarão de ser negociadas.

1. Procedimentos nas carteiras dos índices

Para a abertura da sessão de negociação de 26/12/2022, serão adotados os procedimentos de ajuste descritos a seguir.

1.1. Nas carteiras dos índices IBOV (Ibovespa), IBXX (Índice Brasil 100), IGCT (Índice de Governança Corporativa Trade), IBRA (Índice Brasil Amplo), IVBX (Índice Valor BM&FBOVESPA), ITAG (Índice de Ações com Tag Along Diferenciado) e IGCX (Índice de Ações com Governança Corporativa Diferenciada), serão excluídas as units SULA11 após o encerramento da negociação do dia 23/12/2022 ao preço do último negócio realizado na B3. A respectiva quantidade teórica multiplicada pelo fator de troca (0,765234) será incrementada na quantidade teórica da RDOR3.

Dessa forma, para os índices IBOV, IBXX, IGCT, IBRA, IVBX e ITAG a quantidade final de RDOR3 será de 1.149.420.675 ações; e para o índice IGCX, será de 2.190.155.282 ações, respeitando sua metodologia.

Não será realizado ajuste nos redutores em consequência da conversão. Dessa forma, poderá ocorrer divergência entre os valores de fechamento desses índices em 23/12/2022 e seus valores para pré-abertura do dia 26/12/2022.

1.2. Para os índices ICON (Índice de Consumo), IGNM (Índice de Governança Corporativa – Novo Mercado), MLCX (Índice MidLarge Cap) e IBXL (Índice Brasil 50), a quantidade teórica de RDOR3 não será alterada, conforme definido no item 3.5, inciso IV do Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3, sendo ajustada apenas no próximo rebalanceamento periódico.

O manual está disponível no site www.b3.com.br, em Market data e Índices, Índices, Índices Amplos, Índice Bovespa (Ibovespa B3), Manual de Definições e Procedimentos.

1.3. Nas carteiras dos índices ICO2 (Índice Carbono Eficiente), ISEE (Índice de Sustentabilidade Empresarial), SMLL (Índice Small Cap) e IFNC (Índice BM&FBOVESPA Financeiro), as units SULA11 serão excluídas após o encerramento da negociação do dia 23/12/2022, ao preço do último negócio realizado na B3, com a devida alteração no redutor.

Uma vez que a companhia incorporadora não atende aos critérios de elegibilidade desses índices, não será feita a sua inclusão nos índices acima citados, de acordo com suas metodologias.

1.4. Para fins de rebalanceamento periódico, o tratamento dos dados históricos será efetuado com a migração de 100% do histórico de negociação de SULA11 para RDOR3.

Ressaltamos que os redutores de todos os índices acima poderão ser ajustados em caso de eventos corporativos que ocorram nos demais ativos que compõem as carteiras.

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.

2. Posições de balcão em opções flexíveis com CCP de SULA11

As posições de opções flexíveis de SULA11 em aberto no dia 23/12/2022 serão convertidas em opções flexíveis de RDOR3 na proporção de 0,765234, com ajuste nas quantidades e nos preços de exercício das opções. As quantidades dos contratos serão multiplicadas por 0,765234 (truncadas em zero casas decimais),

enquanto os preços de exercícios serão divididos por 0,765234, arredondados na segunda casa decimal. As barreiras e os limitadores serão multiplicados pela proporção original do contrato, conforme seção 1.3 do Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis CCP, preservando o equilíbrio econômico das posições.

3. Ativos depositados em garantias

Em 26/12/2022, todas as ações da SULA depositadas em garantias serão convertidas em ações de RDOR. As ações da RDOR serão aceitas em garantias, conforme os critérios de elegibilidade de garantias descritos no item 6.3 (Limites de aceitação de ativos para constituição de garantia) do Manual de Administração de Risco da Câmara B3.

4. Posições de Opções, Termos e Empréstimos de Ativos

Todos os procedimentos aplicáveis à conversão das posições de opções, termos e empréstimos de ativos de SULA em posições de RDOR estão disponíveis no Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3 no item 7.9 (Tratamento de eventos corporativos e eventos de renda fixa pública) nos subitens relacionados ao tratamento de eventos corporativos em ativos com alteração do ativo-objeto.

5. Posições de falha de entrega e recompra

O processo de conversão das posições de falha de entrega e recompra estão descritos no subitem 3 dos itens 7.9.4 (Tratamento de eventos corporativos para posições de falha de entrega) e 7.9.5 (Tratamento de eventos corporativos para posições de recompra de ativos) do Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3.

189/2022-PRE

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Suporte aos Processos e Serviços de Liquidação, pelo telefone (11) 2565-5013, opção 2, ou pelo e-mail liquidacao.posicoes@b3.com.br; com a Diretoria de Negociação Eletrônica, pelo telefone (11) 2565-5021 ou pelo e-mail negociacao@b3.com.br, e com a Superintendência de Operações de Balcão pelo telefone (11) 2565-5044 ou pelo e-mail op.derivativosbalcao@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

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