

FTSE Global All Cap Index

Informações sobre o Índice

Descrição do Índice

O FTSE Global All Cap Index é um índice de mercado que mede a performance de uma cesta teórica calculada pela FTSE International Limited ("Índice"). A cesta teórica é composta por ações de emissão de companhias globais de pequeno, médio e grande porte.

O FTSE Global All Cap Index é um índice que faz parte do FTSE Global Equity Index Series, estrutura robusta de índice de patrimônio líquido global com a versatilidade necessária para adequar-se à sua visão de investimento. A série inclui mais de 16.000 (dezesesseis mil) títulos de grande, médio, pequeno e micro cap em 49 (quarenta e nove) mercados desenvolvidos e emergentes em todo o mundo, com uma ampla gama de índices modulares disponíveis para atender a mercados e segmentos de mercado específicos.

Metodologia

A FTSE International Limited oferece uma metodologia de nivelamento consistente e flexível para ajudar os investidores a atender às exigências de concentração e diversificação. A metodologia de nivelamento pode ser aplicada à maioria dos índices FTSE International Limited.

Índices de limite de IRC: Índices ponderados pela capitalização de mercado projetados para limitar a concentração em qualquer título como parte dos requisitos de concentração de Investimento Regulado em Companhias (IRC) para classes de fundos de investimentos registrados nos Estados Unidos da América. Os ativos constituintes são limitados trimestralmente para que não mais que 20% do peso dos índices possa ser alocado a um único constituinte e a soma dos pesos de todos os ativos constituintes que representem mais de 4,5% do índice não deve exceder 48% do peso total do índice. Os atenuadores são utilizados para garantir que os ativos constituintes não violem as metas desejadas.¹

Índices com limites de VICVM: Índices ponderados pela capitalização de mercado destinados a limitar a concentração em qualquer título como parte dos requisitos de diversificação dos Veículos de Investimento Coletivo de Valores Mobiliários (VICVM) para classes de fundos registrados na União Europeia. Estão disponíveis

¹ FTSE Russell. Capped Indexes. Disponível em: <https://www.ftserussell.com/products/indices/capped>. Acesso em 23 de agosto de 2021.

abordagens de limitação de um ou dois níveis para limitar o peso das empresas. Os atenuadores são utilizados para garantir que os ativos constituintes do índice não violem os objetivos desejados.²

A metodologia de nivelamento, que é implementada trimestralmente, visa aderir às exigências de concentração da de Investimento Regulado em Companhias (IRC). A metodologia de nivelamento é aplicada para ajudar os provedores de ETF a cumprir os padrões de listagem contínua dos EUA e fornecer exposição diversificada do índice ao mercado alvo.

	Regras de Investimento Regulado em Companhias (IRC) ³	Índice FTSE Russell	Por que da diferença?
Peso individual do ativo	Limitado a 25%	Limitado a 20%	Reduz a concentração de companhias maiores
Peso agregado dos ativos	Empresas cujo volume de negócios >5% não pode ser superior a 50% no total	Empresas cujo volume de negócios >4,5% não pode ser superior a 48% no total	Fornecer mitigador para evitar que as regras IRC sejam violadas
Regra combinada	25/5/50	20/4.5/48	A implementação da regra combinada reduz a possibilidade de violação da implementação das regras IRC
Frequência de Implementação	Trimestralmente	Trimestralmente, com exceção quando houver IPOs	De acordo com a oportunidade do ativo alvo

Calendário do índice: O índice é revisado semestralmente em Março e Setembro.

Informações

Todas as informações sobre o Índice dispostas neste Regulamento foram obtidas junto à FTSE International Limited e podem ser encontradas na Página do Fundo na rede mundial de computadores

² FTSE Russell. Capped Indexes. Disponível em: <https://www.ftserussell.com/products/indices/capped>. Acesso em 23 de agosto de 2021.

³ FTSE Russel. Capping Approach. Disponível em: <https://www.ftserussell.com/ftse-global-ric-capped-indexes>. Acesso em 23 de agosto de 2021.

(www.investoetf.com/WRLD11), bem como nos materiais de divulgação do Fundo e da Classe. Nem o Fundo, a Classe, o Administrador, a Gestora, ou qualquer outro prestador de serviço que preste serviços ao Fundo e/ou à Classe ou em benefício do Fundo e/ou da Classe, tampouco quaisquer de suas Coligadas, será responsável por qualquer incorreção de tais informações sobre o Índice ou, ainda, por incorreções no cálculo do Índice.