

Novembro de 2020

METODOLOGIA DO ÍNDICE TEMÁTICO INDXX GLOBAL ROBOTICS & ARTIFICIAL INTELLIGENCE

CONTEÚDO

1. ÍNDICE TEMÁTICO INDXX GLOBAL ROBOTICS & ARTIFICIAL INTELLIGENCE	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.....	4
1.6.1 Capitalização de Mercado	4
1.6.2 Liquidez	4
1.6.3 Representação Continuada na Carteira.....	5
1.7 REGRAS DE RECONSTITUIÇÃO E REEQUILÍBRIO.....	5
1.8 REVISÃO SEMESTRAL	5
1.9 AÇÕES CORPORATIVOS.....	6
2. APÊNDICE	7
2.1 MUDANÇAS DE METODOLOGIA	7
3. ISENÇÃO DE RESPONSABILIDADE	9

1.1 DESCRIÇÃO DO ÍNDICE

O Índice Temático Indxx Global Robotics & Artificial Intelligence foi projetado para rastrear o desempenho de empresas listadas em mercados desenvolvidos que devem se beneficiar da maior adoção e utilização de robótica e inteligência artificial ("IA"), incluindo empresas atuantes em Robótica Industrial e Automação, Robôs Não Industriais, Inteligência Artificial e Veículos Autônomos.

O índice tem uma data base de 30 de junho de 2010 com um valor inicial de 1.000.

O índice está atualmente disponível nas seguintes versões:

- Retorno Líquido Total (Código Bloomberg: IBOTZNT)
- Retorno Total (Código Bloomberg: IBOTZ)

1.2 CRIAÇÃO DA LISTA MESTRE

1.2.1 Universo Inicial

Para ser elegível para inclusão no Universo Inicial, os títulos devem atender as seguintes exigências:

- Seu país de listagem deve ser um Mercado Desenvolvido. Mercados Desenvolvidos são definidos pela Indxx no seu documento 'Country Classification and Investability Requirements'.
- Ter uma capitalização de mercado total mínima de \$300 milhões.
- Ter um faturamento médio diário de 6 meses maior ou igual a US\$ 2 milhões.
 - 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 da IPO.
- Ser negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis nos últimos 6 meses.
 - Caso um título não tenha um histórico de negociação 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 andamento a partir do 'Dia de Seleção de Reconstituição' anterior.

1.2.2 Free Float

Todos os títulos devem ter um free float mínimo equivalente a 10% das ações em circulação.

1.2.3 Preço máximo

Títulos negociados ao preço de US\$ 10.000 ou superior não são elegíveis 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

- A classe/listagem de ações existente na carteira é mantida se satisfizer todos os critérios de elegibilidade do índice
- Se existir uma ADR da companhia, esta terá preferência sobre as outras classes de ações
- A classe/listagem de ações mais líquida é considerada para inclusão na carteira.

1.3 PROCESSO DE SELEÇÃO DE TÍTULOS

Uma pesquisa profunda foi realizada para identificar os setores e segmentos que seriam positivamente impactados pela robótica e IA. Os setores identificados por esta abordagem baseada em pesquisa estão sujeitos a mudança em todas as reconstituições anuais.

A Indxx definiu Robótica e Inteligência Artificial como sendo composta pelos seguintes subsetores:

Subsetores	Descrição
Robótica e Automação Industrial	Estas são empresas que fornecem robôs e produtos e serviços de automação robótica com foco em aplicações industriais.
Veículos Autônomos e Drones	São empresas atuantes no desenvolvimento e produção de veículos não tripulados (incluindo hardware e software para carros autônomos), drones e robôs para ambos mercados militar e de consumo.
Robótica Não-industrial	Estas são empresas atuantes no desenvolvimento de robôs e IA que são utilizados para aplicações não industriais, incluindo, mas não limitado à agricultura, saúde, aplicações ao consumidor e entretenimento.
Inteligência Artificial	São empresas que desenvolvem ou proporcionam diretamente Inteligência Artificial na forma de produtos, software ou sistemas. Estas empresas devem vender Inteligência Artificial e não utilizar/alavancar para melhorar seus produtos.

Somente aquelas empresas que derivam uma parcela significativa (maior que 50%) de suas receitas das indústrias/segmentos acima ou declararam que seu negócio principal é produtos e serviços focados nas indústrias/segmentos acima são consideradas como empresas de robótica "pura" e de IA e são elegíveis para inclusão no índice. As empresas que demonstraram estas indústrias/segmentos como áreas de foco de crescimento através de investimentos internos em P&D, joint ventures,

parcerias e/ou aquisições são elegíveis para inclusão na Lista de Seleção final.

1.4 COMPOSIÇÃO FINAL

Da Lista de Seleção:

- As principais empresas de robótica pura e IA por Capitalização de Mercado formarão a carteira final. O índice está limitado a 100 empresas. Se menos de 100 empresas se qualificarem para inclusão, todas essas empresas farão parte da carteira final.
- Se menos de 30 empresas se qualificarem para inclusão, o comitê de índice consideraria uma lista secundária de empresas com fluxos de receita diversificados que (1) possuem uma unidade de negócios distinta focada em robótica ou Inteligência Artificial, e (2) possuem uma competência essencial que se espera aumentar a adoção da robótica ou Inteligência Artificial para inclusão até que a contagem atinja 30.

1.5 PONDERAÇÃO

O índice é ponderado na seguinte maneira:

- Os componentes são ponderados com base na sua Capitalização de Mercado em nível de títulos.
- O índice é modificado, ponderado pelo limite de mercado no momento da reconstituição. É aplicado um limite de peso de 8% para um único título e um piso de 0,3% para um único título.
- O peso agregado de todos os componentes com um peso superior a 5% é limitado a 40%. Todos os títulos restantes estão limitados a 4,5%.

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 Universo Inicial 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 no universo investível.

1.6.2 Liquidez

Um constituinte continuará a ser incluído no Universo Inicial 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 Representação Continuada na Carteira

Além disso, um constituinte de índice existente deve continuar no índice se fizer parte das 120 maiores empresas por limite de mercado, mesmo que não faça parte dos 100 maiores constituintes.

1.7 REGRAS DE RECONSTITUIÇÃO E REEQUILÍBRIO

- O índice segue um cronograma anual de reconstituição e reequilíbrio. A nova carteira torna-se efetiva no encerramento do último dia de negociação em junho 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 REVISÃO SEMESTRAL

Para capturar efetivamente IPOs e mudanças na estrutura dos negócios de uma empresa devido a ações corporativas, a composição do índice será revisada semestralmente.

- Qualquer novo acréscimo ou exclusão do índice torna-se efetivo no encerramento do último dia de negociação de dezembro. Este dia é chamado de "Dia Efetivo da Revisão".
- A data de seleção será a sexta-feira mais próxima caindo pelo menos um mês antes do Dia Efetivo da Revisão. Este dia é chamado de 'Dia de Seleção da Revisão'.
- O cálculo dos pesos ocorrerá no encerramento do sétimo dia de negociação antes do Dia Efetivo da Revisão. Este dia é chamado de 'Dia de Congelamento do Peso da Revisão'.

No 'Dia de Seleção da Revisão', as seguintes avaliações serão realizadas:

- Revisão de IPO -
 - Para que as IPOs com menos de 6 meses civis de histórico de negociação a partir da 'Data de Seleção da Revisão' sejam consideradas para inclusão, a IPO deve ter sido listada pelo menos 10 dias civis antes da 'Data de Seleção da Revisão', no caso de IPOs significativas; e 3 meses civis antes do 'Dia de Seleção da Revisão', no caso de outras IPOs.
 - Além disso, a não ser que o título seja uma IPO Significativa, deve ter sido negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis nos 3 meses anteriores ao 'Dia de Seleção da Revisão' (este requisito não se aplica às IPOs Significativas).
 - Finalmente, o título deve ter um faturamento médio diário superior ou igual a 2 milhões de dólares.
 - Se uma IPO atender aos critérios acima e a todos os outros critérios padrão descritos na seção 1.2, então será elegível para inclusão no índice.
 - Uma IPO é considerada uma "IPO significativa" se a Capitalização de Mercado total da empresa for superior à Capitalização de Mercado total da empresa de pelo menos

50% dos constituintes do índice em andamento, no "Dia de Seleção da Reconstituição" anterior.

- Para se qualificar para inclusão, todas as IPOs devem ser de robótica pura e IA que atendam as condições acima.
- Revisão de Ações Corporativas – No momento da revisão, verificam-se as ações corporativas que se tornaram efetivas nos últimos 6 meses civis e que alteraram significativamente as operações comerciais da empresa de todos os componentes do índice existentes. Essas ações corporativas incluem Cisões, Fusões ou Aquisições, alienações, etc., que podem alterar significativamente os fundamentos das operações comerciais de uma empresa. Somente as empresas que ainda cumprirem os objetivos do índice serão mantidas no índice

Qualquer mudança (acréscimo/eliminação) na composição do índice devido à revisão da IPO e/ou Revisão da Ação Corporativa será determinada a partir do "Dia de Seleção da Revisão", onde novas ponderações serão calculadas na seguinte forma.

- Acréscimo/eliminação – Os acréscimos/eliminações devem ser ponderados de acordo com a metodologia descrita na seção 1.5. A diferença nos pesos (dos acréscimos/eliminações) deverá ser proporcionalmente ajustada (adicionada/removida) entre os demais constituintes com base na Capitalização de Mercado em nível de títulos.

1.9 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. 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. 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. 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. 	

Seção	Valor Anterior	Novo valor	Data efetiva (fechamento)
1.8	<p>Revisão de IPO – Para ser considerada para inclusão, a IPO deve ter sido listada pelo menos 3 meses civis antes do "Dia de Seleção da Revisão". Além disso, o título deve ter sido negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis durante os 3 meses anteriores ao 'Dia de Seleção de Revisão'. Se uma IPO atender aos critérios acima e a todos os outros critérios padrão descritos na seção 1.2, então será elegível para inclusão no índice.</p>	<p>Revisão de IPO -</p> <ul style="list-style-type: none"> • Para que as IPOs com menos de 6 meses civis de histórico de negociação a partir da 'Data de Seleção da Revisão' sejam consideradas para inclusão, a IPO deve ter sido listada pelo menos 10 dias civis antes da 'Data de Seleção da Revisão', no caso de IPOs significativas; e 3 meses civis antes do 'Dia de Seleção da Revisão', no caso de outras IPOs. • Além disso, a não ser que o título seja uma IPO Significativa, deve ter sido negociado em 90% dos dias de negociação elegíveis nos 3 meses anteriores ao 'Dia de Seleção da Revisão' (este requisito não se aplica às IPOs Significativas). • Finalmente, o título deve ter um faturamento médio diário superior ou igual a 2 milhões de dólares. • Se uma IPO atender aos critérios acima e a todos os outros critérios padrão descritos na seção 1.2, então será elegível para inclusão no índice. • Uma IPO é considerada uma "IPO significativa" se a Capitalização de Mercado total da empresa for superior à Capitalização de Mercado total da empresa de pelo menos 50% dos constituintes do índice em andamento, no "Dia de Seleção da Reconstituição" anterior. • Para se qualificar para inclusão, todas as IPOs devem ser de robótica pura e IA que atendam as condições acima. 	30 de nov de 2020

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.