

METODOLOGIA DO ÍNDICE DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS DE ALTA LIQUIDEZ (IFIX L B3)

METODOLOGIA DO ÍNDICE DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS DE ALTA LIQUIDEZ (IFIX L B3)



SUMÁRIO

1	OBJETIVO.....	3
2	TIPO DE ÍNDICE	3
3	ATIVOS ELEGÍVEIS.....	3
4	CRITÉRIOS DE INCLUSÃO	3
5	CRITÉRIOS DE EXCLUSÃO.....	4
6	CRITÉRIO DE PONDERAÇÃO	4

METODOLOGIA DO ÍNDICE DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS DE ALTA LIQUIDEZ (IFIX L B3)

O IFIX L é o resultado de uma carteira teórica de ativos, elaborada de acordo com os critérios estabelecidos nesta metodologia.

Os índices da B3 utilizam procedimentos e regras constantes do Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3 (Conceitos e Procedimentos), disponível em www.b3.com.br, Market Data e Índices, Índices de Segmentos e Setoriais, Índice de Fundos de Investimentos Imobiliários de Alta Liquidez (IFIX L).

1 OBJETIVO

O objetivo do IFIX L é ser o indicador do desempenho médio das cotações dos fundos imobiliários mais líquidos negociados nos mercados de bolsa e de balcão organizado da B3.

2 TIPO DE ÍNDICE

O IFIX L é um índice de retorno total (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3).

3 ATIVOS ELEGÍVEIS

O IFIX L é composto das cotas de Fundos de Investimentos Imobiliários listados nos mercados de bolsa e de balcão organizado da B3.

4 CRITÉRIOS DE INCLUSÃO

Serão selecionadas para compor o IFIX L as cotas dos fundos imobiliários que atendam cumulativamente aos critérios abaixo:

4.1 Pertencer ao Índice de Fundos de Investimentos Imobiliários (IFIX).

4.2 Estar classificadas entre os ativos elegíveis que, no período de vigência das 3 (três) carteiras anteriores, em ordem decrescente de Índice de Negociabilidade (IN), representem em conjunto 85% (oitenta e cinco por cento) do somatório total desses indicadores (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3).

METODOLOGIA DO ÍNDICE DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS DE ALTA LIQUIDEZ (IFIX L B3)

4.3 não ser classificadas como “Penny Stock” (ver Manual de Definições e Procedimentos dos Índices da B3).

4.4 Um ativo que seja objeto de Oferta Pública realizada durante o período de vigência das 3 (três) carteiras anteriores ao rebalanceamento será elegível, mesmo sem estar listado todo o período, desde que:

- a) a Oferta Pública de distribuição de cotas tenha sido realizada antes do rebalanceamento anterior;
- b) possua 95% (noventa e cinco por cento) de presença desde seu início de negociação;
- c) atenda cumulativamente aos critérios 4.1, 4.2 e 4.3.

5 CRITÉRIOS DE EXCLUSÃO

Serão excluídas da carteira as cotas dos fundos imobiliários que:

5.1 deixarem de atender a qualquer um dos critérios de inclusão acima indicados;

5.2 durante a vigência da carteira forem objeto de resgate total pelo fundo emissor.

6 CRITÉRIO DE PONDERAÇÃO

No IFIX L, os ativos são ponderados pelo valor de mercado da totalidade das cotas emitidas pelo Fundo Imobiliário.

Ressalta-se que a participação de um fundo no índice não poderá ser superior a 20% (vinte por cento), quando de sua inclusão ou nas reavaliações periódicas.

Caso isso ocorra, serão efetuados ajustes para adequar o peso do fundo a esse limite, redistribuindo-se o excedente proporcionalmente aos demais ativos da carteira.