



Série de Índices de Receitas Verdes da FTSE

v2.3



Sumário

1.0	Apresentação	3
2.0	Responsabilidades de gestão	5
3.0	Políticas do Índice FTSE Russell	7
4.0	Títulos qualificados	9
5.0	Inputs de Dados de IS	10
6.0	Modelo de dados de Receitas Verdes da FTSE	11
7.0	Revisão periódica	13
8.0	Mudanças nas empresas integrantes	15
9.0	Medidas e eventos societários	16
10.0	Método de cálculo do índice	17
	Anexo A: Outras informações:	19



Seção 1

Apresentação

1.0 Apresentação

- 1.1 O presente documento dispõe sobre as regras básicas para a elaboração e o gerenciamento da Série de Índices de Receitas Verdes da FTSE. Cópias das regras básicas estão disponíveis em www.ftserussell.com.
- 1.2 A Série de Índices de Receitas Verdes da FTSE foi elaborada para aumentar a divulgação das empresas engajadas na transição para uma economia verde.
- 1.3 A Série de Índices de Receitas Verdes da FTSE considera fatores de ESG na elaboração do índice. Veja mais detalhes na Seções 4 e 5.
- 1.4 Preço, retorno total e índices brutos e líquidos serão calculados ao final de cada dia útil.
- Os índices de retorno total incluem o lucro com base em ajustes ex dividendo. Todos os dividendos são aplicados conforme declarado.
- 1.5 Uma série de Índices de Retorno Total Líquidos de impostos também é calculada com base nas taxas máximas de retenção na fonte aplicáveis aos dividendos recebidos por investidores institucionais não residentes no país da empresa remetente e que não beneficiam de tratados de dupla tributação.
- As alíquotas de imposto retido na fonte usadas nos índices brutos estão disponíveis nos seguintes links:
- [Withholding Tax Service](#)
- Consulte também o Guia de Retenção Tributária da FTSE Russell, disponível no seguinte link:
- [FTSE Russell Withholding Tax Guide.pdf](#)
- 1.6 Todos os índices são calculados em dólares norte-americanos e na moeda local. Os valores dos índices são publicados também em euros, libras esterlinas e iene japonês.
- 1.7 **FTSE Russell**
- FTSE Russell é o nome comercial da FTSE International Limited, Frank Russell Company, FTSE Global Debt Capital Markets Limited (e suas subsidiárias FTSE Global Debt Capital Markets Inc. e MTSNext Limited), Mergent, Inc., FTSE Fixed Income LLC, The Yield Book Inc e Beyond Ratings.

- 1.8 Neste documento, a FTSE Russell informa os usuários da Série de Índices sobre a possibilidade de que algumas circunstâncias, como eventos externos fora do controle da FTSE Russell, possam exigir mudanças à Série de Índices ou seu encerramento, e, portanto, que todos os contratos financeiros ou outros instrumentos financeiros que mencionam a Série de Índices ou fundos de investimentos que se valem da Série de Índices para medir seu desempenho devem comportar ou lidar com a possibilidade de tais mudanças à Série de Índices ou com o seu encerramento.
- 1.9 Os usuários do Índice que optarem por seguir esta Série de Índices ou comprar produtos que alegam seguir a Série de Índices devem avaliar os méritos da metodologia baseada em regras do índice e obter consultoria independente para investimentos, antes de investir seus próprios fundos ou os de seus clientes. A FTSE Russell se isenta de qualquer responsabilidade decorrente de negligência ou de outro tipo por perdas, danos, reivindicações e despesas de qualquer pessoa resultantes de:
- valer-se destas Regras básicas; e/ou
 - erros ou imprecisões nestas Regras básicas; e/ou
 - a inobservância ou aplicação incorreta das políticas ou procedimentos descritos nestas Regras básicas; e/ou
 - erros ou imprecisões na compilação da Série de Índices ou dos dados que a compõem



Seção 2

Responsabilidades de gestão

2.0 Responsabilidades de gestão

2.1 FTSE International Limited (FTSE)

2.1.1 A FTSE é o administrador de referência da Série de Índices.¹

2.1.2 A FTSE é responsável pelo cálculo diário, produção e manutenção da Série de Índices de Receitas Verdes FTSE e:

- manterá registros das ponderações de índices de todos os seus integrantes;
- fará alterações nos integrantes e suas ponderações de acordo com as Regras básicas;
- promoverá revisões periódicas da Série de Índices e aplicar as mudanças resultantes das revisões, conforme exigido pelas Regras básicas;
- publicará as mudanças nas ponderações dos integrantes resultantes da manutenção continuada e das revisões periódicas;
- divulgará os índices.

2.1.3 Estas Regras básicas definem a metodologia e apresentam informações sobre a publicação da Série de Índices de Receitas Verdes da FTSE.

2.2 Alterações a estas Regras básicas

2.2.1 Estas Regras básicas estão sujeitas a revisão periódica (pelo menos uma vez por ano) pela FTSE Russell para garantir que sempre reflitam da melhor maneira possível os objetivos da Série de Índices. Todas as propostas para alterações significativas nestas Regras básicas estarão sujeitas à consulta com os comitês consultores da FTSE Russell e demais stakeholders, se apropriado. Os comentários destas consultorias serão considerados pela Comissão de Governança de Produto da FTSE Russel antes de a aprovação ser concedida.

¹ O termo administrador é usado neste documento no mesmo sentido de sua definição no [Regulamento \(UE\) 2016/1011 do Parlamento Europeu e do Conselho de 8 de junho de 2016 sobre os índices usados como referências para instrumentos financeiros e contratos financeiros para medir a performance dos fundos de investimento](#) (Regulamento Europeu de Referência) e [The Benchmarks \(Amendment and Transitional Provision\) \(EU Exit\) Regulations \(As Referências \(Alteração e Disposição Transitória\) \(Saída da UE\) de 2019](#) (Regulamento de Referência do Reino Unido).

2.2.2 Conforme disposto na Declaração de Princípios para FTSE Russell Equity Indexes, na qual a FTSE Russell determina que as Regras básicas são invalidadas ou não se aplicam de forma específica ou inequívoca ao tema de qualquer decisão, uma decisão será fundamentada, na medida em que for prático, na Declaração de Princípios. Após tal determinação, a FTSE Russell informará o mercado de sua decisão o mais breve possível. Este tratamento não será considerado como uma exceção ou mudança às Regras básicas, nem criará um precedente para ação futura, porém, a FTSE Russell considerará se as Regras básicas devem, por conseguinte, ser atualizadas para maior clareza.



Seção 3

Políticas do Índice FTSE Russell

3.0 Políticas do Índice FTSE Russell

Estas Regras básicas devem ser lidas em conjunto com os seguintes documentos de políticas disponíveis nos links abaixo:

3.1 Guia de Métodos de Cálculo do FTSE Global Equity Index

- 3.1.1 O objetivo do guia é descrever como os índices são calculados, facilitar a replicação dos índices para fundamentar suas atividades de investimento e negociação e ajudar os usuários a compreender os fatores que influenciam a performance dos índices.

[FTSE Global Equity Index Series Guide to Calc.pdf](#)

3.2 Guia de ações e eventos societários

- 3.3 Os detalhes completos das mudanças das empresas integrantes devido a ações e eventos societários estão disponíveis no Guia de medidas e eventos societários para índices ponderados para mercado sem teto neste link:

[Corporate Actions and Events Guide for Non Market Cap Weighted Indices.pdf](#)

3.4 Declaração de Princípios para FTSE Russell Equity Indexes (Declaração de Princípios)

- 3.4.1 Os índices devem sempre atualizados com as mudanças do mercado e as Regras básicas não preveem todas as hipóteses. Se as Regras básicas não cobrirem por completo um evento ou desenvolvimento específico, a FTSE Russell determinará o tratamento apropriado de acordo com a Declaração de Princípios que resume o espírito no qual se alicerça a abordagem da FTSE Russell para construir o índice. A Declaração de Princípios é revista a cada ano e todas as mudanças propostas pela FTSE Russell são apresentadas ao Comitê Consultivo de Políticas da FTSE Russell antes da aprovação pela Comissão de Governança de produto da FTSE Russell.

A Declaração de Princípios está disponível no seguinte link:

[Statement of Principles.pdf](#)

3.5 Perguntas e reclamações

- 3.5.1 O procedimento de reclamações da FTSE Russell está disponível no seguinte link:

[Benchmark Determination Complaints Handling Policy.pdf](#)

3.6 **Política do índice para interrupção de pregão e fechamento de mercados**

3.6.1 A orientação para o tratamento de mudanças do índice no caso de interrupções no pregão ou fechamentos de mercados está disponível neste link:

[Index Policy for Trading Halts and Market Closures.pdf](#)

3.7 **Política do índice no caso de clientes serem impedidos de negociar em um mercado**

3.7.1 Os detalhes do tratamento pela FTSE Russell estão disponíveis no seguinte link:

[Index Policy in the Event Clients are Unable to Trade a Market.pdf](#)

3.8 **Política e orientações para recálculo**

3.8.1 A Série de Índices de Receitas Verdes FTSE é recalculada sempre que ocorrerem erros ou distorções que sejam considerados significativos. Os usuários da Série de Índices de Receitas Verdes FTSE são notificados pelos meios apropriados.

Para mais informações, consulte a Política e orientações para recálculo da FTSE Russell, disponível no website da FTSE Russell no link abaixo ou envie um e-mail para info@ftserussell.com.

[Recalculation Policy and Guidelines Equity Indexes.pdf](#)

3.9 **Política para mudanças na metodologia de referência**

3.9.1 Os detalhes da política para mudanças na metodologia de referência da FTSE Russell estão disponíveis no seguinte link:

[Policy for Benchmark Methodology Changes.pdf](#)

3.10 **Quadro de governança da FTSE Russell**

3.10.1 Para supervisionar os índices, a FTSE Russell emprega um quadro de governança que engloba governança de produto, serviço e tecnologia. O quadro incorpora as três linhas de defesa do esquema de gestão de risco do London Stock Exchange Group e foi concebido para atender aos requisitos dos Princípios do IOSCO de benchmarks financeiros², o regulamento europeu de benchmark³ e o regulamento de benchmarks do Reino Unido⁴. Os detalhes do Quadro de Governança da FTSE Russell estão disponíveis no seguinte link:

[FTSE Russell Governance Framework.pdf](#)

² IOSCO Principles for Financial Benchmarks Final Report, FR07/13 julho de 2013

³Regulamento (UE) 2016/1011 do Parlamento Europeu e do Conselho de 8 de junho de 2016 sobre os índices usados como referências em instrumentos financeiros e contratos financeiros ou para aferir a performance dos fundos de investimento.

⁴Regulamentos de Referências (Alteração e Disposição Transitória) (Saída da UE) de 2019



Seção 4

Títulos qualificados

4.0 Títulos qualificados

4.1 Os seguintes Índices de Receitas Verdes FTSE estão disponíveis:

Índice	Índice subjacente	Cronograma de revisão
FTSE All-World Green Revenues Index	FTSE All-World Index	Março, setembro
FTSE Developed Green Revenues Index	FTSE Developed Index	Março, setembro
FTSE Emerging Green Revenues Index	FTSE Emerging Index	Março, setembro
FTSE Asia-Pacific Green Revenues Index	FTSE Asia Pacific Index	Março, setembro
FTSE Europe Green Revenues Index	FTSE Europe Index	Março, setembro
FTSE All Share Green Revenues Index	FTSE All Share Index	Março, setembro
FTSE China Green Revenues Index	FTSE China All Cap Index	Março, setembro
FTSE Japan Green Revenues Index	FTSE Japan Index	Março, setembro
Russell 1000 Green Revenues Index	Russell 1000 Index	Junho, dezembro
Russell 1000 Green Revenues 50 Index	Russell 1000 Index	Junho, dezembro
Russell 2000 Green Revenues Index	Russell 2000 Index	Junho, dezembro
Russell 3000 Green Revenues Index	Russell 3000 Index	Junho, dezembro

Nota: Os índices referentes a Russell US migraram para o novo sistema de classificação do ICB em setembro de 2020 e os índices da FTSE relacionados migrarão em março de 2021.

4.2 Todos os títulos dos integrantes dos índices subjacentes se qualificam para inclusão na Série de Índices de Receitas Verdes FTSE.

4.2.1 A Arábia Saudita recebeu a atribuição de status de mercado Emergente Secundário em março de 2019. Os títulos se qualificam para inclusão na Série de Índices de Receitas Verdes FTSE a partir de setembro de 2019.

4.2.2 As ações A da China (disponíveis no Northbound China Stock Connect Scheme) receberam a atribuição de status de mercado Emergente Secundário em junho de 2019. Os títulos se qualificam para inclusão na Série de Índices de Receitas Verdes FTSE a partir de setembro de 2019.

Seção 5

Inputs de dados de investimento sustentável

5.0 Inputs de Dados de IS

Os seguintes conjuntos de dados de Investimento Sustentável são usados para construir a Série de Índices de Receitas Verdes da FTSE.

5.1 Dados de Receitas Verdes

5.1.1 Outras informações sobre as Receitas Verdes do FSTE estão disponíveis aqui:

<https://www.ftserussell.com/data/sustainability-and-esg-data/green-revenues-data-model>

5.1.2 Os dados de Receitas Verdes são coletados de informações disponíveis publicamente por analistas da FTSE Russell.

5.2 Todos os dados passam por vários níveis de controle de qualidade, inclusive verificações de consistência ao longo do tempo, setoriais e de conhecimento. Ao encontrar discrepâncias, os analistas consultam as fontes de dados primárias.

5.3 A Seção 6 contém outras informações, como definições.

5.4 Outros detalhes dos dados de Investimento Sustentável da FTSE estão disponíveis em:

[Guide to FTSE Sustainable Investment Data used in FTSE Russell Indexes.pdf](#)

5.5 Métricas de Investimento Sustentável

5.5.1 Consulte o site [Métricas de Investimento Sustentável](#) da FTSE Russell quanto a ratings, pontuações e valores dos fatores ambientais, sociais e de governança (ESG) listados no Anexo II do Regulamento Delegado (UE) 2020/1816 que considera a metodologia de referência para as referências nesta Série de Índices.



Seção 6

Dados de Receitas Verdes da FTSE

6.0 Modelo de dados de Receitas Verdes da FTSE

6.1 O modelo de dados de Receitas Verdes da FTSE ajuda os investidores a compreender a transição industrial global para uma economia verde e de baixa emissão de carbono, por meio de dados e índices consistentes e transparentes.

As empresas são analisadas e categorizadas usando uma taxonomia industrial exclusiva para bens, produtos e serviços verdes que cobre 10 setores e 64 subsetores. Para as empresas classificadas em um ou mais subsetores verdes, é fornecida uma porcentagem total da receita de produtos verdes.

6.2 O modelo de dados de Receitas Verdes da FTSE pode ser usado para determinar o grau de exposição das empresas a produtos e atividades sustentáveis.

6.3 O modelo de dados de Receitas Verdes da FTSE foi aprimorado em setembro de 2020 (“Green Revenues 2.0”) **para fornecer** dados de estimativa pontual, usando um modelo de estimativa quantitativo e introduzir um sistema de níveis verdes com base no nível de impacto ambiental líquido.

6.4 Coleta de dados

6.4.1 Para construir o conjunto de dados de Receitas Verdes da FTSE:

6.4.2 As informações são coletadas de relatórios disponíveis publicamente por analistas da FTSE Russell. As empresas são convidadas a fornecer informações mais detalhadas caso o detalhamento de receitas em subsegmentos em seu relatório anual não seja granular o bastante para facilitar a avaliação das receitas verdes.

6.4.3 Para garantir a qualidade, as avaliações de novas receitas verdes são revisadas por analistas seniores, além de serem feitas verificações automatizadas.

6.5 Construção da taxa de Receitas Verdes da FTSE

6.5.1 A taxa de Receitas Verdes da FTSE para uma empresa é a razão das receitas verdes, conforme a classificação pelo Sistema de Classificação de Receitas Verdes da FTSE, em relação à receita total da empresa.

6.5.2 A aplicação das Receitas Verdes da FTSE exclui as áreas de atividade nuclear, definida como a receita dos seguintes subsetores:

- EG06 – Geração de energia nuclear
- EQ06 – Equipamento de energia nuclear

- ER04 – Mineração (com urânio na descrição do subsegmento)
- ER05 – Mineração (com urânio na descrição do subsegmento)

6.5.3 Todos os títulos dos integrantes recebem um valor de taxa de Receitas Verdes da FTSE. A taxa de Receitas Verdes da FTSE para uma empresa pode ser:

- Zero, se uma empresa integrante não tem exposição à economia verde.
- Um valor diferente de zero, quando uma empresa integrante for identificada como geradora de receitas verdes, conforme definição do Sistema de Classificação de Receitas Verdes da FTSE.
- O intervalo mínimo declarado das receitas verdes possíveis, quando uma empresa divulgar informações insuficientes para se ter uma determinação precisa da taxa de receitas FTSE Green.

6.5.4 O Russell 1000 Green Revenues 50 Index aplica a taxa de receitas verdes do modelo de dados FTSE Green Revenues 2.0 e exclui as receitas verdes de atividades do Nível 3.

- As atividades do Nível 3 são definidas como microssetores que apresentam alguns benefícios ambientais, mas, em geral são neutros ou negativos.
- Todas as atividades definidas na Seção 6.5.2 são exemplos de atividades de Nível 3.

6.5.5 Outros índices na Série de Índices de Receitas Verdes FTSE farão a transição para aplicar o modelo de dados FTSE Green Revenues 2.0 e excluem as receitas verdes de atividades do Nível 3 em 2021.

Seção 7

Revisão periódica dos integrantes

7.0 Revisão periódica

- 7.1 A revisão de cada Índice de Receitas Verdes da FTSE, exceto o Russell 1000 Green Revenues 50 Index segue o seguinte processo:
- 7.1.1 Os integrantes com exposição à economia verde por meio de uma gama declarada com um mínimo de receitas verdes zero têm seus pesos de capitalização de mercado investida aumentados em $(1 + GRR_i)$, onde GRR_i é a taxa de Receitas Verdes da FTSE.
- 7.1.2 Os integrantes com exposição à economia verde por meio de uma gama declarada com um mínimo de Receitas Verdes zero retêm seus pesos de capitalização de mercado investida.
- 7.1.3 Os integrantes sem exposição à economia verde têm seus pesos de capitalização de mercado investida reduzidos na proporção da capitalização de mercado investida para refletir a ponderação a maior agregada alcançada na Regra 7.1.1.
- 7.2 No caso de a capitalização de mercado investida agregada de integrantes sem exposição à economia verde ser menor do que a sobreponderação agregada alcançada na Regra 6.1.1, é feito o seguinte ajuste:

Os integrantes com exposição à economia verde por meio de ausência de receitas verdes zero têm seus pesos de capitalização de mercado investida aumentados em $(1 + \alpha \times GRR_i)$, onde α é a taxa que reflete o nível de ponderação maior viável:

$$\alpha = \frac{\sum_{j \in G^*} w_j'}{\sum_{i \in G} w_i' \times GRR_i}$$

onde $w_i'(w_j')$ é o peso de capitalização de mercado das ações $i(j)$ no universo subjacente, G é o conjunto de integrantes com receitas verdes e G^* é o conjunto de integrantes sem receitas verdes.

- 7.2.1 Os integrantes com exposição à economia verde por meio de uma gama declarada com um mínimo de Receitas Verdes zero retêm seus pesos de capitalização de mercado investida.
- 7.2.2 Os integrantes sem exposição à economia verde têm seus pesos de capitalização de mercado investida definidos como zero.
- 7.3 **Revisão do Russell 1000 Green Revenues 50 Index**
- 7.3.1 Todos os integrantes no índice subjacente serão classificados pelo GRR rebaixado do setor a partir do maior para o menor e as 50 principais empresas serão incluídas no índice. Os integrantes com dados GRR ausentes receberão um GRR do setor médio negativo antes da classificação.

7.3.2 Para reduzir a variação e melhorar a estabilidade do índice, será aplicada uma margem de folga de seleção de 10 empresas a cada revisão de índice.

Os integrantes no índice subjacente serão classificados pelo GRR rebaixado em ordem decrescente. Se os integrantes tiverem o mesmo GRR rebaixado do setor, o integrante com maior capitalização de mercado ajustada pela flutuação de mercado da empresa receberá a classificação mais alta. Várias linhas da mesma empresa terão a mesma classificação. As empresas classificadas entre as 40 maiores devem ser incluídas no índice. As empresas existentes não incluídas na etapa anterior com classificação em ou dentro de 60 são adicionadas sucessivamente até o número de empresas atingir 50. Se o número de empresas estiver abaixo de 50 nesta etapa, as empresas restantes no índice subjacente com a maior classificação serão adicionadas até o número de empresas atingir 50.

7.3.3 As 50 empresas selecionadas são ponderadas por peso de capitalização de mercado $\times (1 + \text{GRR})^2$ e os pesos finais são limitados como a seguir:

- Os pesos máximos da empresa são limitados a 10%.
- Os pesos mínimos da empresa são levados para 50 bps se inferiores a 50 bps.
- As diferenças de peso em cada setor entre o índice e o índice subjacente não podem ser maiores de 15%.

7.4 **Datas de revisão**

7.4.1 A revisão dos Índices de Receitas Verdes da FTSE derivados do índice subjacente da FTSE será feita após o encerramento do expediente na terceira sexta-feira do mês de revisão (Tabela 4.1).

7.4.2 A revisão dos Índices de Receitas Verdes da FTSE derivados do índice subjacente da Russell será feita na mesma data da reconstituição anual da Russell em junho e após o encerramento do expediente na terceira sexta-feira no mês de revisão em dezembro (Tabela 4.1).

7.4.3 Para consultar os detalhes das datas dos índices Russell, consulte a Russell U.S. Equity Indexes Construction and Methodology, disponível no link: [Russell-US](#).

7.5 **Datas limite para dados**

7.5.1 As revisões serão feitas com o uso dos preços no encerramento do expediente no último dia útil no mês anterior à revisão do índice, com informações sobre emissão de ações e ajuste livre de flutuação na data efetiva da revisão.

7.5.2 A data limite dos dados para o cálculo da taxa de Receitas Verdes da FTSE é o encerramento do expediente no último dia do mês precedente ao mês da data da revisão.

Seção 8

Mudanças nas empresas integrantes

8.0 Mudanças nas empresas integrantes

8.1 Adições à revisões internas

8.1.1 Adições à FTSE Global Equity Index Series e Russell 3000 Indexes serão consideradas para inclusão nos Índices de Receitas Verdes da FTSE relevantes na próxima revisão do Índice de Receitas Verdes da FTSE relevante.

8.2 Exclusões às revisões internas

Um integrante será removido da Série de Índices de Receitas Verdes FTSE se também for removido de seu índice subjacente correspondente. Se o índice for um Índice de Receitas Verdes da FTSE derivado da Russel, será feita uma notificação com um mínimo de 2 dias de antecedência e seu peso será distribuído pro-rata entre os integrantes restantes no índice relevante. Se o índice for um Índice de Receitas Verdes da FTSE derivado da FTSE, a exclusão será concomitante com a exclusão do índice subjacente e seu peso será distribuído pro-rata entre os integrantes restantes em seu Índice de Receitas Verdes da FTSE.

Seção 9

Medidas e eventos societários

9.0 Medidas e eventos societários

- 9.1 Se um Índice de Receitas Verdes da FTSE tiver um desdobramento de ações, consolidação de ações, emissão dos direitos, emissão de bônus, uma alteração no número de ações em uma emissão ou uma alteração na flutuação livre, o peso do integrante no índice relevante permanece inalterada antes e depois de tal evento.
- 9.2 Os detalhes completos das mudanças das empresas integrantes devido a ações e eventos societários estão disponíveis no Guia de medidas e eventos societários para índices ponderados para mercado sem teto neste link:

[Corporate Actions and Events Guide for Non Market Cap Weighted Indices.pdf](#)

Uma “Medida” societária é uma medida sobre acionistas com uma data ex prescrita. O preço da ação estará sujeito a um ajuste na data ex. Incluem o seguinte:

- 7 Repagamento de capital
- Emissão de direitos/ofertas de direitos
- Conversão de ação
- Desdobramentos (subdivisão)/Desdobramentos reversos (consolidação)
- Emissões de certificados (capitalização ou emissão de bônus)

Um “evento” societário é uma reação a notícias sobre a empresa (evento) que pode impactar um índice dependendo das regras do índice. Por exemplo, se uma empresa anunciar que um acionista estratégico está vendendo suas ações (oferta secundária de ações), isso pode causar uma alteração no peso da flutuação livre no índice. Se for necessário um ajuste do índice, a FTSE Russell enviará um aviso sobre o momento da alteração.

9.3 Incorporações, fusões e cisões

O tratamento de incorporações, fusões e cisões está disponível no Guia de medidas e eventos societários para índices ponderados para mercado sem teto.

9.4 Suspensão do pregão

A suspensão está disponível no Guia de medidas e eventos societários para índices ponderados para mercado sem teto.



Seção 10

Método de cálculo do índice

10.0 Método de cálculo do índice

10.1 Preços

10.1.1 A Série de Índices de Receitas Verdes FTSE usa os preços reais de fechamento do mercado ou último preço negociado, onde houver, para os títulos com cotações do mercado local. Outros detalhes estão disponíveis no seguinte link:

[Closing Prices Used For Index Calculation.pdf](#)

10.2 Frequência de cálculo

10.2.1 A Série de Índices será calculada ao final de cada dia útil.

10.3 Cálculo do índice

10.3.1 A Série de Índices é calculada usando o algoritmo descrito abaixo:

$$\sum_{i=1}^N \frac{(p_i \times e_i \times s_i \times f_i \times c_i)}{d}$$

Onde,

- $i=1,2,\dots,N$
- N é o número de títulos no índice.
- p_i é o último preço negociado do título do integrante (ou o preço no encerramento do índice no dia anterior)
- e_i é a taxa de câmbio necessária para converter a moeda do título na moeda-base do índice.
- s_i é o número de ações em emissão usado pela FTSE Russell para o título, conforme definição nestas Regras básicas.
- f_i é o fator de ponderação para investimento a ser aplicado ao título para se fazer alterações no seu peso, expresso como um número entre 0 e 1, onde 1 representa flutuação livre de 100%. Este fator é publicado pela FTSE Russel para cada título no índice subjacente.
- c_i é o Fator de ponderação para investimento a ser aplicado ao título para ponderar corretamente o título no índice. Este fator mapeia a capitalização de mercado para investimento de cada ação para uma capitalização de mercado conceitual para inclusão no índice.

$$C_i = \frac{\hat{W}_i}{W_i}$$

onde \hat{W}_i são os pesos do índice integrante conforme calculados na Seção 6 e W_i são os pesos do índice de capitalização de mercado para investimento do conjunto qualificado subjacente conforme a data de revisão mais recente.

- d é o divisor, um número que representa o total do capital social emitido no Índice na data-base. O divisor pode ser ajustado para permitir que sejam feitas alterações no capital social emitido de títulos individuais sem distorcer o índice.



Anexo A: Outras informações:

O link a seguir disponibiliza um Glossário dos termos usados nos documentos das Regras básicas da FTSE Russell:

[Glossary.pdf](#)

O site de métricas de investimento sustentável da FTSE Russell encontra-se no seguinte link: [Métricas de Investimento Sustentável](#)

Outras informações sobre a Série de Índices de Receitas Verdes FTSE estão disponíveis na FTSE Russell.

Para contato, visite o site da FTSE Russell ou entre em contato com atendimento ao cliente da FTSE Russell pelo e-mail info@ftserussell.com.

Website: www.ftserussell.com



© 2021 London Stock Exchange Group plc e suas responsabilidades aplicáveis ao grupo (o "LSE Group"). O LSE Group inclui (1) FTSE International Limited ("FTSE"), (2) Frank Russell Company ("Russell"), (3) FTSE Global Debt Capital Markets Inc. e FTSE Global Debt Capital Markets Limited (conjuntamente, "FTSE Canada"), (4) MTSNext Limited ("MTSNext"), (5) Mergent, Inc. ("Mergent"), (6) FTSE Fixed Income LLC ("FTSE FI"), (7) The Yield Book Inc ("YB") e (8) Beyond Ratings S.A.S. ("BR"). Todos os direitos reservados.

A Série de Índices de Receitas Verdes FTSE é calculada por ou em nome da FTSE International Limited ou uma de suas afiliadas, seus agente ou parceiros.

A FTSE International Limited está autorizada e regulamentada pela Financial Conduct Authority como administrador.

FTSE Russell® é um nome comercial da FTSE, Russell, FTSE Canada, MTSNext, Mergent, FTSE FI, YB e BR. "FTSE®", "Russell®", "FTSE Russell®", "MTS®", "FTSE4Good®", "ICB®", "Mergent®", "The Yield Book®", "Beyond Ratings®" e todas as demais marcas e marcas de serviço usadas aqui (sejam elas registradas ou não registradas) são marcas e/ou marcas de serviço de propriedade ou licenciadas para o membro aplicável do LSE Group ou suas respectivas licenciadas e são de propriedade, ou são usadas sob licença pela FTSE, Russell, MTSNext, FTSE Canada, Mergent, FTSE FI, YB ou BR.

Todas as informações são fornecidas exclusivamente para fins de informativos. Foram feitos todos os esforços para garantir que todas as informações fornecidas nesta publicação sejam precisas, no entanto, nenhum membro do LSE Group, nem seus respectivos conselheiros, diretores executivos, empregados, parceiros ou licenciadores aceitam responsabilidade ou responsabilização quanto a erros ou perdas derivadas do uso desta publicação ou das informações ou dados nela contidos.

Nenhum membro do LSE Group ou seus respectivos conselheiros, diretores executivos, empregados, parceiros ou licenciadores fazem qualquer declaração, previsão, garantia ou afirmação de qualquer tipo, expressamente ou implicitamente, seja quanto à precisão, tempestividade, completude, comerciabilidade de qualquer informação ou dos resultados a serem obtidos do uso dos produtos FTSE Russell, incluindo, entre outros, índices, dados e análises, ou o cabimento ou adequação dos produtos FTSE Russell para os fins específicos em que forem empregados.

Nenhum membro do LSE Group ou seus respectivos conselheiros, diretores executivos, empregados, parceiros ou licenciadores fornecem consultoria de investimento e nenhuma disposição neste documento deve ser entendida como consultoria financeira ou de investimento. Nenhum membro do LSE Group ou seus respectivos conselheiros, diretores executivos, empregados, parceiros ou licenciadores fazem qualquer declaração referente à conveniência do investimento em um ativo. A decisão de investir em tal ativo não deve ser tomada tendo por base as informações deste documento. Não é possível investir diretamente nos índices. A inclusão de um ativo em um índice não é uma recomendação para vender, comprar ou reter um ativo. As informações gerais contidas nesta publicação não devem ser usadas sem se obter consultoria jurídica, tributária e de investimento específica de um profissional licenciado.

Nenhuma parte destas informações pode ser reproduzida, armazenada em um sistema de recuperação ou transmitida de qualquer forma ou por quaisquer meios eletrônicos, mecânicos, de fotocópia, gravação ou outros, sem permissão prévia por escrito do respectivo membro do LSE Group. O uso e a distribuição dos dados de índice do LSE Group e o uso de seus dados para criar produtos financeiros requer uma licença da FTSE, Russell, FTSE Canada, MTSNext, Mergent, FTSE FI, YB, BR e/ou seus respectivos licenciadores.

