

S&P Global 1200

Metodologia

Dezembro 2021

Este documento foi traduzido para o português apenas para fins de conveniência. Se existirem diferenças entre as versões do documento em inglês e português, a versão em inglês prevalecerá. A versão em inglês está disponível em nosso site www.spglobal.com/spdji.

Índice

Introdução	2
Objetivo do índice	2
Documentos de apoio	3
Critérios de elegibilidade	4
S&P Global 1200	4
Construção do índice	5
Cálculo dos índices	5
S&P Global 1200	5
S&P Global 1200 ex Canada	5
S&P International 700	5
S&P Global 100	5
S&P Global 1200 Capped Sector Indices e S&P Global 100 Capped Index	6
Manutenção do índice	9
Prazos das mudanças	9
Eventos corporativos	9
Moeda de cálculo e séries adicionais de retorno do índice	9
Data de referência e disponibilidade do histórico	11
Dados dos índices	12
Cálculos de tipos de retorno	12
Governança do índice	13
Comitê de Índices	13
Política dos Índices	14
Anúncios	14
Arquivos pró-forma	14
Calendário de feriados	14
Rebalanceamento	14
Fechamentos inesperados de bolsas de valores	14
Política de recálculo	14
Cálculo de índices em tempo real	15
Informações de contato	15
Divulgação dos índices	16
Símbolos de cotação	16
Dados dos índices	16
Site	16
Isenção de responsabilidade da S&P Dow Jones Indices	17

Introdução

Objetivo do índice

O S&P Global 1200 procura medir o desempenho de ações large cap dos principais mercados do mundo. O S&P Global 1200 é um índice global composto por ações de sete benchmarks de renda variável de países e regiões. O índice é ponderado por capitalização de mercado ajustada ao free float (FMC).

Índices componentes. O S&P Global 1200 é composto pelos seguintes índices regionais:

- S&P 500
- S&P Europe 350
- S&P/TSX 60
- S&P/TOPIX 150
- S&P/ASX All Australian 50
- S&P Asia 50
- S&P Latin America 40

Para mais informações sobre um índice regional específico, confira a metodologia correspondente no site www.spglobal.com/spdji.

Subíndices. O S&P Global 1200 é composto pelos seguintes subíndices:

- **S&P International 700.** Este índice procura medir o desempenho do S&P Global 1200, excluindo os componentes do S&P 500.
- **S&P Global 100.** Este índice procura medir o desempenho de 100 empresas multinacionais extraídas do índice subjacente (o S&P Global 1200), cujos negócios são globais por natureza e que obtêm uma parcela importante dos seus ganhos de vários países.
- **S&P Global 100 Capped.** O índice é composto por todas as ações do S&P Global 100. O índice utiliza um esquema de ponderação por capitalização de mercado limitada, bem como uma metodologia específica de limitação definida na seção *Construção do índice*.
- **S&P Global 1200 ex Canada.** Este índice procura medir o desempenho do S&P Global 1200, excluindo os componentes do S&P/TSX 60.
- **Índices setoriais com limite do S&P Global 1200.** Os componentes do índice são extraídos do índice subjacente (o S&P Global 1200) e escolhidos para sua inclusão no índice com base na sua classificação no Padrão Global de Classificação Industrial (GICS®). Os índices utilizam um esquema de ponderação por capitalização mercado limitada, bem como uma metodologia específica de limitação definida na seção *Construção do índice*.

Documentos de apoio

Esta metodologia foi desenvolvida para ser lida junto com documentos de apoio que fornecem maiores detalhes a respeito das políticas, procedimentos e cálculos aqui descritos. As referências nesta metodologia procuram direcionar o leitor para o documento de apoio relevante para mais informações sobre um assunto específico. A lista dos principais documentos de apoio para esta metodologia junto com o seu link é a seguinte:

Documento de apoio	Link
Metodologia Políticas e Práticas de Índices de Renda Variável da S&P Dow Jones Indices.	Políticas e Práticas de Índices de Renda Variável
Metodologia da Matemática dos Índices da S&P Dow Jones Indices	Metodologia da Matemática dos Índices
Metodologia de ajuste de índices ao free float da S&P Dow Jones Indices	Metodologia de ajuste de índices ao free float
Metodologia do Padrão Global de Classificação Industrial (GICS) da S&P Dow Jones Indices	Metodologia do GICS

Esta metodologia foi criada pela S&P Dow Jones Indices para atingir o objetivo mencionado de medir o interesse subjacente dos índices regidos pela metodologia detalhada neste documento. Quaisquer alterações ou diferenças com esta metodologia serão realizadas com base na decisão e critério exclusivo da S&P Dow Jones Indices, a fim de que os índices continuem a atingir seu objetivo.

Cr terios de elegibilidade

S&P Global 1200

O  ndice   composto pelos sete  ndices regionais a seguir:

�ndice	Region
S&P 500	Am�rica do Norte
S&P/TSX 60	Am�rica do Norte
S&P Europe 350	Europa
S&P/TOPIX 150	�sia/Pac�fico
S&P/ASX All Australian 50	�sia/Pac�fico
S&P Asia 50	�sia/Pac�fico
S&P Latin America 40	Am�rica Latina

Construção do índice

Cálculo dos índices

Os índices são calculados através da metodologia de divisor usada para todos os índices de renda variável da S&P Dow Jones Indices.

Para mais informações sobre a metodologia de cálculo dos índices, confira a metodologia Matemática dos Índices da S&P Dow Jones Indices.

S&P Global 1200

Seleção dos componentes. Em cada rebalanceamento, todos os títulos que atendem aos critérios estabelecidos nos *Critérios de elegibilidade* são escolhidos e compõem o índice.

Ponderação dos componentes. O índice é ponderado por capitalização de mercado ajustada ao free float (FMC).

S&P Global 1200 ex Canada

Seleção dos componentes. Em cada rebalanceamento, o índice é composto por todas as ações do S&P Global 1200, exceto aquelas que também fazem parte do S&P/TSX 60.

Ponderação dos componentes. O índice é ponderado por capitalização de mercado ajustada ao free float (FMC).

S&P International 700

Seleção dos componentes. Em cada rebalanceamento, o índice é composto por todas as ações do S&P Global 1200, exceto aquelas que também fazem parte do S&P 500.

Ponderação dos componentes. O índice é ponderado por capitalização de mercado ajustada ao free float (FMC).

S&P Global 100

Seleção dos componentes. A seleção de componentes fica a critério do Comitê de Índices. As empresas incluídas no índice subjacente são examinadas em termos de exposição global, representação setorial, liquidez e tamanho. As ações com tamanho relativamente maior e liquidez mais elevada têm preferência sobre outras. Além disso, as empresas devem atender aos seguintes requerimentos:

- **Exposição global.** Para serem elegíveis, as empresas devem ter exposição global. As companhias serão consideradas globais por natureza se as duas condições a seguir forem atendidas:
 - Mais de 30% das suas receitas são geradas fora da região de domicílio.¹
 - Mais de 30% dos seus ativos estão locados fora da região de domicílio.

Além das condições mencionadas anteriormente, a exposição das receitas deve incluir as três regiões “principais” (América do Norte, Europa e Ásia-Pacífico).

¹ Os dados GeoRev da Factset são usados para determinar a origem das receitas.

- **Classificação setorial.** O equilíbrio entre setores, medido pela comparação entre o peso de cada setor do GICS em um índice e a sua ponderação no S&P Global 1200, também é considerado para a seleção de empresas.
- **Capitalização de mercado.** As companhias consideradas para inclusão no índice devem apresentar, no mínimo, uma capitalização de mercado ajustada ao free float (FMC) de US\$ 5 bilhões.

Múltiplas classes de ações. Todas as linhas de classes de ações múltiplas cotadas publicamente são elegíveis para serem incluídas no índice, sujeitas ao cumprimento dos critérios de elegibilidade. Para mais informações quanto ao tratamento de múltiplas classes de ativos, por favor confira a abordagem A dentro da seção “Múltiplas classes de ações” da Metodologia de Políticas e Práticas de Renda Variável da S&P Dow Jones Indices.

Ponderação dos componentes. O índice é ponderado por capitalização de mercado ajustada ao free float (FMC).

S&P Global 1200 Capped Sector Indices e S&P Global 100 Capped Index

Seleção dos componentes. As companhias do S&P Global 1200 são classificadas com base no GICS. Cada índice setorial com limite é composto por todas as ações que fazem do setor do GICS correspondente. O S&P Global 100 Capped é composto por todas as ações do S&P Global 100.

Índice	Setor	Limite por empresa	Limite total	Disparador dinâmico diário de limitação	Limite de disparador diário
S&P Global 1200 Consumer Discretionary (Sector) Capped Index	Bens de Consumo Discricionário (código GICS: 25)	10%	4,5%/22,5%	Sim	5%/25%
S&P Global 1200 Consumer Staples (Sector) Capped Index	Produtos Básicos de Consumo (código GICS: 30)	10%	4,5%/22,5%	Sim	5%/25%
S&P Global 1200 Utilities (Sector) Capped Index	Serviços de Utilidade Pública (código GICS: 55)	10%	4,5%/22,5%	Yes	5%/25%
S&P Global 1200 Communication Services 4.5/22.5/45 Capped Index	Serviços de Comunicações (código GICS: 50)	22,5%	4,5%/45%	Não	n/a
S&P Global 100 Capped Index	n/a	10%	4,5%/22,5%	Sim	5%/25%

Para mais informações sobre o GICS®, confira o documento de metodologia do GICS® da S&P Dow Jones Indices.

As mudanças nos componentes são incorporadas nos índices setoriais conforme e quando são feitas no índice setorial correspondente e no S&P Global 100 Capped Index quando são feitas no S&P Global 100. Vale a pena notar que, exceto para as ações, qualquer adição que não coincidir com uma data efetiva de reponderação será realizada ao índice com limite que tiver o maior Fator de Ponderação Adicional (AWF) representado nesse índice. Se o maior AWF no índice não for compartilhado por múltiplos componentes do índice, a nova adição ao índice será feita com ações do índice que sejam proporcionais às ações da empresa no índice em um rebalanceamento hipotético utilizando os preços de fechamento na data em que a adição for anunciada. Em tais casos de ponderação proporcional, as ações do índice para todos os componentes atuais permanecerão constantes.

Para mais informações sobre o AWF, confira a seção Índices ponderados por capitalização de mercado limitada na metodologia Matemática dos Índices da S&P Dow Jones Indices.

Ponderação dos componentes. Cada índice é ponderado por capitalização de mercado limitada. Para efeitos de reponderação, o índice é rebalanceado a cada trimestre após o encerramento da terceira sexta-feira de março, junho, setembro e dezembro. A data de referência para a limitação é a quarta-feira anterior à segunda sexta-feira do mês de rebalanceamento.

Vários índices com limite também são revisados diariamente com base na ponderação por capitalização de mercado limitada de cada empresa. A limitação diária é feita somente quando a soma das companhias com ponderação superior a 5% ultrapassa 25%. Quando o limite diário é necessário, as mudanças são anunciadas após o encerramento do dia útil em que os limites diários de ponderação são excedidos, sendo a data de referência depois desse mesmo dia útil, e entram em vigor após o fechamento do dia de negociação seguinte. Embora o limite seja revisado diariamente, o índice pode ser limitado com menor frequência. Se um limite diário for acionado durante uma janela trimestral de limite de ponderação que ocorre regularmente, o índice afetado será limitado com as alterações exibidas no arquivo Diário de Eventos Corporativos relevante (*.SDE). O arquivo Proforma Diário (* PRO.SDC) exhibe os resultados do limite de ponderação trimestral. Qualquer índice que exija limite diário não é avaliado no próximo dia útil, pois a limitação realizada anteriormente entra em vigor no fechamento desse dia. Os processos trimestrais e diários de limitação são realizados de acordo com os procedimentos a seguir:

1. Com os preços refletidos na data de referência de rebalanceamento, e os dados de participação, ações emitidas e IWFs na data efetiva de rebalanceamento, cada empresa é ponderada pela capitalização de mercado ajustada ao free float. As modificações são feitas conforme definido a seguir.
2. Se a ponderação de qualquer empresa for superior ao limite da empresa, será limitada conforme o peso máximo estabelecido para essa empresa e o excesso de ponderação será redistribuído proporcionalmente entre todas as empresas não limitadas dentro do índice. Após esta redistribuição, se a ponderação de outra empresa ultrapassar o limite de ponderação, o processo será repetido iterativamente até nenhuma ação incumprir a regra de limite de ponderação.
3. Logo depois, a ponderação total das empresas com ponderação superior a 4,5% não poderá superar o limite total de ponderação.
4. Se a regra do passo 3 for infringida, todas as companhias serão classificadas em ordem decrescente conforme suas ponderações e será identificada a companhia que tiver a menor ponderação acima de 4,5%. Posteriormente, a ponderação de tal companhia será reduzida até cumprir a regra do passo 3 ou até atingir 4,5%.
5. Esta ponderação adicional é redistribuída de maneira proporcional entre todas as companhias com ponderações inferiores a 4,5%. Qualquer ação que receber uma ponderação não poderá ultrapassar o limite de 4,5%. Este processo é repetido iterativamente até cumprir o passo 3 ou até todas as ações tiverem uma ponderação superior ou igual a 4,5%.
6. Se a regra do passo 3 ainda estiver sendo infringida e todas as companhias apresentarem ponderações iguais ou superiores a 4,5%, será identificada a companhia que tiver a menor ponderação e que estiver causando o incumprimento do limite de 4,5%. Posteriormente, a ponderação de tal companhia será reduzida até cumprir a regra do passo 3 ou até atingir 4,5%.
7. Esta ponderação adicional é redistribuída de maneira proporcional entre todas as companhias com ponderações inferiores a 4,5%. Qualquer ação que receber uma ponderação não poderá ultrapassar o limite por empresa. Este processo é repetido iterativamente até cumprir o passo 3.
8. As quotas de participação são atribuídas a cada componente a fim de atingir as ponderações calculadas acima. Visto que as participações nos índices são determinadas com base nos preços dos títulos antes do rebalanceamento, a ponderação real de cada componente na data de rebalanceamento será um tanto diferente por causa dos movimentos do mercado.

Às vezes, o número de companhias de um índice pode exigir que as regras de limitação sejam flexibilizadas. Confira a tabela a seguir para uma visão geral do processo seguido, quando necessário. Cada linha subsequente representa uma flexibilização dos limites de ponderação da linha anterior.

Número de componentes	Limitação de ponderação de empresas individuais ²	Limiar para o limite total de ponderação por empresa ²	Limite total de ponderação por empresa ³
12-14	25,0%	5,0%	50%
11	27,5%	5,5%	55%
9-10	30,0%	6,0%	60%
8	32,5%	6,5%	65%
7	35,0%	7,0%	70%
6	37,5%	7,5%	75%
5	40,0%	8,0%	80%
4	42,5%	8,5%	85%
3	50,0%	9,5%	95%

Para mais informações sobre a metodologia de cálculo dos índices, confira a seção Índices ponderados por capitalização de mercado limitada na metodologia da Matemática dos Índices da S&P Dow Jones Indices.

Às vezes, as empresas podem estar representadas nos S&P Global 1200 Capped Sector Indices ou no S&P Global 100 Capped Index por linhas de múltiplas classes de ações. O limite máximo de ponderação se baseia na capitalização de mercado ajustada ao free float da empresa, em que o peso de empresas com múltiplas classes de ações é atribuído proporcionalmente a cada classe com base na sua capitalização de mercado ajustada ao free float na data de referência de rebalanceamento. Se não for necessário aplicar o limite, as duas classes de ações permanecerão no índice com a sua capitalização de mercado ajustada ao free float natural.

Em alguns casos, as empresas controladoras relacionadas podem manter o controle de voto de outra empresa incluída no índice. No caso do S&P Global 1200 Utilities (Sector) Capped Index, o limite é aplicado ao nível do emissor, definido como qualquer controladora e subsidiária controlada em que mais de 20% de todas as ações com direito a voto na subsidiária são controladas pelo mesmo grupo de controle do emissor. O limite de peso máximo é baseado na capitalização de mercado ajustada ao free float da empresa, com o peso de várias empresas no grupo de controle sendo alocado proporcionalmente a cada empresa com base na sua capitalização de mercado ajustada ao free float na data de referência do rebalanceamento. Se nenhum limite for exigido, as empresas identificadas permanecem no índice com sua capitalização de mercado ajustada ao free float natural.

A S&P DJI realiza uma revisão anual de todos os emissores, coincidindo com o rebalanceamento anual de setembro. Qualquer alteração em um emissor resultante de um evento corporativo será implementada no momento do evento. As atualizações acionadas pela divulgação de novas informações públicas não relacionadas a eventos corporativos ou correções a entidades do grupo existentes, geralmente serão implementadas a partir do rebalanceamento trimestral.

² As empresas individuais são limitadas conforme o limite de ponderação por empresa.

³ A soma de todas as empresas com ponderações superiores ao limiar para o limite total de ponderação por empresa é delimitada conforme o limite total de ponderação por empresa.

Manutenção do índice

Os componentes do S&P Global 1200 também fazem parte dos índices regionais que compõem o S&P Global 1200. Assim, algumas mudanças específicas aos componentes do índice (como mudanças nas ações ou no IWF, distribuição de dividendos, ajuste de preços, etc.), seguem a política do índice regional respectivo.

Confira a metodologia da Matemática dos Índices da S&P Dow Jones Índice para mais detalhes sobre o cálculo da capitalização de mercado nos índices.

Prazos das mudanças

As adições e exclusões do S&P Global 1200 e os subíndices correspondentes ocorrem simultaneamente às mudanças dos sete índices regionais que o compõem.

Confira as metodologias individuais dos índices regionais para mais informações sobre os critérios de adição e exclusão. Estes documentos estão disponíveis em www.spglobal.com/spdji/.

As mudanças na composição do S&P Global 100 geralmente ocorrem apenas se uma vaga for criada devido a fusões, aquisições, deslistagem, etc.

Eventos corporativos

O tratamento de eventos corporativos dos índices reflete o dos índices regionais correspondentes.

Confira as metodologias individuais dos índices regionais para mais informações sobre o tratamento de eventos corporativos. Estes documentos estão disponíveis em www.spglobal.com/spdji/.

S&P Global 100. As cissões serão adicionadas a um preço zero no fechamento do mercado no dia anterior à data ex (sem ajuste do divisor), e posteriormente removidas após pelo menos um dia de negociação normal.

Para informações gerais sobre eventos corporativos, por favor confira a metodologia Políticas e Práticas de Índices de Renda Variável da S&P Dow Jones Indices.

Moeda de cálculo e séries adicionais de retorno do índice

Os índices são calculados em dólares americanos. Adicionalmente, o S&P Global 1200 também é calculado em euros e libras esterlinas, enquanto o S&P Global 100 também é calculado em dólares australianos.

As taxas de câmbio à vista em tempo real, conforme fornecidas pela Refinitiv, são utilizadas para o cálculo contínuo de índices em tempo real.

As taxas de câmbio estrangeiras da WM/Refinitiv são recebidas diariamente às 4:00 p.m., hora de Londres, e usadas no cálculo dos índices no encerramento do dia. Estes ajustes são calculados pela WM Company com base nas informações da Refinitiv e são apresentados nas páginas WMRA.

Além dos índices detalhados nesta metodologia, versões adicionais de retorno dos índices podem estar disponíveis, incluindo, mas não se limitando a versões de moeda, moeda protegida por hedge, decréscimo, valor de mercado, inversos, alavancados e de controle de risco. Para uma lista dos índices disponíveis, confira o [S&P DJI Methodology & Regulatory Status Database](#).

Para mais informações sobre o cálculo de diferentes tipos de índices, confira o documento Matemática dos Índices da S&P Dow Jones Indices.

Para mais informações sobre as entradas necessárias para calcular certos tipos de índices, incluindo de decréscimo, hedge dinâmico, valor justo e índices de controle de risco, consulte os documentos de Parâmetros disponíveis em www.spdji.com.

Data de referência e disponibilidade do histórico

A disponibilidade do histórico, as datas de referência e os valores de base são mostrados na tabela a seguir.

Índice	Data de lançamento	Primeira data de valorização	Data de referência	Valor de base
S&P Global 1200 Index	31/12/1989	31/12/1989	31/12/1997	100
S&P Global 1200 ex Canada Index	18/07/2016	31/12/2003	31/12/2003	1000
S&P International 700	18/06/2002	11/09/1989	12/21/1997	1000
S&P Global 100 Index	31/12/1989	31/12/1989	31/12/1997	1000
S&P Global 100 Capped Index	05/08/2019	11/09/1989	31/12/1997	1000
S&P Global 1200 Communication Services 4.5/22.5/45 Capped Index	11/02/2019	31/12/2001	31/12/2001	1000
S&P Global 1200 Consumer Discretionary (Sector) Capped Index	20/05/2019	17/12/1999	17/12/1999	1000
S&P Global 1200 Consumer Staples (Sector) Capped Index	20/05/2019	17/12/1999	17/12/1999	1000
S&P Global 1200 Utilities (Sector) Capped Index	15/02/2021	31/01/2021	18/09/2020	1000

Dados dos índices

Cálculos de tipos de retorno

A S&P Dow Jones Indices calcula diversos tipos de retornos, que variam dependendo do tratamento de dividendos regulares pagos em dinheiro. A classificação de dividendos regulares pagos em dinheiro é determinada pela S&P DJI.

- As versões de retorno do preço (PR) são calculadas sem ajustar os dividendos regulares pagos em dinheiro.
- As versões de retornos totais brutos (TR) reinvestem os dividendos regulares em dinheiro no fechamento da data ex-dividendo, sem considerar retenções de imposto.
- As versões de retornos líquidos totais (NTR), se disponíveis, reinvestem os dividendos regulares pagos em dinheiro no fechamento da data ex-dividendo, após a dedução de retenções de imposto aplicáveis.

Se não existirem dividendos regulares pagos em dinheiro na data ex-dividendo, o desempenho diário dos três índices será idêntico.

Para uma lista completa dos índices disponíveis, por favor confira o arquivo de níveis diários dos índices (".SDL").

Para mais informações sobre a classificação de dividendos em dinheiro regulares versus especiais, bem como as taxas de impostos usadas para o cálculo do retorno neto, confira a metodologia Políticas e Práticas de Índices de Renda Variável da S&P Dow Jones Indices.

Para mais informações sobre o cálculo dos diferentes tipos de retornos, confira a metodologia da Matemática dos Índices da S&P Dow Jones Indices.

Governança do índice

Comitê de Índices

Um Comitê de Índices da S&P Dow Jones Indices está encarregado da manutenção dos índices. O Comitê de Índices se reúne regularmente. Todos os membros deste Comitê são profissionais em tempo integral da S&P Dow Jones Indices. Em cada reunião, o Comitê de Índices revisa eventos corporativos pendentes que possam afetar os componentes do índice, estatísticas que comparem a composição de um índice com o mercado, empresas que sejam consideradas como candidatas para serem incluídas em um índice, além de quaisquer acontecimentos importantes que ocorram no mercado. Além disso, o Comitê de Índices poderá modificar as regras que abrangem a seleção de companhias, tratamento de dividendos, número de ações e outras questões.

Os Comitês de Índices da S&P Dow Jones Indices se reservam o direito de fazer exceções ao aplicar a metodologia caso seja necessário. Em qualquer cenário em que o tratamento for diferente das regras gerais estabelecidas neste documento ou em documentos de apoio, os clientes receberão aviso com antecedência suficiente, sempre que possível.

Além da governança diária dos índices e manutenção das metodologias, pelo menos uma vez a cada 12 meses, o Comitê de Índices revisa a metodologia do índice a fim de garantir que os índices continuem a alcançar os objetivos definidos e que os dados e as metodologias continuem sendo eficazes. Em alguns casos, a S&P Dow Jones Indices pode publicar uma consulta, convidando partes externas a manifestar seus comentários.

A S&P Dow Jones Indices considera as informações sobre mudanças aos seus índices e questões relacionadas como potencialmente relevantes e significativas para o mercado. Portanto, todas as reuniões do Comitê de Índices são confidenciais.

Para mais informações sobre garantia de qualidade e revisões internas de metodologias, confira a metodologia Políticas e Práticas de Índices de Renda Variável da S&P Dow Jones Indices.

Política dos Índices

Anúncios

Todos os componentes dos índices são avaliados diariamente em relação aos dados necessários para calcular os níveis e retornos dos índices. Todos os eventos que afetem o cálculo diário dos índices são normalmente anunciados com até 30 dias de antecedência por meio do relatório de Eventos Corporativos (SDE), entregue diariamente a todos os clientes. Qualquer tratamento incomum de um evento corporativo ou aviso de um evento sem antecedência podem ser comunicados por e-mail aos clientes.

Para mais informações, por favor confira a seção Anúncios da metodologia Políticas e Práticas de Índices de Renda Variável da S&P Dow Jones Indices.

Arquivos pró-forma

Além do arquivo de eventos corporativos (.SDE), a S&P DJI fornece arquivos pró-forma dos componentes em cada rebalanceamento. Normalmente, o arquivo pró-forma é fornecido de forma diária antes da data de rebalanceamento e contém todos os componentes, além de suas ponderações correspondentes e participações no índice, vigentes no próximo rebalanceamento. Visto que as participações nos índices são determinadas com base nos preços antes do data efetiva de rebalanceamento, a ponderação real de cada ação na data de rebalanceamento será diferente por causa dos movimentos do mercado.

Visite www.spglobal.com/spdji para obter uma programação completa dos rebalanceamento e prazos de entrega dos arquivos pró-forma.

Calendário de feriados

O índice é calculado diariamente ao longo do ano-calendário, exceto nos dias em que todas as bolsas de valores em que os componentes do índice estão listados estão oficialmente fechadas.

Um calendário completo de feriados está disponível no site da S&P Dow Jones Indices, www.spglobal.com/spdji.

Rebalanceamento

O Comitê de índices pode modificar a data de um rebalanceamento por diversos motivos, incluindo feriados do mercado que ocorram na data de rebalanceamento programada ou em uma data próxima. Tal alteração será anunciada com a devida antecedência, sempre que possível.

Fechamentos inesperados de bolsas de valores

Para mais informações sobre fechamentos não programados do mercado, confira a metodologia Políticas e Práticas de Índices de Renda Variável da S&P Dow Jones Indices.

Política de recálculo

Para mais informações sobre a política de recálculo, por favor confira a metodologia Políticas e Práticas de Índices de Renda Variável da S&P Dow Jones Indices.

Cálculo de índices em tempo real

Os cálculos de índices em tempo real e intradia são realizados para determinados índices, sempre que qualquer uma das suas bolsas principais estiver aberta. Os índices em tempo real não são recalculados.

Para informações sobre os Cálculos e Interrupções de Preços, Opiniões de especialistas e Hierarquia de dados, por favor confira a metodologia Políticas e Práticas de Índices de Renda Variável da S&P Dow Jones Indices.

Informações de contato

Para perguntas sobre um índice, por favor contate a: index_services@spglobal.com.

Divulgação dos índices

Os valores dos índices são disponibilizados pela S&P Dow Jones Indices através do seu site www.spglobal.com/spdji, pelos principais fornecedores de cotação (ver códigos abaixo), por inúmeros sites especializados em investimentos e por diversos meios impressos e eletrônicos.

Símbolos de cotação

A tabela a seguir mostra os índices principais abrangidos por esta metodologia. Todas as versões dos índices a seguir que possam existir também são abrangidas por este documento. Para uma lista completa dos índices abrangidos por este documento, confira o [S&P DJI Methodology & Regulatory Status Database](#).

Índice	Bloomberg	Reuters
S&P Global 1200 (PR)	SPGLOB	.SPGLOBAL
S&P Global 1200 ex Canada (PR)	-	--
S&P International 700 (TR)	-	--
S&P International 700 (NTR)	SPTR700N	--
S&P Global 100 Index (PR)	OOI	--
S&P Global 100 Capped Index (PR)	SPG1DCUP	--
S&P Global 100 Capped Index (TR)	SPG1DCUT	--
S&P Global 100 Capped Index (NTR)	SPG1DCUN	--
S&P Global 1200 Communication Services 4.5/22.5/45 Capped Index (PR)	SPGCSRUP	.SPGCSRUP
S&P Global 1200 Consumer Discretionary (Sector) Capped Index (USD) PR	SPG25CUP	.SPG25CUP
S&P Global 1200 Consumer Staples (Sector) Capped Index (USD) PR	SPG30CUP	.SPG30CUP
S&P Global 1200 Utilities (Sector) Capped Index (USD) PR	SPG55CUP	--

Dados dos índices

Dados diários sobre as ações e os índices estão disponíveis por meio de assinatura.

Para mais informações sobre os produtos, por favor entre em contato com a S&P Dow Jones Indices, www.portugues.spindices.com/contact-us/.

Site

Para mais informações, por favor visite o site da S&P Dow Jones Indices, www.spglobal.com/spdji.

Isenção de responsabilidade da S&P Dow Jones Índices

© 2021 S&P Dow Jones Índices. Todos os direitos reservados. S&P, S&P 500, S&P 500 LOW VOLATILITY INDEX, S&P 100, S&P COMPOSITE 1500, S&P 400, S&P MIDCAP 400, S&P 600, S&P SMALLCAP 600, S&P GIVI, GLOBAL TITANS, DIVIDEND ARISTOCRATS, S&P TARGET DATE INDICES, S&P PRISM, S&P STRIDE, GICS, SPIVA, SPDR e INDEXOLOGY são marcas comerciais registradas da S&P Global Inc. ("S&P Global"), ou suas afiliadas. DOW JONES, DJ, DJIA, THE DOW, e DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE são marcas comerciais da Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"). Essas marcas registradas juntamente com outras foram licenciadas à S&P Dow Jones Índices LLC. A redistribuição, reprodução e/ou fotocópia total ou parcial é proibida sem consentimento por escrito da S&P Dow Jones Índices LLC. Este documento não constitui uma oferta de serviços nas jurisdições onde a S&P Dow Jones Índices LLC, S&P Global, Dow Jones ou suas respectivas afiliadas (coletivamente "S&P Dow Jones Índices") não possuem as licenças necessárias. Com exceção de alguns serviços personalizados de cálculo de índices, todas as informações fornecidas pela S&P Dow Jones Índices são impessoais e não adaptadas às necessidades de qualquer pessoa, entidade ou grupo de pessoas. A S&P Dow Jones Índices recebe compensação relacionada com o licenciamento de seus índices a terceiros e com os serviços personalizados de cálculo de índices. O desempenho de um índice no passado não é sinal ou garantia de resultados no futuro.

Não é possível investir diretamente em um índice. A exposição a uma classe de ativos representada por um índice pode estar disponível por meio de instrumentos de investimento baseados naquele índice. A S&P Dow Jones Índices não patrocina, endossa, vende, promove ou gerencia nenhum fundo de investimento ou outro veículo de investimento que seja oferecido por terceiros e que procure fornecer um rendimento de investimento baseado no desempenho de qualquer índice. A S&P Dow Jones Índices não oferece nenhuma garantia de que os produtos de investimento com base no índice acompanharão de modo preciso o desempenho do índice, ou proporcionarão rendimentos positivos. A S&P Dow Jones Índices LLC não é uma consultora de investimentos e a S&P Dow Jones Índices não faz declarações com respeito à conveniência de se investir em qualquer fundo de investimento ou outro veículo de investimento. A decisão de investir em um determinado fundo de investimentos ou outro veículo de investimento não deverá ser tomada com base em nenhuma declaração apresentada neste documento. Potenciais investidores são aconselhados a fazerem investimentos em tais fundos ou outro veículo somente após considerarem cuidadosamente os riscos associados a investir em tais fundos, conforme detalhado em um memorando de oferta ou documento similar que seja preparado por ou em nome do emitente do fundo de investimento ou outro produto de investimento ou veículo. A S&P Dow Jones Índices não é uma consultoria fiscal. É preciso que um consultor fiscal avalie o impacto de quaisquer títulos isentos de impostos nas carteiras e as consequências de alguma decisão particular de investimento. A inclusão de um título em um índice não é uma recomendação da S&P Dow Jones Índices para comprar, vender ou deter tal título, nem deve ser considerado como um aconselhamento de investimento.

Estes materiais foram preparados unicamente com fins informativos baseados nas informações geralmente disponíveis para o público e obtidas de fontes consideradas como confiáveis. Nenhum conteúdo nestes materiais (incluindo dados de índice, classificações, análises e dados relacionados a crédito, modelos, software ou outros aplicativos ou informações destes) ou qualquer parte deste (Conteúdo) pode ser modificado, submetido à engenharia reversa, reproduzido ou distribuído de nenhuma forma, por nenhum meio, nem armazenado em bases de dados ou sistema de recuperação, sem o consentimento prévio por escrito da S&P Dow Jones Índices. O Conteúdo não deve ser usado para nenhum fim ilegal ou não autorizado. A S&P Dow Jones Índices e seus provedores de dados terceirizados e licenciadores (coletivamente "Partes da S&P Dow Jones Índices") não garantem a precisão, integridade, oportunidade ou disponibilidade do Conteúdo. As partes da S&P Dow Jones

Índices não são responsáveis por quaisquer erros ou omissões, independentemente da causa, nos resultados obtidos do uso do Conteúdo. O CONTEÚDO É FORNECIDO "NO ESTADO EM QUE SE ENCONTRA". AS PARTES DE S&P DOW JONES ÍNDICES SE ISENTAM DE QUAISQUER E TODAS AS GARANTIAS EXPRESSAS OU IMPLÍCITAS, INCLUINDO MAS SE LIMITANDO A, QUALQUER GARANTIA DE COMERCIALIZAÇÃO OU ADEQUAÇÃO A UM FIM OU USO EM PARTICULAR, ISENÇÃO DE BUGS, ERROS OU DEFEITOS DE SOFTWARE, QUE A FUNCIONALIDADE DO CONTEÚDO SERÁ ININTERRUPTA OU QUE O CONTEÚDO OPERARÁ COM QUALQUER CONFIGURAÇÃO DE SOFTWARE OU DE HARDWARE. Sob nenhuma circunstância, as Partes da S&P Dow Jones Índices serão responsáveis a qualquer parte, por quaisquer danos diretos, indiretos, incidentais, exemplares, compensatórios, punitivos, especiais ou consequenciais, custos, despesas, custas legais ou perdas (incluindo, sem limitação, perda de rendimentos ou perda de lucros e custos de oportunidades); em conexão com qualquer uso do Conteúdo, mesmo se aconselhado da possibilidade de tais danos.

A S&P Global mantém algumas atividades de suas unidades de negócios separadas umas das outras a fim de preservar a independência e a objetividade de suas respectivas atividades. Como resultado, algumas unidades de negócios da S&P Global poderão ter informações que não estejam disponíveis para outras unidades de negócios. A S&P Global estabelece políticas e procedimentos para manter a confidencialidade de algumas informações não públicas recebidas em conexão com cada processo analítico.

Além disto, a S&P Dow Jones Índices presta uma ampla gama de serviços a, ou relacionados com, muitas empresas, incluindo emissoras de títulos, consultoras de investimentos, corretoras, bancos de investimentos, outras instituições financeiras e intermediários financeiros; e, em conformidade, pode receber taxas ou outros benefícios econômicos dessas empresas, incluindo empresas cujos títulos ou serviços possam recomendar, classificar, incluir em portfólios modelos, avaliar, ou abordar de qualquer outra forma.

O Padrão Global de Classificação Industrial (GICS[®]) foi desenvolvido por e é de propriedade exclusiva e uma marca comercial da S&P e MSCI. A MSCI, a S&P e nem qualquer outra parte envolvida em fazer ou compilar quaisquer classificações da GICS fazem quaisquer garantias ou declarações expressas ou implícitas com relação a tal padrão ou classificação (ou aos resultados a serem obtidos pela sua utilização), e todas as partes, por este instrumento, expressamente se isentam de todas as garantias de originalidade, precisão, integridade, comerciabilidade ou adequação a um fim particular com relação a qualquer padrão ou classificação. Sem limitar o que foi exposto acima, sob nenhuma circunstância, a MSCI, a S&P e nenhuma de suas afiliadas ou terceiro envolvido em fazer ou compilar quaisquer classificações do GICS terá qualquer responsabilidade por quaisquer danos diretos, indiretos, especiais, punitivos, consequenciais, ou quaisquer outros (inclusive perda de lucros), mesmo se notificado da possibilidade de tais danos.