

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

AMSTERDÃ, 1 DE ABRIL DE 2022: A S&P Dow Jones Indices (“S&P DJI”) levou a cabo uma [consulta](#) com participantes do mercado sobre possíveis mudanças no Índice S&P/B3 Brasil ESG.

A S&P DJI fará mudanças nos requisitos de elegibilidade usados neste índice. As mudanças são detalhadas a seguir.

EXCLUSÕES BASEADAS EM ATIVIDADES COMERCIAIS

A S&P DJI implementará exclusões adicionais, ampliadas e modificadas com base no envolvimento de uma empresa em determinadas atividades comerciais definidas. As exclusões adicionais cobrem areias betuminosas, armas pequenas 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 a seguir 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 |
|-------------------------|--|--|------------|---|------------|-------------|
| | | Anterior | Atualizado | Anterior | Atualizado | |
| 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% | Sem 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/D | >0% | N/D | ≥25% | Novo |
| Carvão térmico: | Extração: a empresa extrai carvão térmico. | ≥5% | ≥5% | N/D | N/D | Sem mudança |
| | Geração: A empresa gera eletricidade a partir de carvão térmico. | ≥5% | ≥5% | N/D | N/D | Sem 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 |
|-------------------------|--|--|------------|---|------------|-------------|
| | | Anterior | Atualizado | Anterior | Atualizado | |
| Produtos de tabaco | Produção: a empresa fabrica produtos de tabaco. | >0% | >0% | ≥25% | ≥25% | Sem mudança |
| | Produtos/serviços relacionados: a empresa fornece produtos/serviços relacionados com o tabaco. | ≥10% | ≥5% | ≥25% | N/D | Modificação |
| | Varejo: a empresa obtém receitas da distribuição e/ou venda a varejo de produtos de tabaco. | ≥10% | ≥5% | ≥25% | N/D | Modificação |
| Areias betuminosas | Extração: a empresa extrai areias betuminosas. | N/D | ≥5% | N/D | N/D | Novo |
| Armas pequenas | Cientes civis (armas de assalto): a empresa fabrica e vende armas de assalto a clientes civis. | N/D | >0% | N/D | ≥25% | Novo |
| | Cientes civis (armas não de assalto): a empresa fabrica e vende armas pequenas (armas não de assalto) a clientes civis. | N/D | >0% | N/D | ≥25% | Novo |
| | Cientes militares/membros da polícia: a empresa fabrica e vende armas pequenas para militares/membros da polícia. | N/D | >0% | N/D | ≥25% | Novo |
| | Componentes chave: a empresa fabrica e vende componentes chave de armas pequenas. | N/D | >0% | N/D | ≥25% | Novo |
| | Varejo/Distribuição (armas de assalto): a empresa está envolvida no varejo e/ou distribuição de armas de assalto. | N/D | ≥5% | N/D | N/D | Novo |
| | Varejo/Distribuição (armas não de assalto): A empresa está envolvida no varejo e/ou distribuição de armas pequenas (armas não de assalto). | N/D | ≥5% | N/D | N/D | Novo |
| Contratação militar | Armas: a empresa fabrica sistemas de armas militares e/ou componentes integrais feitos sob medida ou estas armas. | N/D | ≥10% | N/D | N/D | Novo |
| | Produtos e serviços relacionados com armas: a empresa fornece produtos e/ou serviços sob medida que promovem as armas militares. | N/D | ≥10% | N/D | N/D | Novo |

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

A S&P DJI implementará 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.

DATA DE IMPLEMENTAÇÃO

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

Cabe observar que a metodologia no site da S&P DJI está sendo atualizada para refletir estas mudanças.

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 a maior fonte 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 trabalhado na inovação e desenvolvimento de índices em diversas classes de ativos, ajudando a definir a maneira em que os investidores medem os mercados e fazem negócios.

A S&P Dow Jones Indices é uma subsidiária de S&P 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/pt.

PARA MAIS INFORMAÇÕES:

S&P Dow Jones Indices

index_services@spglobal.com