

Consulta sobre os requisitos de elegibilidade do Índice S&P/B3 Brasil ESG

AMSTERDÃ, 28 DE FEVEREIRO DE 2022: A S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) está realizando uma consulta com participantes do mercado sobre possíveis mudanças no Índice S&P/B3 Brasil ESG.

A S&P DJI está propondo fazer mudanças nos requisitos de elegibilidade usados neste índice. As alterações propostas estão detalhadas a seguir.

EXCLUSÕES BASEADAS EM ATIVIDADES COMERCIAIS

A S&P DJI está propondo implementar exclusões adicionais, ampliadas e modificadas com base no envolvimento de uma empresa em determinadas atividades comerciais definidas. As exclusões adicionais cobrem areias betuminosas, armas ligeiras e contratação militar; as exclusões expandidas incluem armas controversas; e as exclusões modificadas incluem tabaco. Essas alterações estão sendo propostas após os comentários recebidos sobre as nossas exclusões atuais. Além disso, as exclusões de participação significativa não serão mais aplicadas a categorias em que o limiar do nível de envolvimento direto for diferente de zero. Esta alteração proposta visa evitar situações em que as empresas possam ser tratadas com mais severidade devido ao nível do seu envolvimento indireto do que seriam pelo seu envolvimento direto. A tabela abaixo detalha as mudanças:

Envolvimento no produto	Categoria de envolvimento e descrição	Limiar do nível de envolvimento da S&P DJI		Limiar de participação significativa da S&P DJI		Resumo
		Atual	Proposto	Atual	Proposto	
Armas controversas	Sob medida e essencial: a empresa está envolvida no sistema principal da arma, ou em componentes/serviços do sistema principal da arma que são considerados feitos sob medida e essenciais para o uso letal da arma.	>0%	>0%	≥25%	≥25%	Nenhuma mudança
	Não sob medida ou não essencial: a empresa fornece componentes/serviços para o sistema principal da arma, que não são considerados sob medida ou não essenciais para o uso letal da arma.	N/A	>0%	NA	≥25%	Novo
Carvão térmico	Extração: a empresa extrai carvão térmico.	≥5%	≥5%	NA	NA	Nenhuma mudança
	Geração: A empresa gera eletricidade a partir de carvão térmico.	≥5%	≥5%	NA	NA	Nenhuma mudança

Envolvimento no produto	Categoria de envolvimento e descrição	Limiar do nível de envolvimento da S&P DJI		Limiar de participação significativa da S&P DJI		Resumo
		Atual	Proposto	Atual	Propost	
Produtos de tabaco	Produção: a empresa fabrica produtos de tabaco.	>0%	>0%	≥25%	≥25%	Nenhuma mudança
	Produtos/serviços relacionados: a empresa fornece produtos/serviços relacionados com o tabaco.	≥10%	≥5%	≥25%	NA	Mudança
	Varejo: a empresa obtém receitas da distribuição e/ou venda a varejo de produtos de tabaco.	≥10%	≥5%	≥25%	NA	Mudança
Areias betuminosas	Extração: a empresa extrai areias betuminosas.	N/A	≥5%	NA	NA	Novo
Armas ligeiras	Clientes civis (armas de assalto): a empresa fabrica e vende armas de assalto a clientes civis.	N/A	>0%	NA	≥25%	Novo
	Clientes civis (armas não de assalto): a empresa fabrica e vende armas ligeiras (armas não de assalto) a clientes civis.	N/A	>0%	NA	≥25%	Novo
	Clientes militares/membros da polícia: a empresa fabrica e vende armas ligeiras para militares/membros da polícia	N/A	>0%	NA	≥25%	Novo
	Componentes chave: a empresa fabrica e vende componentes chave de armas ligeiras.	N/A	>0%	NA	≥25%	Novo
	Varejo/Distribuição (armas de assalto): a empresa está envolvida no varejo e/ou distribuição de armas de assalto.	N/A	≥5%	NA	NA	Novo
	Varejo/Distribuição (armas não de assalto): A empresa está envolvida no varejo e/ou distribuição de armas ligeiras (armas não de assalto).	N/A	≥5%	NA	NA	Novo
Contratação militar	Armas: a empresa fabrica sistemas de armas militares e/ou componentes integrais feitos sob medida ou estas armas	N/A	≥10%	NA	NA	Novo
	Produtos e serviços relacionados com armas: a empresa fornece produtos e/ou serviços sob medida que promovem as armas militares.	N/A	≥10%	NA	NA	Novo

VERIFICAÇÃO DE ELEGIBILIDADE TRIMESTRAL DO ENVOLVIMENTO COMERCIAL E AS EXCLUSÕES COM BASE NO PACTO GLOBAL DA ONU

A S&P DJI está propondo implementar uma verificação de elegibilidade trimestral, pela qual qualquer membro do índice que não estiver cumprindo com os critérios de elegibilidade de envolvimento comercial ou do Pacto Global da ONU (UNGC), será removido do índice. O objetivo desta proposta é garantir que quaisquer alterações na elegibilidade de uma empresa sejam tratadas em tempo hábil. Nenhum componente será adicionado ao índice como consequência de qualquer exclusão que possa ocorrer.

ANÁLISE DOS EFEITOS

Se as mudanças propostas tivessem estado em vigor no rebalanceamento mais recente do índice, uma ação adicional teria sido excluída: Embraer S.A. (ISIN: BREMBRACNOR4). Esta empresa, que atualmente faz parte do índice, teria sido excluída devido ao seu envolvimento em atividades de contratação militar.

DATA DE IMPLEMENTAÇÃO

A S&P DJI propõe implementar as alterações metodológicas descritas anteriormente, se forem aprovadas, em conjunto com o próximo rebalanceamento, que entrará em vigor antes da abertura do mercado na segunda-feira, 2 de maio de 2022. Se forem aprovadas, as alterações serão visíveis para os clientes a partir da sexta-feira 22 de abril de 2022.

PERGUNTAS

Por favor, responda às seguintes perguntas e forneça à S&P DJI razões para suas respostas:

- 1. Você concorda com a proposta de ampliar e alterar as exclusões baseadas em atividades comerciais conforme descrito?**
- 2. Você concorda com a proposta de implementar uma verificação de elegibilidade trimestral do envolvimento comercial e as exclusões conforme o Pacto Global da ONU?**
- 3. Se alguma das alterações propostas for aprovada, você concorda com a data de implementação proposta?**
- 4. Você tem algum outro comentário ou feedback sobre as alterações propostas descritas acima?**

A sua participação nesta consulta é importante, pois reunimos informações de vários participantes do mercado a fim de avaliar adequadamente suas opiniões e preferências. Por favor, responda a esta consulta até **25 de março de 2022**. Após esta data, a S&P DJI não aceitará mais respostas à consulta. Antes da revisão final do Comissão do índice, a S&P DJI pode solicitar esclarecimentos aos respondentes como parte dessa revisão.

Para participar desta consulta, por favor, visite a enquete online disponível [aqui](#).

Para mais informações sobre esta consulta, entre em contato com a S&P Dow Jones Indices em SPDJI_Index_Governance@spglobal.com

Todos os comentários desta consulta serão analisados e considerados antes de tomar a decisão final. No entanto, a S&P Dow Jones Indices não oferece garantias nem tem qualquer obrigação de cumprir com qualquer uma das respostas. É possível que esta consulta não gere mudanças ou resultados de

CONSULTA

qualquer tipo. Se a S&P DJI decidir mudar a metodologia dos índices, um anúncio será publicado em nosso site.

Obrigado pela sua participação nesta consulta.

Para mais informações sobre a S&P Dow Jones Indices, visite www.spglobal.com/spdji/pt.

SOBRE A S&P DOW JONES INDICES

A S&P Dow Jones Indices é o maior centro global de conceitos, pesquisa e dados essenciais com base em índices. Aqui nasceram icônicos indicadores do mercado como o S&P 500® e o Dow Jones Industrial Average®. Os investimentos de ativos em produtos baseados nos nossos índices são maiores do que qualquer outro provedor no mundo. Desde que Charles Dow criou o primeiro índice em 1884, a S&P DJI tem se dedicado à inovação e ao desenvolvimento de índices nas diferentes classes de ativos, ajudando a definir a maneira em que os investidores avaliam os mercados e fazem negócios.

A S&P Dow Jones Indices é uma subsidiária de SP Global (NYSE: SPGI), que proporciona as informações fundamentais que indivíduos, empresas e governos precisam para tomar decisões com confiança. Para mais informações, visite www.spglobal.com/spdji.

PARA MAIS INFORMAÇÕES:

S&P Dow Jones Indices

index_services@spglobal.com