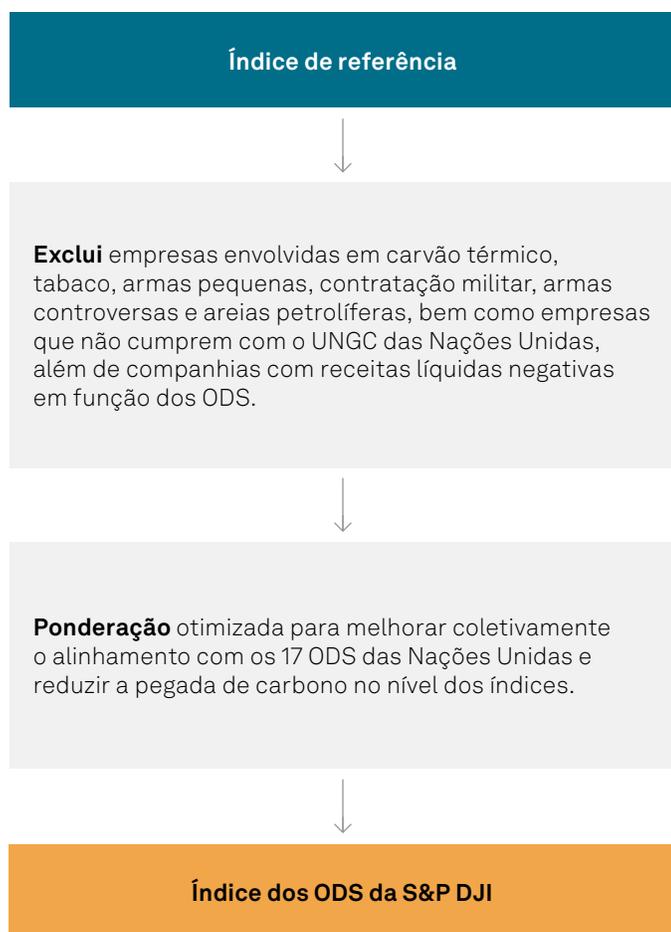


Índices dos ODS da S&P DJI

Os índices dos Objetivos de Desenvolvimento Sustentável (ODS) da S&P DJI visam medir o desempenho de valores de renda variável elegíveis pertencentes aos índices subjacentes, selecionados e ponderados para melhorar coletivamente o alinhamento com os 17 ODS da ONU e reduzir a pegada de carbono no nível dos índices.

Como o índice funciona?



O que diferencia os índices dos ODS?

Dados

A S&P DJI colaborou com um provedor de dados especializado, o Impact Cubed, cujos dados:

- Se alinham aos ODS e são definidos por meio de operações, produtos e serviços das empresas.
- São pormenorizados e abrangem mais de 40.000 emissores e mapas de receita para 2.600 atividades.
- Identificam empresas alinhadas positiva e negativamente aos ODS a respeito de operações de investimento, produtos e serviços.

Abordagem de construção

A metodologia utiliza a otimização glass-box da S&P DJI para minimizar os desvios do índice subjacente e, ao mesmo tempo, integra os ODS e conjuntos de dados de carbono para atingir vários objetivos.

Objetivos do índice

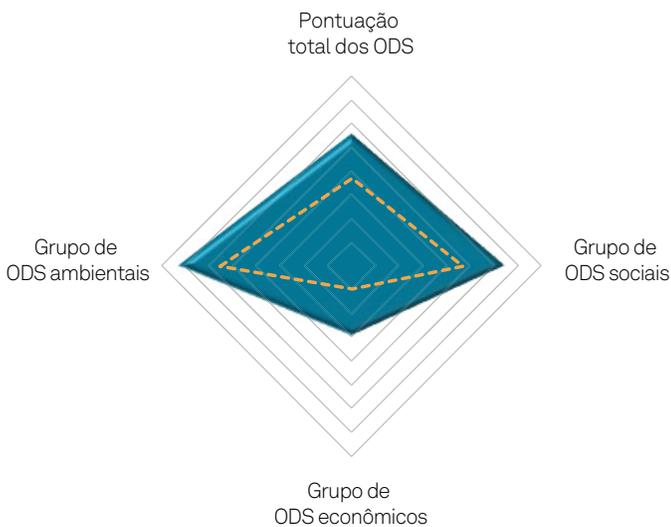
- Alcançar um melhor alinhamento com os ODS do que o índice subjacente por meio das atividades e operações dos componentes.
- Reduzir a quantidade de receita alinhada negativamente aos ODS em relação ao índice subjacente.
- Reduzir a pegada de carbono e a intensidade das emissões de gases de efeito estufa em relação ao índice subjacente.

Os grupos de ODS

Sociedade	Economia	Ambiente
1 Erradicação da pobreza	8 Trabalho decente e crescimento econômico	13 Ação contra a mudança global do clima
2 Fome zero e agricultura sustentável	9 Indústria, inovação e infraestrutura	14 Vida na água
3 Saúde e bem-estar	10 Redução das desigualdades	15 Vida terrestre
4 Educação de qualidade	12 Consumo e produção responsáveis	
5 Igualdade de gênero	17 Parcerias e meios de implementação	
6 Água potável e saneamento		
7 Energia limpa e acessível		
11 Cidades e comunidades sustentáveis		
16 Paz, justiça e instituições eficazes		

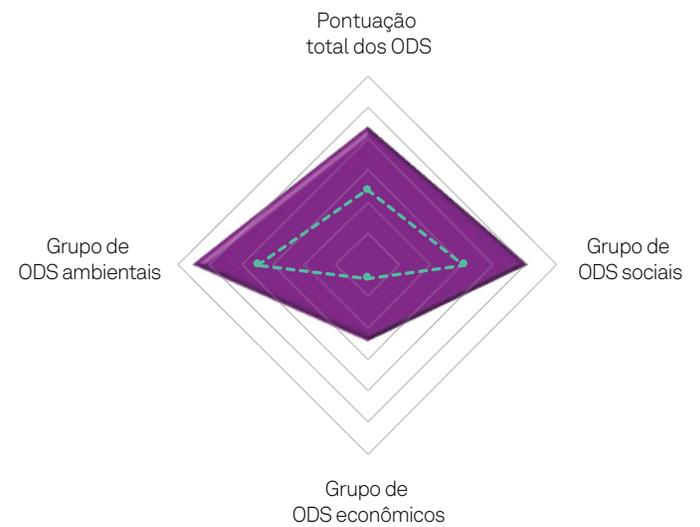
Alinhamento das operações*

S&P 500 SDG Index



— S&P 500® SDG Index
 - - - S&P 500

S&P Global LargeMidCap SDG Index



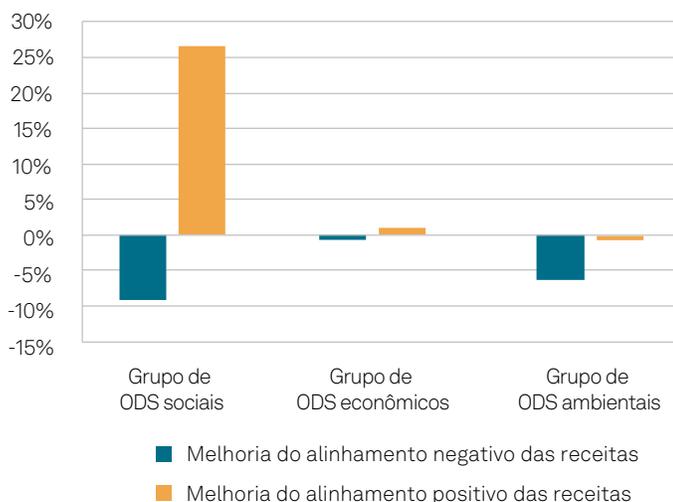
— S&P Global LargeMidCap SDG Index
 - - - S&P Global LargeMidCap Index

*O alinhamento das operações é calculado como a média ponderada das pontuações totais dos ODS ou das pontuações dos grupos de ODS.

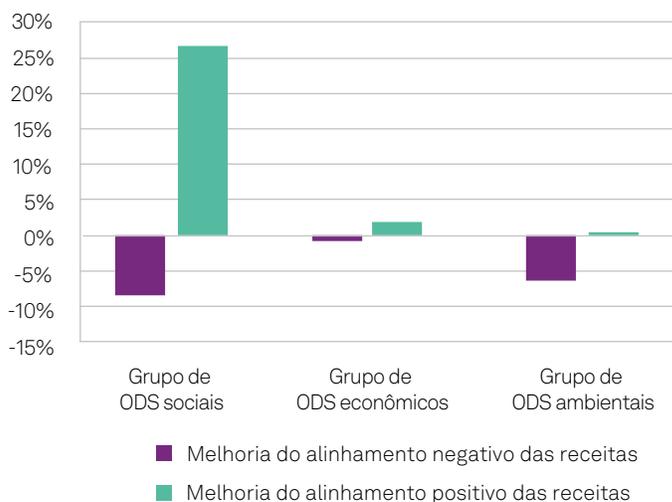
Fonte: S&P Dow Jones Indices LLC. Dados de 17 de novembro de 2023. O S&P 500 SDG Index e o S&P Global LargeMidCap SDG Index foram lançados em 18 de dezembro de 2023. Todos os dados anteriores à data de lançamento são hipotéticos e gerados mediante provas retrospectivas. O desempenho no passado não garante resultados futuros. Os gráficos são fornecidos para efeitos ilustrativos e refletem desempenhos históricos hipotéticos. Confira a Divulgação de desempenho no final do documento para mais informações sobre as limitações inerentes relacionadas ao desempenho gerado a partir de provas retrospectivas.

Alinhamento das receitas**

S&P 500 SDG Index



S&P Global LargeMidCap SDG Index



**O alinhamento das receitas é calculado conforme especificado na metodologia do índice, e a melhoria é a diferença entre o alinhamento das receitas do índice dos ODS da S&P DJI em relação ao índice subjacente. A melhoria individual dos ODS não é visada na metodologia do índice.

Fonte: S&P Dow Jones Indices LLC. Dados de 17 de novembro de 2023. O S&P 500 SDG Index e o S&P Global LargeMidCap SDG Index foram lançados em 18 de dezembro de 2023. Todos os dados anteriores à data de lançamento são hipotéticos e gerados mediante provas retrospectivas. O desempenho no passado não garante resultados futuros. Os gráficos são fornecidos para efeitos ilustrativos e refletem desempenhos históricos hipotéticos. Confira a Divulgação de desempenho no final do documento para mais informações sobre as limitações inerentes relacionadas ao desempenho gerado a partir de provas retrospectivas.

Performance retrospectiva histórica do índice dos ODS frente ao benchmark

Métrica	S&P 500	S&P 500 SDG Index	S&P Global LargeMidCap	S&P Global LargeMidCap SDG Index
Número de componentes	503	331	3.507	1.246
Retorno anualizado de 3 anos (%)	9,8	9,9	6,0	5,7
Desvio padrão de 3 anos (%)	17,5	18,7	16,3	17,2
Retorno ajustado pelo risco de 3 anos	0,56	0,53	0,37	0,33
Alinhamento positivo das receitas aos ODS (%)	28	56	21	50
Alinhamento negativo das receitas aos ODS (%)	17	0	16	0
Pontuação operacional dos ODS	-0,33	-0,16	-0,16	0,03
WACI do escopo 1 e 2***	30,9	9,9	55,9	20,2
WACI do escopo 1, 2 e 3***	297,5	92,8	463,2	192,4
Active share (%)		25		30
Tracking error (%)		2,41		2,01

***WACI é a sigla para média ponderada da intensidade de carbono em inglês.

Fonte: S&P Dow Jones Indices LLC. Dados de 17 de novembro de 2023. Retornos anualizados, desvio padrão e retornos ajustados pelo risco de 30 de novembro de 2023. O S&P 500 SDG Index e o S&P Global LargeMidCap SDG Index foram lançados em 18 de dezembro de 2023. Todos os dados anteriores à data de lançamento são hipotéticos e gerados mediante provas retrospectivas. O desempenho no passado não garante resultados futuros. Esta tabela é fornecida para efeitos ilustrativos e reflete um desempenho histórico hipotético. Confira a Divulgação de desempenho no final do documento para mais informações sobre as limitações inerentes relacionadas ao desempenho gerado a partir de provas retrospectivas.

Sobre a S&P Dow Jones Indices

Na S&P Dow Jones Indices, fornecemos soluções de índices icônicos e inovadores respaldadas por uma experiência inigualável nas diferentes classes de ativos. Ao proporcionar transparência aos mercados de capitais internacionais, ajudamos os investidores em todo o mundo a tomarem decisões com convicção. Somos a maior fonte global de conceitos, dados e pesquisas com base em índices, bem como o lar de indicadores icônicos do mercado financeiro, tais como o S&P 500® e o Dow Jones Industrial Average®. Há mais ativos investidos em produtos baseados nos nossos índices do que nos produtos de qualquer outro provedor de índices no mundo. Com mais de US\$ 8,3 trilhões em ativos de gestão passiva vinculados aos nossos índices e mais de US\$ 8,4 trilhões investidos em referência aos nossos índices, as nossas soluções são amplamente consideradas essenciais para acompanhar o desempenho do mercado, avaliar carteiras e desenvolver estratégias de investimento.

A S&P Dow Jones Indices é uma divisão da S&P Global (NYSE: SPGI). A S&P Global é o maior provedor mundial de classificações de crédito, índices de referência, análises de dados e soluções de fluxo de trabalho nos mercados globais de capitais, commodities e automóveis. Com cada uma das nossas soluções, ajudamos muitas das principais empresas do mundo a se orientarem no cenário econômico para que possam planejar seu futuro hoje. Para mais informações, visite www.spglobal.com/spdji/pt.

CONTATE-NOS

EUA +1-877-325-5415	Japão +81 3-4550-8564
EMEA +44-20-7176-8888	Austrália +61 2-9255-9802
EAU +971(0)4-371-7131	América Latina +52 55-1037-5290
Ásia-Pacífico +86-10-6569-2770	África do Sul +27-11214-1994
Índia +91-22-2272-5312	

© 2024 S&P Dow Jones Indices. Todos os direitos reservados. A redistribuição ou reprodução total ou parcial é proibida sem consentimento por escrito da S&P Dow Jones Indices LLC. S&P, S&P 500, SPX, SPY, The 500, US500, US 30, 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, Select Sector, S&P MAESTRO, S&P PRISM, S&P STRIDE, GICS, SPIVA, SPDR, INDEXOLOGY, iTraxx, iBoxx, ABX, ADBI, CDX, CMBX, LCDX, MBX, MCDX, PRIMEX, TABX, HHPI, IRXX, I-SYND, SOVX, CRITS e CRITR são marcas comerciais registradas da S&P Global, Inc. ("S&P Global") ou suas associadas; DOW JONES é uma marca comercial registrada da Dow Jones Trademark Holdings LLC ("Dow Jones"); e essas marcas comerciais foram licenciadas para uso pela S&P Dow Jones Indices LLC (ou S&P DJI). A S&P Dow Jones Indices LLC, Dow Jones, S&P Global e suas respectivas subsidiárias (coletivamente, "S&P Dow Jones Indices") não entregam nenhuma garantia, explícita ou implícita, sobre a capacidade de quaisquer índices de representar adequadamente a classe de ativos ou setor do mercado que pretende representar e a S&P Dow Jones Indices não será responsável por nenhum erro, omissão ou interrupção de algum índice ou das informações envolvidas. Todos os dados e informações são proporcionados pela S&P DJI "no estado em que se encontram". O desempenho no passado não é indicativo ou uma garantia de resultados no futuro. Confira a Divulgação de Desempenho disponível em www.spglobal.com/spdji/pt/disclaimers/#performance-disclosure para mais detalhes sobre as limitações inerentes relacionadas ao desempenho gerado a partir de backtesting e/ou hipotético. Este documento não constitui uma oferta de serviços. Com exceção de alguns serviços de cálculo de índices customizados, todas as informações fornecidas pela S&P Dow Jones Indices são impessoais e não adaptadas às necessidades de qualquer pessoa, entidade ou grupo de pessoas. A S&P Dow Jones Indices recebe compensação relacionada com o licenciamento de seus índices a terceiros e com os serviços de cálculo customizados. 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 Indices não patrocina, endossa, vende, promove ou gerencia nenhum fundo de investimento ou outro veículo de investimento que seja oferecido por terceiras partes e que procure fornecer um rendimento de investimento baseado no desempenho de qualquer índice. A S&P Dow Jones Indices LLC não é uma consultora de investimentos, de negociação de commodities ou consultora fiscal. A S&P Dow Jones Indices não faz declarações com respeito à conveniência de se investir em qualquer fundo de investimento ou outro veículo de investimento. A S&P Dow Jones Indices 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 Dow Jones Indices podem ter informações que não estejam disponíveis a outras unidades de negócios. Para mais informações sobre os nossos índices, visite www.spglobal.com/spdji/pt.

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.

spglobal.com/spdji/pt