

INSTRUÇÃO 6-07

ADMINISTRAÇÃO DE EVENTOS
SOCIETÁRIOS E/OU DE VALORES
MOBILIÁRIOS, OUTRAS OBRIGAÇÕES
CONTÍNUAS E CONDIÇÕES DE EXCLUSÃO
DE ETCS, ETFS E ETNS ADMITIDOS À
NEGOCIAÇÃO NUM MERCADO EURONEXT



EURONEXT

INTRODUÇÃO

A presente Instrução (doravante designada por “Instrução”) complementa o Regulamento I Regras de Mercado Harmonizadas no que respeita às disposições relativas ao procedimento aplicável aos Emitentes de ETCs, ETFs e ETNs (doravante, conjuntamente, designados por “ETPs” de “Exchange Traded Products”) no que respeita a eventos societários e/ou de valores mobiliários, outras obrigações contínuas e condições de exclusão.

A presente Instrução pode ser alterada, periodicamente, mediante aviso prévio (por exemplo, através da colocação da versão alterada no website da Euronext).

ÂMBITO DA APLICAÇÃO

A Instrução aplica-se aos ETPs que são admitidos à negociação nos Mercados Regulamentados geridos pela respetiva Entidade Gestora de Mercados da Euronext Competente (doravante designadas por “REMU”): Borsa Italiana, Euronext Amsterdam, Euronext Brussels, Euronext Lisbon e Euronext Paris.

DEFINIÇÕES

Os termos iniciados em letra maiúscula, não definidos de outra forma no presente documento, terão o significado atribuído no Regulamento I Regras de Mercado Harmonizadas (conforme alterado).

Se adequado, o plural de um termo definido é, igualmente, considerado como um termo definido.

DEVERES

Os Emitentes de ETPs estão sujeitos aos requisitos estabelecidos na presente Instrução.

ADMINISTRAÇÃO DE EVENTOS SOCIETÁRIOS E/OU DE VALORES MOBILIÁRIOS

1. Disposições Gerais

Os Emitentes de ETPs devem notificar de imediato a REMU e, em qualquer caso, com uma antecedência mínima de dois (2) Dias de Negociação relativamente à ocorrência dos seguintes eventos:

- (i) qualquer alteração na informação contida na documentação apresentada com o pedido de admissão à negociação;
- (ii) a adoção de qualquer medida que suspenda temporariamente a subscrição ou o resgate das unidades de participação/ações ou instrumentos financeiros;
- (iii) qualquer evento extraordinário relacionado com o Emitente e qualquer proposta para modificar o modo de funcionamento dos seus instrumentos financeiros, incluindo (sem limitação) qualquer transformação, consolidação, reorganização, fusão, cisão, dissolução e liquidação, divisão ou reversão de divisão, ou a adoção de qualquer medida para gestão de crises.

2. Datas de pagamento de dividendos

Os Emitentes de ETPs devem notificar a REMU sobre a definição de datas de pagamento de dividendos (especificando a data *ex*, a *record date* e a data de pagamento) e o respetivo montante. A notificação deve ser efetuada de imediato e, em qualquer caso, com uma antecedência mínima dois (2) Dias de Negociação do primeiro dia de negociação ex-direitos.

3. Eventos que provocam alterações nas condições de preços

Os Emitentes de ETPs devem notificar a REMU da hora, minuto e segundo em que ocorre o evento que possa provocar uma alteração nas condições de preço em que o instrumento é negociado (por exemplo, eventos de *restrike/reset*) ou um evento subsequente que provoque a cessação do instrumento.

Esta notificação deve ser feita de imediato e, em qualquer caso, no máximo até 5 (cinco) minutos após a sua ocorrência (indicando pelo menos o código ISIN, a mnemónica, o ativo subjacente, o fator de *restrike/reset* e o preço de *reset*; este último, assim que esteja disponível), de acordo com o procedimento estabelecido no artigo 11.º da Instrução e remeter por correio eletrónico para:

- i. infofisd@euronext.com ; ms@euronext.com (para ETPs admitidos à negociação na Borsa Italiana – ETFPlus Market);
- ii. ETPEurope.listing@euronext.com ; cashmarkets@euronext.com (para ETPs admitidos à negociação noutro Mercado Regulamentado gerido pela REMU).

No caso do evento de *restrike/reset* prever uma cessação antecipada devido à colocação em zero do instrumento financeiro ou do índice subjacente, o Emitente deve notificar imediatamente a REMU.

4- Alteração das condições contratuais originais/ativos subjacentes:

- a) Quando um ETP preveja uma condição resolutiva e/ou uma alteração das condições contratuais originais ou a possibilidade do Emitente reembolsar antecipadamente o montante de capital, o Emitente deve notificar imediatamente a REMU e facultar as informações especificadas na alínea b), de acordo com o procedimento previsto no artigo 11.º e remeter por correio eletrónico para:
 - i. infofisd@euronext.com; ms@euronext.com (para ETPs admitidos à negociação na Borsa Italiana – ETFPlus Market);

- ii. ETPEurope.listing@euronext.com; cashmarkets@euronext.com (para ETPs admitidos à negociação noutro Mercado Regulamentado gerido pela REMU).
- b) Em caso de condição resolutiva do instrumento financeiro, após a receção da notificação do Emitente contendo a hora (hora, minuto e segundo) em que tal condição resolutiva se verificou, a REMU suspende a negociação dos instrumentos financeiros em causa e anula os contratos executados após a hora indicada na notificação, incluindo os executados no segundo em que se verificou a condição ou a alteração.
- c) Após a receção da notificação relativa ao cumprimento da condição resolutiva referida na alínea b), a REMU exclui os instrumentos financeiros em causa dos seus mercados.

4. Resgate antecipado

Os Emitentes de um ETP que prevejam a possibilidade de resgate antecipado devem notificar a REMU da data prevista, logo que esta seja conhecida e, em qualquer caso, com uma antecedência mínima de três Dias de Negociação relativamente a essa data.

5. Reembolso antecipado

Os Emitentes de ETPs devem notificar a REMU da decisão de reembolso antecipado em resultado da liquidação do instrumento. Esta notificação deve ser efectuada de imediato e, em qualquer caso, até ao terceiro Dia de Negociação anterior à data efetiva do reembolso.

CONDIÇÕES PARA A EXCLUSÃO

6. Exclusão a pedido do Emitente

Para efeitos de exclusão a pedido de um ETP, os Emitentes devem enviar à REMU um pedido escrito relatando os motivos relevantes para a exclusão, assinado pelo seu representante legal, elaborado de acordo com o modelo constante do Anexo 1 da Instrução e acompanhado da documentação especificada no mesmo modelo:

- a. Compromisso de compra direta ou indireta dos ETPs no Mercado Regulamentado relevante, a pedido dos detentores, pelo menos até à data da exclusão;
- b. Cópia da deliberação adoptada pelo órgão competente para solicitar a exclusão e/ou um comunicado de imprensa anunciando a exclusão;
- c. Lista e características dos ETPs para os quais se solicita a exclusão.

A REMU decide sobre a exclusão, especificando a data efetiva, no prazo de 5 dias úteis após a receção do pedido referido no número anterior acompanhado da documentação necessária. A decisão adoptada deve ser transmitida ao Emitente e anunciada de imediato ao público através de um aviso de mercado emitido pela REMU.

O período entre a publicação do aviso de mercado e a efetiva remoção é, no mínimo, um mês.

8 – Exclusão na data de vencimento

A REMU deverá excluir os ETPs no segundo dia anterior à data de maturidade dos ETPs, tendo em conta os dias de abertura do sistema de liquidação envolvido. Se esse dia não for um Dia de Negociação, o dia da exclusão será o primeiro Dia de Negociação seguinte.

OUTRAS OBRIGAÇÕES PERMANENTES

9- Informação no Website

Os Emitentes de ETPs devem informar a REMU do nome do prestador da informação ou do website (e alterações subsequentes que possam ocorrer), por meio das quais as seguintes informações são disponibilizadas ao público e atualizadas regularmente:

- valor do índice de referência do ETF estruturado ou do índice ou do subjacente do ETC/ETN;
- o documento de informação fundamental (DIF).

10- Notificação Annual

Os Emitentes de ETPs devem notificar anualmente a REMU, através do formulário eletrónico prescrito, com as seguintes informações relativas a 31 de dezembro de cada ano:

- a) O último valor da ação/unidade de participa (NAV) no caso de ETFs ou o último valor oficial no caso do ETC/ETN;
- b) o número de unidades de participação/ações ou instrumentos financeiros em circulação;
- c) o valor do índice de referência do ETF, se aplicável, ou o valor do subjacente, no caso de ETC/ETN.

Estas comunicações devem ser enviadas no prazo de 10 Dias de Negociação após 31 de dezembro, através do seguinte endereço de correio eletrónico: etp.nav@euronext.com.

11- Modo de comunicação com a REMU

No que se refere às informações técnicas para as quais foi criado um canal de transmissão eletrónica específico (MyEuronext), os Emitentes de ETPs devem transmitir essas informações utilizando esse canal ou, em caso de mau funcionamento daquele, através dos seguintes endereços de correio eletrónico:

- infofisd@euronext.com (para os ETP admitidos à negociação na Borsa Italiana - Mercado ETFplus)
- ETPEurope.listing@euronext.com (para os ETPs admitidos à negociação noutro mercado regulamentado gerido por uma REMU)

Anexo 1 - Pedido de exclusão de ETPs

(Nome e forma jurídica da empresa) (doravante designada por “Empresa”), com sede social em (cidade), (endereço), código fiscal, número de IVA na pessoa de (representante legal ou outra pessoa devidamente autorizada)

APLICA

nos termos das Regras e do artigo 7.º da Instrução n.º 6-07 “Administração de eventos societários e/ou de valores mobiliários, outras obrigações contínuas e condições de remoção para ETCs, ETFs e ETNs admitidos à negociação num mercado Euronext” para a exclusão dos seguintes instrumentos financeiros:

Código ISIN	Nome	Mercado Euronext
.....
.....

Especifica o seguinte motivo para o pedido:

Anexa a seguinte documentação, que será parte integrante do pedido:

- compromisso de compra: ☐ direta; ☐ indireta, através....., dos instrumentos financeiros em circulação a pedido dos titulares, pelo menos até à data da exclusão;
- uma cópia da deliberação tomada pelo órgão competente para solicitar a exclusão do Mercado relevante e/ou um comunicado de imprensa a anunciar a exclusão;
- um ficheiro XLS com a tabela que mostra a lista e características dos instrumentos financeiros para os quais se solicita a exclusão. Caso a informação neste documento difira do conteúdo do ficheiro XLS anexo, para efeitos de exclusão, prevalecerá a informação contida no ficheiro.

(local e data)

(Assinatura do representante legal ou de outra pessoa devidamente autorizada)



WWW.EURONEXT.COM