



1 de fevereiro de 2022

016/2022-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado e Balcão B3

Ref.: **Tratamento das Posições, Garantias e das Carteiras de Índices em virtude da Combinação de Negócios da Notre Dame S.A. e Hapvida S.A.**

Em 20/01/2022, por meio de Comunicado ao Mercado, Notre Dame Intermédica Participações S.A. e Hapvida Participações e Investimentos S.A. divulgaram a operacionalização da combinação de negócios, que resultará na incorporação da Notre Dame Intermédica Participações S.A. (GNDI) pela Hapvida Participações e Investimentos S.A. (HAPV) (Comunicado ao Mercado).

No âmbito da Operação, a GNDI terá as ações de sua emissão incorporadas pela Hapvida Participações e Investimentos II S.A. (HapvidaCo) (subsidiária integral da HAPV), de forma que cada ação da GNDI será substituída por 1 ação ordinária e 1 ação preferencial resgatável de emissão da HapvidaCo.

Ato contínuo, (i) as ações preferenciais resgatáveis de HapvidaCo serão resgatadas pelo valor de R\$5,12601160179 por ação, considerando o desconto dos dividendos extraordinários declarados pela GNDI, conforme Fato Relevante divulgado pela GNDI em 20/01/2022, e a atualização pela variação do CDI a partir de 29/03/2021 (exclusive) até o dia 20/01/2022 (inclusive); (ii) as ações ordinárias

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.

Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP

Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737

016/2022-PRE

de HapvidaCo serão incorporadas pela HAPV, com a entrega de 5,2436 ações ON de HAPV para cada ação ordinária de HapvidaCo.

Dessa forma, os acionistas da GNDI receberão para cada ação de sua titularidade, considerando os negócios realizados em 11/02/2022, 5,2436 ações HAPV3 e o valor de R\$5,12601160179 por ação, considerando o desconto dos dividendos extraordinários declarados pela GNDI, correspondente ao valor de R\$1,613026961 por ação, conforme Comunicado ao Mercado divulgado pela GNDI em 20/01/2022, e a atualização pela variação do CDI a partir de 29/03/2021 (exclusive) até 20/01/2022 (inclusive).

As Companhias informarão oportunamente ao mercado o valor final de resgate da ação preferencial de HapvidaCo com a atualização pelo CDI até a data de operacionalização da operação, conforme Comunicado ao Mercado divulgado em 20/01/2022 pelas Companhias.

As ações da GNDI deixarão de ser negociadas em razão da combinação de negócios com a HAPV em 14/02/2022.

Eventuais frações de HAPV serão agrupadas e vendidas em leilão na B3, sendo o valor apurado pago proporcionalmente aos titulares das frações.

Em razão da incorporação de GNDI por HAPV, a B3 informa o tratamento a ser dado às posições de empréstimo de ativos, opções, termo, ativos depositados em garantia e das carteiras de índices.

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.

Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP

Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737

1. Empréstimo de ativos

Em 15/02/2022, todas as posições ativas de contratos de empréstimo de GNDI3 serão convertidas em novos contratos de HAPV3 e eventuais frações decorrentes da Operação serão contempladas nos contratos resultantes da aplicação do evento, sendo a quantidade e o preço ajustados conforme disposto no subitem 3 (Eventos corporativos em ativos com alteração do ativo-objeto) do item 6.8.3 (Tratamento de eventos corporativos para posições de empréstimo de ativos) do Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3, mantendo-se o volume e as demais características do contrato original inalterados. Cada contrato convertido receberá a provisão da parcela em dinheiro por ação preferencial resgatável da HapvidaCo, conforme descrito no Comunicado ao Mercado divulgado em 20/01/2022 pelas Companhias.

Na data estabelecida pelas Companhias, ocorrerá a liquidação financeira do valor de resgate por meio da janela de liquidação multilateral, debitando do comitente tomador e creditando ao comitente doador o valor em reais devidamente corrigido conforme definido pelas Companhias. O valor da parcela em dinheiro ficará sujeito ao tratamento tributário aplicável ao evento e à categoria do comitente¹.

¹ Os eventuais ganhos auferidos pelos investidores em decorrência do resgate das ações preferenciais poderão estar sujeitos à incidência de Imposto de Renda, de acordo com as normas legais e regulamentares aplicáveis a cada categoria de investidor, devendo o contribuinte ou responsável tributário, conforme o caso, responsabilizar-se pelo eventual recolhimento do referido imposto.

2. Posições de opções listadas de GNDI3

Com o objetivo de preservar o equilíbrio econômico para os detentores dessas opções, antes e depois do evento societário, as posições em opções de compra e venda de GNDI3, que estiverem em aberto ao final do dia 11/02/2022, serão convertidas em opções de compra e venda de uma cesta de ações, composta de ações de HAPV3 e do valor da parcela em dinheiro, com o código de ativo-objeto de HAPV99.

As opções de compra e venda sobre GNDI3 serão convertidas na proporção de 1 (um) para 1 (um) em opções de compra e venda sobre HAPV99, com os mesmos preços de exercício.

Observando as proporções determinadas pelas Companhias e o lote mínimo de negociação das opções, as cestas serão compostas sempre por múltiplos de 100. Cada lote-padrão de 100 HAPV99 será composto de 524 ações de HAPV3 e do valor financeiro referente a 100 vezes o valor da parcela em dinheiro por ação resgatável da HapvidaCo.

2.1 Ações depositadas em cobertura de opções de compra de GNDI3 e cobertura de opções de compra de HAPV99

Para as opções de compra de HAPV99, que estiverem cobertas com GNDI3 no encerramento de 15/02/2022, os saldos em custódia serão convertidos de forma compulsória de GNDI3 em HAPV99 na abertura do dia 16/02/2022, para aquelas ações que permaneceram na carteira de cobertura 2701-4 no momento de conversão e a provisão da parcela em dinheiro será bloqueada para movimentação, junto a conta de custódia do investidor que mantém a cobertura da opção.

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.

Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP

Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737

016/2022-PRE

O saldo de HAPV3 não utilizado na formação da cesta de HAPV99 ficará disponível para movimentação do agente de custódia do investidor.

Para o cálculo de margem nos dias 14 e 15/02/2022, as opções de compra de HAPV99, que estiverem cobertas com GNDI3 durante esse período, serão consideradas cobertas.

A partir de 16/02/2022, novos pedidos de cobertura poderão ser solicitados pelo participante, por meio do sistema RTC, após a criação e o depósito de HAPV99 pelo agente de custódia.

2.2 Montagem e desmontagem da cesta de ações HAPV99

Para a criação da cesta HAPV99, os agentes de custódia deverão solicitar sua emissão por meio da funcionalidade específica do sistema da Central Depositária (CAC), no menu Emissão e Resgate, BDR e Unit, Solicitar Emissão de BDR e Unit.

O agente de custódia deve incluir o investidor, informar o código ISIN da cesta (BRHAPVCDAXX4) e a quantidade de cestas que deseja emitir, lembrando que somente múltiplos de 100 quantidades poderão ser solicitadas. O investidor deverá ter as ações de HAPV3 e a provisão da parcela em dinheiro relativo às ações resgatáveis equivalentes em sua carteira livre (2101-6) para conseguir efetuar o pedido. Caso o investidor não tenha a sua disposição a provisão da parcela em dinheiro relativo às ações resgatáveis, a montagem da cesta poderá ser feita mediante aporte do valor financeiro proporcional à parcela em dinheiro, a ser debitado pela Câmara B3 no momento da montagem da cesta. Essas ações ficarão bloqueadas até a conclusão do processo de emissão da cesta. Processos solicitados até as 18h serão emitidos no mesmo dia. Solicitações após esse horário serão atendidas até o dia útil subsequente.

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.
Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP
Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737

016/2022-PRE

A provisão da parcela em dinheiro relativa às ações resgatáveis será bloqueada por meio da movimentação para carteira específica, quando da montagem da cesta ou desbloqueada, quando da desmontagem da cesta.

A criação da cesta HAPV99 somente será admitida para a cobertura das posições em opções de compra.

A desmontagem da cesta será realizada de forma automática, após a liquidação do último exercício das séries vigentes ou por solicitação do agente de custódia, por meio da funcionalidade específica do sistema da Central Depositária (CAC), no menu Emissão e Resgate, BDR e Unit, Solicitar Cancelamento de BDR e Unit.

O agente de custódia deve incluir o investidor, informar o código ISIN da cesta (BRHAPVCDAXX4) e a quantidade de cestas que deseja cancelar. O investidor deverá ter a cesta HAPV99 em sua carteira livre para que consiga efetuar o pedido. Essas cestas ficarão bloqueadas até a conclusão do processo de cancelamento da cesta. Processos solicitados até as 18h serão emitidos no mesmo dia. Solicitações após esse horário serão atendidas até o dia útil subsequente.

O valor da parcela em dinheiro relativo às ações preferenciais resgatáveis de HapvidaCo não será pago aos detentores de saldo de cobertura na data estabelecida pela Companhia, ficando este provisionado para liquidação por ocasião do exercício da cesta de HAPV99.

2.3 Negociação

As séries de opções abertas de GNDI3 convertidas em séries de opções sobre HAPV99 continuarão disponíveis para negociação até a data de seu vencimento.

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.

Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP

Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737

No entanto, não será permitida a abertura de novas séries sobre HAPV99. A cesta HAPV99 não será negociada no mercado à vista e não estará disponível para operações de empréstimo no Sistema de Empréstimo de Ativos (BTB).

2.4 Exercício das opções de HAPV99

Os negócios de exercício das opções de compra e de venda das séries de opções sobre HAPV99 serão cancelados pela Diretoria de Negociação Eletrônica da B3 no final do dia e substituídos por um ou mais negócios de HAPV3. Para cada 100 cestas de HAPV99, serão gerados negócios de 524 ações de HAPV3.

Na data de liquidação do exercício, será realizado o lançamento financeiro relativo à liquidação da parcela em dinheiro, além do lançamento financeiro referente à liquidação da fração de HAPV3 gerada pelo lote-padrão de 100 cestas.

A identificação dos negócios de mercado à vista oriundos do exercício da cesta de ações será divulgada pela B3, conforme Comunicado Externo 003/2022-VNC.

Os investidores que possuírem posições cobertas de HAPV99 deverão solicitar na Central Depositária da B3 a desmontagem da cesta para atender à liquidação nos ativos resultantes do exercício.

Os critérios para apuração dos preços dos negócios de HAPV3 gerados pelo processo de exercício da cesta de HAPV99, do valor financeiro resultante da fração de HAPV3 e do valor da parcela em dinheiro da ação resgatável estão descritos no Anexo deste Ofício Circular.

2.5 Publicação do valor da cesta

A B3 passará a divulgar, nas plataformas de Market Data (UMDF PUMA e UMDF PUMA Conflated), o valor do último preço da cesta de ações composta por HAPV3 e o valor da parcela em dinheiro por ação resgatável.

A publicação será por meio do código HAPV, de 30 em 30 segundos, e terá início em 14/02/2022. O preço da cesta publicado (semelhante a um IOPV) será o valor do preço do último negócio de HAPV3, multiplicado pela proporção de HAPV3 mais o valor da parcela em dinheiro por ação resgatável.

O primeiro preço será divulgado somente quando HAPV3 tiver sido negociada. Dessa maneira, também serão publicados os valores de mínimo, máximo e médio da cesta, levando em consideração os preços publicados.

A publicação do valor da cesta ocorrerá até o último dia em que houver instrumentos derivativos com posição em aberto sobre a cesta.

3. Termo de ações

O processo de conversão das posições de termo de ações está descrito conforme o disposto no subitem 3 (Eventos corporativos em ativos com alteração do ativo-objeto) do item 6.8.2 (Tratamento de eventos corporativos para contrato a termo de ativos) do Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3 e ocorrerá ao final do dia 11/02/2022 sobre todas as posições em aberto de termo de ações GNDI3 nessa data.

A quantidade de ações GNDI3 depositada na conta de cobertura do contrato a termo será convertida em ações da HAPV3 na data de efetivação da Operação na Central Depositária da B3. O valor da parcela em dinheiro, bem como eventuais

frações de HAPV3 decorrentes da aplicação do evento serão entregues ao comprador pela Central Depositária da B3.

O valor da parcela em dinheiro não será considerado para efeitos de crédito de margem em razão da conversão dos contratos a termo de GNDI3, uma vez que a data de pagamento da parcela em dinheiro da Operação encontra-se fora do horizonte de risco de 10 dias considerado pela metodologia de cálculo de risco CORE.

Eventuais chamadas de margem ocasionadas pelos tratamentos aplicados aos contratos a termo e de empréstimo deverão ser atendidas pelos participantes nos prazos e de acordo com os procedimentos usuais de chamada de margem estabelecidos nos normativos da B3.

4. Posições de falha de entrega e recompra de GNDI3

O processo de conversão das posições de falha de entrega e recompra estão descritos no subitem 3 dos itens 6.8.4 (Tratamento de eventos corporativos para posições de falha de entrega) e 6.8.5 (Tratamento de eventos corporativos para posições de recompra de ativos) do Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3.

5. Posições de balcão em opções flexíveis com CCP de GNDI3

Com o objetivo de preservar o equilíbrio econômico para os detentores dessas opções flexíveis, antes e depois do evento societário, as posições em opções flexíveis de compra e venda de GNDI3, que estiverem em aberto ao final do dia 11/02/2022, serão convertidas em opções de compra e venda de uma cesta de

016/2022-PRE

ações, composta de ações de HAPV3 e do valor da parcela em dinheiro, com o código de ativo-objeto de HAPV99.

As opções de compra e venda sobre GNDI3 serão convertidas na proporção de 1 (um) para 1 (um) em opções de compra e venda sobre HAPV99, com os mesmos preços de exercício.

6. Ativos depositados em garantias

Em 15/02/2022, todas as ações da GNDI3 depositadas em garantia serão convertidas em ações de HAPV3. As ações da HAPV3 são 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.

Os comitentes receberão uma parcela do valor correspondente em dinheiro, porém, será pago diretamente ao custodiante e poderá ser depositado novamente em garantias para poder fazer parte do portfólio de colaterais para efeito de cálculo de margem. Os participantes responsáveis por seus comitentes deverão avaliar necessidade de recomposição de garantias por conta dessa parcela em dinheiro.

7. Procedimentos nas carteiras dos índices

Para a abertura da sessão de negociação de 14/02/2022, serão adotados os procedimentos de ajuste descritos a seguir.

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.

Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP

Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737

10

7.1. Nas carteiras dos índices IBOV (Ibovespa), ICON (Índice de Consumo), IBXX (Índice Brasil 100), IGCT (Índice de Governança Corporativa Trade), IGMN (Índice de Governança Corporativa – Novo Mercado), IBrA (Índice Brasil Amplo), MLCX (Índice MidLarge Cap), IVBX (Índice Valor BM&FBOVESPA), ITAG (Índice de Ações com Tag Along Diferenciado), IBXL (Índice Brasil 50), e IGCX (Índice de Ações com Governança Corporativa Diferenciada), serão excluídas as ações de GNDI3 após o encerramento da negociação do dia 11/02/2022 ao preço do último negócio realizado na B3, e as respectivas quantidades teóricas multiplicadas pelo fator de troca (5,2436) serão incrementadas na quantidade teórica da HAPV3.

Dessa forma, para os índices IBOV, ICON, IBXX, IGCT, IGMN, IBrA, MLCX, IVBX e ITAG a quantidade final de HAPV3 será de 4.411.767.198 ações e para o IGCX 8.823.534.396 ações. Os valores dos redutores desses índices não serão ajustados em decorrência dessa conversão. Os valores da parcela em dinheiro (R\$5,12601160179) e do dividendo extraordinário declarado pela GNDI3 (R\$1,613026961) serão reinvestidos nas carteiras.

7.2. Na carteira do índice ICO2 (Índice Carbono Eficiente), as ações de GNDI3 serão excluídas após o encerramento da negociação do dia 11/02/2022 ao preço do último negócio realizado na B3. O redutor deste índice será recalculado normalmente.

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



016/2022-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.

Gilson Finkelsztain
Presidente

Mario Palhares
Vice-Presidente de Operações –
Negociação e CCP

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.

Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP

Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737

Anexo do Ofício Circular 016/2022-PRE**Procedimentos para Geração dos Negócios Oriundos do Exercício das Cestas de Ativos, Liquidação Financeira da Parcela Resgatável e Liquidação Financeira das Frações**

Na data de exercício das opções sobre a cesta de ativos HAPV99, os negócios oriundos do exercício serão cancelados no final do dia e substituídos por negócios nos componentes da cesta.

Independentemente da quantidade exercida, serão gerados negócios nos ativos subjacentes da cesta de ativos em quantidades múltiplas de 100 cestas, que é o lote-padrão de opção. Ou seja, para cada 100 cestas exercidas, serão gerados negócios no total de 524 ações HAPV3 e a liquidação financeira do valor referente ao resgate da ação preferencial de HapvidaCo.

Por exemplo, no caso de exercício de 1.000 cestas, serão gerados negócios com 5240 HAPV3, ou seja, 10 vezes a quantidade que seria gerada considerando-se o lote-padrão de 100.

A soma do volume financeiro dos negócios gerados em HAPV3 deverá ser igual ao volume financeiro do exercício original.

Volume financeiro do exercício:

$$V_{fe} = \text{Quantidade exercida} \times \text{Preço do exercício}$$

O valor financeiro referente ao resgate da ação preferencial de HapvidaCo componente da cesta será calculado para cada lote-padrão de 100 cestas através da fórmula abaixo:

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.
Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP
Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737

016/2022-PRE

$$VF = \frac{Q}{100} \times VPD$$

Onde:

VF = valor financeiro referente ao resgate da ação preferencial de HapvidaCo, calculado individualmente para cada negócio de exercício;

Q = quantidade do negócio de exercício da cesta de ativos;

VPD = valor da parcela em dinheiro calculado para o lote-padrão da cesta. Cálculo efetuado através da multiplicação do valor da parcela em dinheiro por ação resgatável, definido pelas Companhias na data de fechamento da operação, pelo lote-padrão da cesta, truncado em duas casas decimais.

O valor resultante da liquidação financeira da parcela em dinheiro será debitado do vendedor da opção e creditado ao comprador, no caso de opção de compra, e debitado do comprador da opção e creditado ao vendedor, no caso de opção de venda.

O valor financeiro referente a fração de HAPV3 existente em cada lote-padrão da cesta será calculado de acordo com a fórmula abaixo:

$$VFr = \frac{Q}{100} \times 0,36 \times P_{HAPV3}$$

Onde:

VFr = valor financeiro da fração de HAPV3 calculado individualmente para cada negócio de exercício, truncado em duas casas decimais;

Q = quantidade do negócio de exercício da cesta de ativos;

P_{HAPV3} = último preço de HAPV3 verificado no momento imediatamente anterior ao exercício, no caso de exercício antecipado, ou o preço de fechamento de HAPV3 na data de exercício, no caso de exercício automático.



016/2022-PRE

O valor resultante da liquidação financeira da fração será debitado do vendedor da opção e creditado ao comprador, no caso de opção de compra, e debitado do comprador da opção e creditado ao vendedor, no caso de opção de venda.

Este Ofício Circular produz efeitos a partir da data de sua publicação, respeitados os prazos específicos de vigência, se houver.

O teor deste documento confere com o original assinado, disponível na B3.

Praça Antonio Prado, 48 – 01010-901 – São Paulo, SP

Tel.: (11) 2565-4000 – Fax: (11) 2565-7737