



ANBIMA

Formulário Metodologia ASG

Razão social da instituição Gestora

ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

CNPJ da instituição

Gestora

40.430.971/0001-96

Razão social da instituição Administradora

ITAÚ UNIBANCO S.A.

CNPJ da instituição

Administradora

60.701.190/0001-04

Razão Social do Fundo

IT NOW RUSSELL® 1000 GREEN REVENUES 50 FUNDO DE ÍNDICE
INVESTIMENTO SUSTENTÁVEL

CNPJ do Fundo

41.054.432/0001-62

Qual a categoria do Fundo?

Fundo de Índice (ETF)

Cadastro do Fundo

Tipo de Fundos ASG

IS (Investimento Sustentável)

Detalhar qual é a estratégia de investimento sustentável do fundo.

O fundo aplica seus recursos em ações de empresas listadas nos Estados Unidos que possuem a maior parte da sua receita advinda de produtos ou serviços verdes, conforme classificação de produtos e serviços verdes da FTSE, e de acordo com o índice Russell® 1000 Green Revenues 50.

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.

O Índice Russell® 1000 Green Revenues 50 busca refletir a performance das empresas americanas de elevada capitalização de mercado engajadas na transição para uma economia verde e de baixa emissão de carbono. As empresas são selecionadas dentre as 1.000 empresas norte americanas de maior capitalização de mercado, pertencentes ao índice Russell® 1000 Green Revenues 50, ranqueadas pelo percentual de receita verde (receita proveniente de produtos e serviços que impactam positivamente ou que não produzem impacto no meio ambiente, apurado segundo metodologia proprietária da FTSE Russell). São selecionadas as 50 maiores proporções de receita verde, sendo que quando há empate, ambas as empresas são incluídas.

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.

O índice é ponderado pelo valor de mercado das empresas, ajustado pelo percentual de receita verde. Além disso, há peso máximo de 10% (dez por cento) por empresa, peso mínimo de 0,50% (zero vírgula cinquenta por cento) e limite de diferença por setor de 15% (quinze por cento) em relação ao índice Russell® 1000 Green Revenues 50.

Detalhes sobre a metodologia do índice:

<https://assetfront.arquivosparceiros.cloud.itaubr.com.br/ITN/metodologia-do-indice-REVE11.pdf>

Assinalar qual ou quais aspectos ASG o fundo tem como objetivo de sustentabilidade:

Ambiental

Fundo Temático?

Sim

Preencher qual a temática de investimento que o fundo persegue:

Transição para uma economia verde

Fundo de Impacto?

Não

Assinalar caso o fundo tenha como objetivo uma meta alinhada a algum dos ODS abaixo:

O fundo tem como objetivo perseguir, superar ou replicar índices de sustentabilidade?

Sim

Para selecionar a opção "Não", desmarque todas as opções abaixo.

Qual índice está atrelado ao objetivo do fundo?

Outros

Outros índices

Russell® 1000 Green Revenues 50

Processo de Análise e Seleção de Ativos Sustentáveis

O processo de aquisição deve prever de forma detalhada quais são os critérios utilizados na análise dos ativos e como esses critérios se conectam para deliberar sobre a aquisição de um determinado investimento sustentável que deverá estar alinhado ao objetivo do fundo.

Ao aplicar os critérios ASG é importante ter em mente que o universo de investimento se tornará mais restrito considerando que a tese de sustentabilidade perseguida pelo fundo é fator crucial para a tomada de decisão.

Assinalar todas as metodologias que são utilizadas no processo de seleção e alocação de ativos sustentáveis:

Filtro positivo

Filtro positivo - Descreva de forma detalhada a metodologia de filtro positivo utilizada, informando quais critérios são observados para a aquisição do portfólio do fundo.

O índice ranqueia e seleciona as 50 empresas listadas nos estados unidos que possuem a maior parte de suas receitas advindas de produtos e serviços verdes.

As empresas são selecionadas dentre as 1.000 empresas norte americanas de maior capitalização de mercado, pertencentes ao índice Russell® 1000 Green Revenues 50, ranqueadas pelo percentual de receita verde (receita proveniente de produtos e serviços que impactam positivamente ou que não produzem impacto no meio ambiente, apurado segundo metodologia proprietária da FTSE Russell). São

selecionadas as 50 maiores proporções de receita verde, sendo que quando há empate, ambas as empresas são incluídas.

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.

Detalhamento da metodologia do índice:

<https://assetfront.arquivosparceiros.cloud.itau.com.br/ITN/metodologia-do-indice-REVE11.pdf>

Detalhar quais análises são realizadas na aquisição de ativos remanescentes ou temporários, ou seja, ativos mantidos para fins de liquidez ou hedge, ou ainda aqueles que permanecerão por curto período na carteira em função de movimentação do passivo.

O remanescente de caixa do fundo fica em moeda corrente BRL sem análise ESG (<0,1% do PL)

Considerando que o fundo não possui como objetivo de investimento, os três aspectos ASG. Esclarecer se no processo de análise dos investimentos são considerados os outros aspectos de sustentabilidade (ambiental, social e governança corporativa).

Não

Indicadores

Os fundos IS devem obrigatoriamente ter indicadores quantitativos pré-estabelecidos para monitorar a aderência do investimento ao objetivo. Os indicadores devem ser divulgados aos cotistas, visando transparência em relação às metas estabelecidas.

Para os fundos que integram é facultativo ter indicadores de acompanhamento.

Deverá ser indicada a abrangência do indicador considerando as seguintes premissas:

Emissor - indicadores estabelecidos para um emissor específico.

Classe de Emissores - indicadores estabelecidos para um conjunto de emissores com aspectos e/ou riscos sustentáveis correlatos.

Portfólio - indicador estabelecido para medir de forma consolidada a aderência do fundo à sua meta de sustentabilidade objetivada.

Listagem de indicadores

Tipo de indicador	Descrição	Abrangência	Descrição do Emissor	Descrição da classe	Memória de cálculo	Fonte dos dados	Meta	Periodicidade de avaliação
Ambiental	Taxonomia Verde FTSE	Emissor			N/A	FTSE	Classificar a receita das empresas	Semestral
Ambiental	GRR (Green)	Emissor			N/A	FTSE	50 empresas	Semestral

Revenue
Rate)

com maior
GRR são
selecionadas

Monitoramento

O processo de monitoramento deve prever de forma detalhada quais são os critérios utilizados para acompanhar periodicamente os investimentos e a aderência do ativo ao objetivo do fundo, prevendo como serão tratados os ativos que não contribuirão de forma positiva para o alcance deste objetivo.

Como se dá o processo de monitoramento dos ativos?

Processo de monitoramento dos ativos:	Possui?	Qual a periodicidade realizada no monitoramento dos ativos?
Reavaliação dos critérios avaliados para a aquisição	Sim	Semestral
Acompanhamento dos indicadores ASG	Sim	Semestral
Acompanhamento de mídias e publicações	Sim	Semestral
Acompanhamento de índices	Sim	Semestral
Acompanhamento de ratings	Não	
Análise de DFs, FRE	Não	
Análise de due diligences	Não	

Detalhar com base no item acima, como é realizado o processo de monitoramento dos ativos adquiridos visando garantir o alinhamento ao objetivo sustentável do fundo?

O monitoramento é realizado pela FTSE provedora do índice. Caso as empresas não se qualifiquem através do filtro de receita verde de acordo com a metodologia do índice, essas empresas são excluídas do mesmo e, portanto, do fundo. A revisão do índice é semestral.

Ocorre desinvestimento quando o ativo adquirido apresenta não conformidade e/ou inércia com relação ao objetivo de sustentabilidade?

Sim

Qual período máximo (em dias) para proceder com o desinvestimento?

3

Liste os sistemas e ferramentas utilizados no processo de monitoramento dos ativos:

Tipo	Nome	Razão Social do Fornecedor	CNPJ do Fornecedor	Descrição das funcionalidades
Terceirizado	Modelo de dados de	FTSE Russell	52.492.244/9	modelagem da receita das

Receitas
Verdes da
FTSE

empresas
buscando
categorizar o %
de receita verde

Quais fontes são utilizadas no processo de monitoramento?

Research
Demonstrações financeiras
Outros

Descreva sobre as outras fontes:

Taxonomia Verde FTSE e Green revenue rate (taxa de receita verde) das empresas.

Existe um processo ou relatório de auditoria para averiguar a aderência dos ativos com os objetivos do Fundo?

Não

Engajamento

Os fundos IS devem obrigatoriamente ter um processo de engajamento ativo nas companhias investidas de forma a tentar influenciar na causa sustentável. A participação em assembleia de forma isolada, não é considerada como uma forma de engajamento, uma vez que as regras de autorregulação já exigem o exercício de voto em assembleia. Tampouco o rebalanceamento da carteira será considerado como engajamento, quando este for o único processo aplicado. O que se espera enquanto processo sistemático de engajamento são ações na esfera do emissor do ativo influenciando e engajando a companhia a alcançar e manter os níveis de sustentabilidade almejados.

Assinalar o conjunto de ações que demonstrem o processo sistemático de engajamento nos emissores do ativos investidos

Outros

Descreva sobre outros conjuntos de ações:

O índice Russell® 1000 Green Revenues 50 foi desenvolvido pela FTSE em conjunto com a Itaú Asset Management em uma parceria com o objetivo de viabilizar o investimento nas empresas norte americanas mais avançadas em termos de produtos e serviços verdes. O objetivo é alocar recursos em empresas que são líderes no tema e já materializam em seus balanços receita formal com a venda desses produtos e serviços.

Engajamento continuará sendo realizado periodicamente com o provedor do índice (FTSE) para monitoramento de metodologia e promoção de maior alinhamento aos objetivos do fundo.

Detalhar com base no item acima, como é realizado o processo de engajamento dos ativos adquiridos visando o objetivo sustentável do fundo ou às práticas de integração ASG?

Engajamento realizado com o provedor do índice (FTSE) para monitoramento de metodologia e promoção de maior alinhamento aos objetivos do fundo.

Quando o processo de engajamento se dá também por meio da participação em assembleia, quando a representatividade do fundo ou do gestora for insuficiente para influenciar nas decisões, qual a ação adotada caso a decisão da assembleia for contrária ao voto do gestor?

Por se tratar de investimento internacional em ETF não há possibilidade de exercício do direito de voto.

Limitações

A metodologia utilizada pelo fundo para atingir seu objetivo de sustentabilidade ou a integração de questões ASG, conforme o tipo de fundo ASG, possui algum tipo de limitação, inclusive com relação ao tratamento dos dados e às ferramentas utilizadas?

Não

Transparência

Divulgar, de forma clara, objetiva e atualizada no Material Publicitário do fundo seu objetivo de investimento sustentável ou seu processo de integração de questões ASG e as estratégias e as ações utilizadas para buscar e monitorar esse objetivo, de modo a dar transparência ao investidor.

Considerando o dever acima, informar se o fundo possui material publicitário.

Sim

Informar o link dos materiais publicitários do fundo:

<https://www.itauassetmanagement.com.br/sobre-nos/investimento-responsavel/>

Informar e-mails para recebimento do formulário preenchido:

Email - Obrigatório

vivian.queiroz-pereira@itau-unibanco.com.br

Email - Obrigatório

leticia.a.alves-silva@itau-unibanco.com.br

Email - Opcional

alexandre.gazzotti@itau-unibanco.com.br

Email - Opcional

sofia.fahel@itau-unibanco.com.br



ANBIMA

Ações Continuadas

Razão social da instituição Gestora
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

CNPJ da instituição Gestora
40.430.971/0001-96

Razão social da instituição Administradora
ITAÚ UNIBANCO S.A.

CNPJ da instituição Administradora
60.701.190/0001-04

Agente responsável pela elaboração do relatório
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA

CNPJ do agente responsável pela elaboração do relatório
40.430.971/0001-96

Razão Social do Fundo
IT NOW RUSSELL® 1000 GREEN REVENUES 50 FUNDO DE ÍNDICE

CNPJ do Fundo
41.054.432/0001-62

Informar abaixo o Exercício Social do Fundo, referente às respostas do formulário.
08/2024

Caso o fundo seja de investimento em cotas, informar se o mesmo é espelho:
Não

Referente ao exercício social informado, houve alguma alteração nos indicadores informados no Formulário de Metodologia ASG?
Não

Referente ao exercício social informado, houve identificação de alerta a partir dos monitoramentos informados no Formulário de Metodologia ASG?
Não

Referente ao exercício social informado, houve alguma limitação da metodologia?
Não

Referente ao exercício social informado, houve algum tipo de engajamento sob as empresas investidas no período?
Sim

Engajamento

Data	CNPJ do emissor do ativo engajado	Tipo de engajamento	Motivador	Resultado do engajamento
09/08/2024	68.121.92	Comunicação através de e-mails,	Monitoramento periódico	Engajamento realizado com o provedor do índice (FTSE) para monitoramento de metodologia e promoção

cartas,
telefonemas,
entre outros meios
de comunicação;

de maior alinhamento aos objetivos do fundo.

Referente ao exercício social informado, foram realizados desinvestimentos parciais ou totais na carteira em função de desalinhamento do investimento com o objetivo de investimento sustentável do fundo?

Não

Referente ao exercício social informado, houve conflito de interesse?

Não

Informar e-mails para recebimento do formulário preenchido:

Email - Obrigatório

vivian.queiroz-pereira@itau-unibanco.com.br

Email - Obrigatório

leticia.a.alves-silva@itau-unibanco.com.br

Email - Opcional

alexandre.gazzotti@itau-unibanco.com.br

Email - Opcional

sofia.fahel@itau-unibanco.com.br