

## **O ÍNDICE**

### **I) CARACTERÍSTICAS GERAIS**

O índice S&P/BM&F ÍNDICE DE FUTUROS DE TAXA DE JUROS - DI 3 ANOS ER, registrado sob o código Ticker SPBDI1FP, é um índice de mercado que mede o retorno de um investimento em uma carteira teórica calculada pela S&P Dow Jones Índices (“S&PDJI”), composta por (i) Contrato Futuro de Taxa Média de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia (“DI1”) com vencimento no 36<sup>o</sup> (trigésimo sexto) mês nos meses de junho e dezembro compreendendo um período de 3 (três) anos a 2 (dois) anos e 6 (seis) meses, e (ii) corrigidos diariamente pela Taxa DI-Cetip (“CDI”), observado o disposto nesta Seção “O Índice”.

## II) METODOLOGIA

O índice é construído com base no contrato futuro de DI de 1 (um) Dia com vencimento no 36º (trigésimo) mês e substituídos periodicamente, que é também chamado de Data de Rebalanceamento/Rolagem. Esta substituição ocorre de forma semestral durante um período de rolagem de um dia, no penúltimo dia de negociação do mês em junho e dezembro.

A cada 6 (seis) meses, no fim dos semestres encerrados em junho e dezembro, ou em qualquer outra periodicidade que a S&PDJI venha a determinar, a S&PDJI deverá efetuar uma reavaliação da composição do Índice. Na Data de Rebalanceamento/Rolagem, o Índice será recalculado com base nas condições dispostas acima.

Nem o Fundo, nem a Gestora, nem o Administrador são responsáveis pela gestão, cálculo, divulgação e manutenção do Índice.

Caso a S&PDJI deixe de gerir, calcular, divulgar ou manter o Índice, o Administrador deverá imediatamente divulgar tal fato, na forma da regulamentação aplicável, e necessariamente convocar uma assembleia geral de Cotistas na qual os Cotistas deverão deliberar acerca de eventual mudança no objetivo de investimento do Fundo ou, caso contrário, pela liquidação e encerramento do Fundo.

Caso os Cotistas não aprovem, em uma assembleia geral de Cotistas devidamente convocada ou em qualquer futura convocação de tal assembleia, uma mudança no objetivo de investimento do Fundo, o Administrador deverá dar início aos procedimentos de liquidação do Fundo.

Todas as informações sobre o Índice aqui dispostas foram obtidas junto à S&PDJI e podem ser encontradas na página do Fundo na rede mundial de computadores e nos materiais de divulgação do Fundo. Nem o Fundo, o Administrador, a Gestora, ou qualquer outro prestador de serviço que preste serviços ao Fundo ou em benefício do Fundo tampouco quaisquer de suas Coligadas será responsável por qualquer incorreção de tais informações sobre o Índice ou, ainda, por incorreções no cálculo do Índice.

### III) A S&P DOW JONES INDICES<sup>1</sup>

Em julho de 2012, a S&P Índices e a Dow Jones Indexes se uniram para criar o maior fornecedor de índices do mercado financeiro no mundo. Em conjunto, a S&P Dow Jones Índices LLC possui mais de 120 anos de experiência no desenvolvimento de soluções inovadoras e transparentes que ajudam os investidores a alcançar seus objetivos financeiros. Desde o lançamento do emblemático Dow Jones Industrial Average® em 1896 e do S&P 500® em 1957, temos impulsionado algumas das inovações financeiras mais importantes do século passado. Hoje, mais recursos são investidos em produtos baseados em nossos índices do que nos de qualquer outro provedor no mundo. Com mais de 1 milhão de índices que abrangem uma ampla gama de classes de ativos em todo o mundo, continuamos definindo a forma como os investidores medem os mercados e negociam neles.

A S&P Dow Jones Indices LLC é uma empresa conjunta de McGraw Hill Financial (controladora) e o CME Group Inc. A S&P Global (SPGI na Bolsa de Nova Iorque) fornece informações fundamentais a investidores, companhias e governos para que eles possam tomar suas decisões com confiança. O CME (CME no NASDAQ), acionista minoritário da empresa, possui licença dos índices da S&P DJI e é um fornecedor de dados. Como licenciado, o CME e empresas afiliadas podem emitir, transacionar e/ou patrocinar produtos vinculados ao desempenho de índices da S&P DJI que podem ser similares e competitivos em comparação com produtos emitidos ou patrocinados por outros licenciados da S&P DJI. As atividades de negociação do CME podem afetar os valores dos índices e quaisquer outros produtos vinculados a eles. Mais informações sobre a S&P DJI estão disponíveis por meio do código CIK# 0000064040 no sistema EDGAR (SEC).

Como maior provedor do mundo de recursos, dados e pesquisas para a criação de índices inovadores, a nossa missão é fornecer soluções independentes, transparentes e com baixo custo para a comunidade financeira global. S&P Dow Jones Indices está na vanguarda da inovação e tendências no segmento de índices. Nosso objetivo é continuar a antecipar e responder a forma como nossos clientes enxergam as oportunidades de investimentos globais.

---

<sup>1</sup> Fonte: Perfil e Histórico (<https://www.portugues.spindices.com/our-company/>).

#### **IV) SUBLICENCIAMENTO**

O Índice, bem como as Marcas S&P Dow Jones Índices, foram sublicenciados pela S&P Dow Jones Indices à Gestora, mediante a celebração de um contrato de sublicenciamento.

Por meio do Contrato de Sublicenciamento, a Gestora sublicenciou ao Administrador, atuando em nome do Fundo, o uso do Índice e das Marcas S&P Dow Jones Índices, pelo prazo inicial de 5 anos e renováveis por 3 anos,. Nos termos do Contrato de Sublicenciamento, as taxas de licenciamento devidas à S&P Dow Jones Índices deverão ser arcadas pelo Fundo e ressarcidas ao Fundo por meio da dedução da referida taxa do valor a ser pago pelo Administrador diretamente à Gestora a título de Taxa de Gestão.