

Novembro de 2020

METODOLOGIA DO ÍNDICE INDXX GLOBAL CLOUD COMPUTING

CONTENTS

1. ÍNDICE INDXX GLOBAL CLOUD COMPUTING	2
1.1 DESCRIÇÃO DO ÍNDICE	2
1.2 CRIAÇÃO DA LISTA MESTRE	2
1.2.1 Universo Inicial	2
1.2.2 Free Float	2
1.2.3 Preço Máximo	3
1.2.4 Tipo de Título	3
1.2.5 Classes de Ações	3
1.3 PROCESSO DE SELEÇÃO DE TÍTULOS	3
1.4 COMPOSIÇÃO FINAL	4
1.5 PONDERAÇÃO	4
1.6 REGRAS TAMPÃO	5
1.6.1 Capitalização de Mercado	5
1.6.2 Liquidez	5
1.6.3 Receita	5
1.7 REGRAS DE RECONSTITUIÇÃO E REEQUILÍBRIO	5
1.8 AÇÕES CORPORATIVAS	5
2 APÊNDICE	6
2.1 MUDANÇAS DE METODOLOGIA	6
3. ISENÇÃO DE RESPONSABILIDADE	7

1. ÍNDICE INDXX GLOBAL CLOUD COMPUTING

1.1 DESCRIÇÃO DO ÍNDICE

O Índice Indxx Global Cloud Computing acompanha o desempenho das empresas atuantes no Setor de Computação em Nuvem. O Setor de Computação em Nuvem atua na prestação de serviços de computação - servidores, armazenamento, bancos de dados, redes, software, análises e diversos outros serviços através da Internet, identificada como "A Nuvem".

O índice tem uma data base de 8 de novembro de 2013 com um valor inicial de 1.000.

O índice estará disponível na seguinte versão:

- Retorno Total (Código Bloomberg: ICOUT)
- Preço de Retorno (Código Bloomberg: ICOUP)
- Retorno Líquido Total (Código Bloomberg: ICOU)

1.2 CRIAÇÃO DA LISTA MESTRE

1.2.1 Universo Inicial

Para ser elegível para inclusão no Universo Inicial, os títulos devem ter:

- Listagem primária em Mercados Desenvolvidos ou Emergentes, excluindo a Índia. Mercados Desenvolvidos e Emergentes são definidos pela Indxx no seu documento "Country Classification and Investability Requirements".
- Capitalização de mercado total mínima de 200 milhões de dólares.
- Um faturamento médio diário de 6 meses superior ou igual a 2 milhões de dólares.
 - No caso de uma IPO significativa, o título deve ter um faturamento médio diário superior ou igual a \$2 milhões desde a data de lançamento do IPO.
- Negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis nos últimos 6 meses.
 - Caso um título não tenha um histórico comercial de 6 meses (somente IPOs), para ser considerado para inclusão, no caso de IPOs Significativas, esta deve ter sido listada pelo menos 10 dias civis antes da "Data de Seleção", e no caso de outras IPOs, 3 meses civis antes do "Dia de Seleção".
 - Além disso, a não ser que o título seja uma IPO Significativa, este deve ter sido negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis durante os 3 meses anteriores ao 'Dia de Seleção' (este requisito não se aplica às IPOs Significativas).
 - Uma IPO é considerada uma "IPO Significativa" se sua capitalização de mercado total da empresa inteira for superior à capitalização de mercado total da empresa inteira de pelo menos 50% dos constituintes do índice em curso a partir do 'Dia de Seleção de Reconstituição' anterior.

1.2.2 Free Float

Todos os títulos devem atender a um dos seguintes critérios:

1. Ter um free float mínimo equivalente a 10% das ações em circulação (ou)
2. Ter um free float mínimo de capitalização de mercado de \$1 bilhão.

1.2.3 Preço Máximo

A negociação de títulos ao preço de US\$ 10.000 ou superior não é elegível para inclusão no índice. Esta regra não é aplicável para os constituintes existentes. Os constituintes existentes devem permanecer no universo inicial, independentemente do preço de suas ações.

1.2.4 Tipo de Título

Os seguintes Tipos de Títulos são elegíveis para inclusão:

- Ações Ordinárias
- ADR
- GDR

1.2.5 Classes de Ações

Se existirem várias Classes de Ações para uma empresa, a seguinte ordem de preferência é seguida:

- A classe/listagem de ações existente na carteira é mantida se satisfizer todos os critérios de elegibilidade do índice.
- A classe/listagem de ações mais líquida é considerada para inclusão na carteira.

1.3 PROCESSO DE SELEÇÃO DE TÍTULOS

Com base em extensa pesquisa, a Indxx definiu a Computação em Nuvem como sendo composta pelos seguintes subsetores:

Software como Serviço (SaaS)	Empresas atuantes no licenciamento e entrega de software pela internet por assinatura, às vezes chamada de "software sob demanda".
Plataforma como Serviço (PaaS)	Empresas atuantes no fornecimento de uma plataforma para a criação de aplicações de software que são entregues através da Internet.
Infra-estrutura como Serviço (IaaS)	Empresas atuantes no fornecimento de recursos informáticos virtuais através da Internet. Os serviços incluem recursos compartilhados como armazenamento compartilhado, servidores compartilhados, pool de armazenamento, etc..
REITs de Data Center	Empresas atuantes na propriedade e gerenciamento de instalações usadas para clientes para armazenar dados com segurança, oferecendo uma gama de produtos e serviços para ajudar a manter servidores e dados seguros, incluindo fornecimento de fontes de alimentação ininterrupta, resfriadores a ar e segurança física.
Infra-estrutura de Computação de Borda e em Nuvem/ Componentes de Computação em Nuvem	Empresas atuantes na fabricação ou distribuição de componentes de hardware como chips que são incorporados em servidores, computadores e roteadores de rede especializados, etc., utilizados em atividades de computação em nuvem e computação de borda.

Estes subsetores são compostos por empresas das seguintes setores FactSet:

TV a Cabo/Satélite	Pacotes de Software
Comunicações Informatizadas	Trusts de Investimentos Imobiliários
Periféricos de Informática	Produtos Recreativos
Hardware de Informática	Equipamentos de Telecomunicações
Serviços de Informática	Serviços de processamento de dados
Comércio Eletrônico	Telecomunicações de Ponta
Software/Serviços de Internet	Semicondutores

Os setores e sub-temas identificados nesta abordagem baseada em pesquisa estão sujeitos a mudança na reconstituição semestral de maio.

Para se qualificar para inclusão no índice, uma empresa deve:

- Obter 50% ou mais da sua receitas dos subsetores listados acima ("Empresas de computação em nuvem");
- Ou
- Obter US\$ 500 milhões ou mais do fornecimento de infra-estrutura de nuvem pública ("Empresas de Nuvem Pública"). As Empresas de Nuvem Pública são aquelas que se concentram exclusivamente no fornecimento de infra-estrutura de nuvem pública em vez de plataformas que proporcionam acesso aos serviços de nuvem pública de terceiros.

1.4 COMPOSIÇÃO FINAL

Da Lista de Seleção:

- As 30 maiores Empresas de Computação em Nuvem são classificadas por porcentagem de receita atribuída à computação em nuvem, sujeito às seguintes considerações:
 - Um máximo de cinco REITs de Data Center podem ser incluídos no índice final.
 - Se duas ou mais empresas tiverem o mesmo percentual de receita, então a empresa com maior faturamento médio diário em 6 meses será considerada elegível para inclusão no índice.
- Além disso, as 10 maiores Empresas da Nuvem Pública por receita atribuída à infra-estrutura de Nuvem Pública são incluídas no índice. Se houver menos de 10 Empresas de Nuvem Pública elegíveis, todas as Empresas de Nuvem Pública elegíveis serão incluídas no índice.

1.5 PONDERAÇÃO

As Empresas de Computação em Nuvem contidas no índice são ponderadas da seguinte forma:

- Os constituintes são ponderados com base em sua capitalização de mercado bolsista.
- O peso agregado de REITs de Data Center é limitado a 10%.
- Um único limite do título de 4,00% e um único piso do título de 0,3% é aplicado.

As Empresas de Nuvem Pública no índice são ponderadas da seguinte forma:

- Os constituintes são ponderados com base em sua capitalização de mercado bolsista.
- O peso agregado das Empresas de Nuvem Pública é limitado a 10%.
- Um único limite do título de 2% e um único piso do título de 0,3% é aplicado.

1.6 REGRAS TAMPÃO

As Regras Tampão são empregadas para reduzir a rotatividade da Carteira. Aplicam-se as seguintes Regras Tampão:

1.6.1 Capitalização de Mercado

Um constituinte continuará a ser incluído no índice se sua Capitalização de Mercado for superior ou igual a 80% do limite de capitalização de mercado previamente definido. Por exemplo, se um membro do índice existente se qualificar em todos os outros critérios de seleção, mas não se qualificar no critério de capitalização de mercado até o limite de 20%, então será mantido na nova lista de membros do índice.

1.6.2 Liquidez

Um constituinte continuará a ser incluído no índice se seu Volume de Negociação Diária Média de 6 meses for superior ou igual a 70% do limite de Liquidez previamente definido. Por exemplo, se um membro do índice existente se qualificar em todos os outros critérios de seleção, mas não se qualificar nos critérios de liquidez até o limite de 30%, então será mantido na nova lista de membros do índice.

1.6.3 Receita

- Uma Empresa de Computação em Nuvem elegível que não seja atualmente constituinte do índice só será incluída no mesmo se ocupar o 10º lugar ou melhor em termos de receita derivada dos subsetores listados acima. Neste caso, o componente de índice atual que ocupa o último lugar no ranking de receita, derivado dos subsetores, é removido.
- Um constituinte de índice atual que seja uma Empresa de Computação em Nuvem será removido do índice se ocupar o 40º lugar ou inferior em termos de receita derivada dos subsetores listados acima. Neste caso, o não-constituinte mais alto na classificação por receita será adicionado ao índice.

1.7 REGRAS DE RECONSTITUIÇÃO E REEQUILÍBRIO

- O índice segue um cronograma semestral de reconstituição e reequilíbrio. A nova carteira torna-se efetiva no encerramento dos negócios na segunda sexta-feira de maio e novembro de cada ano. Este dia é chamado "Dia Efetivo".
- O processo de seleção e criação da carteira de títulos começa no encerramento da sexta-feira mais próxima, caindo pelo menos um mês antes do dia efetivo, chamado de 'Dia de Seleção'. A lista de seleção é criada com base nos dados a partir do Dia de Seleção.
- Os pesos são calculados no fechamento do sétimo dia de negociação anterior (seis dias de negociação anteriores) ao Dia Efetivo. As ações do índice são congeladas usando pesos a partir deste dia.

1.8 AÇÕES CORPORATIVAS

O guia de ações corporativas se encontra na seção Anúncios do nosso site, em 'Index Documents'..

2 APÊNDICE

2.1 MUDANÇAS DE METODOLOGIA

As Mudanças de Metodologia desde novembro de 2020 são as seguintes:

Seção	Valor Anterior	Novo valor	Data efetiva (fechamento)
1.2.1	<ul style="list-style-type: none"> Faturamento médio diário de 6 meses igual ou superior a \$2 milhões. 	<ul style="list-style-type: none"> Faturamento médio diário de 6 meses igual ou superior a \$2 milhões. <ul style="list-style-type: none"> No caso de uma IPO significativa, um título deve ter um faturamento médio diário superior ou igual a US\$ 2 milhões desde a data de lançamento da IPO 	30 de nov 2020
	<ul style="list-style-type: none"> Negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis nos últimos 6 meses. <ul style="list-style-type: none"> Caso um título não tenha um histórico de negociação de 6 meses (somente IPOs), tal título deve ter começado a ser negociado pelo menos 3 meses antes do início do Processo de Reconstituição/Reequilíbrio e deve ter sido negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis durante os últimos 3 meses. 	<ul style="list-style-type: none"> Negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis nos últimos 6 meses. <ul style="list-style-type: none"> Caso um título não tenha um histórico de negociação de 6 meses (apenas IPOs), para ser considerado para inclusão, no caso de IPOs significativas, a IPO deve ter sido listada pelo menos 10 dias civis antes da "Data de Seleção", e no caso de outras IPOs, 3 meses civis antes do "Dia de Seleção". Além disso, a não ser que o título seja uma IPO Significativa, este deve ter sido negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis durante os 3 meses anteriores ao "Dia de Seleção" (este requisito não se aplicará a IPOs Significativas). Uma IPO é considerada uma "IPO significativa" se a capitalização de mercado total da empresa for superior à Capitalização de Mercado total da empresa em pelo menos 50% dos constituintes do índice em andamento a partir do "Dia de Seleção de Reconstituição" anterior. 	

3. ISENÇÃO DE RESPONSABILIDADE

Este documento metodológico e todas as informações aqui contidas incluindo, sem limitação, todo o texto, dados, gráficos, tabelas, ilustrações e teoria (coletivamente, "informações"), foram criados por e são propriedade exclusiva da Indxx, LLC. A redistribuição, reprodução e/ou fotocópia total ou parcial deste documento é proibida sem a permissão por escrito da Indxx. Todas as informações contidas neste documento fornecidas pela Indxx são impessoais e não são adaptadas às necessidades específicas de qualquer pessoa, entidade ou grupo. Nenhuma das informações constitui uma tentativa de oferta de venda (ou uma tentativa de oferta de compra), ou promoção ou recomendação de qualquer título, produto, veículo de investimento ou qualquer estratégia negocial, e a Indxx não endossa, aprova ou de outra forma expressa qualquer opinião sobre qualquer emissor, título, produto financeiro, instrumento ou estratégia negocial. Nenhuma das informações, índices, modelos, outros produtos ou serviços contidos em Indxx serve de aconselhamento de investimento ou recomendação para tomar (ou deixar de tomar) qualquer tipo de decisão de investimento, não devendo o leitor confiar nas mesmas para tomar tais decisões.. A decisão de investir em qualquer fundo de investimento ou outro veículo não deve ser tomada com base apenas em informações ou declarações contidas neste documento. Os potenciais investidores são aconselhados a fazer um investimento em determinado fundo ou outro veículo somente depois de considerar cuidadosamente os riscos, taxas e despesas associadas ao investimento, segundo detalhado em um memorando de oferta ou documento similar preparado pelo emissor do fundo de investimento ou outro veículo. Os dados históricos, análise e desempenho dos índices Indxx não devem ser tomados como indicação ou garantia de qualquer desempenho futuro. A Indxx não garante a exatidão e/ou integridade de qualquer índice Indxx, quaisquer dados incluídos aqui, ou quaisquer dados nos quais se baseiam, e a Indxx não terá qualquer responsabilidade por quaisquer erros, omissões ou interrupções do mesmo. Todas as informações contidas nestes materiais são fornecidas na base "como estão" e o conteúdo pode ser mudado sem aviso prévio.

Para obter mais informações sobre o índice, envie um email para info@indxx.com.
Obtenha mais informações em www.indxx.com.