



**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**

ITAÚ AÇÕES GLOBAIS ESG INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO SUSTENTÁVEL

**CNPJ do Fundo**

42.737.194/0001-52

### Cadastro do Fundo

**Tipo de Fundos ASG**

IS (Investimento Sustentável)

**Detalhar qual é a estratégia de investimento sustentável do fundo.**

O fundo é indexado ao índice MSCI World SRI Index, que foi projetado para capturar as empresas que são as melhores de seus setores (best in class) em termos de gerenciamento de seus riscos e oportunidades ambientais, sociais e de governança corporativa (ESG).

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

Ambiental

Social

Governança Corporativa

**Fundo Temático?**

Sim

**Preencher qual a temática de investimento que o fundo persegue:**

Investir nas melhores empresas em ESG.

**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?**

Índice MSCI

## **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:**

Best in class

**Best in class - Descreva de forma detalhada a metodologia best in class no contexto do objetivo sustentável do fundo, informando os critérios que são observados para a aquisição do portfólio do fundo.**

Os índices MSCI SRI são construídos aplicando uma combinação de exclusões baseadas em valores e um processo de seleção Best-in-Class para empresas nos índices regionais que compõem o MSCI ACWI, um índice global de ações. Ações de empresas envolvidas em Energia Nuclear, Tabaco, Álcool, Jogos de Azar, Armas Militares, Armas de fogo, OGMs, Carvão Térmico, propriedade de Reservas de Combustíveis Fósseis, extração de Combustíveis Fósseis e Entretenimento Adulto são excluídos do índice. O processo de seleção Best-in-Class é aplicado aos títulos elegíveis restantes no universo de seleção. O índice MSCI SRI possui pesos de setores e regiões alvo consistentes com os dos índices subjacentes para limitar o risco sistemático introduzido pelo ESG processo de seleção. A metodologia visa incluir os títulos de empresas com as mais altas classificações ESG, que representam 25% da capitalização de mercado em cada setor e região dos índices-mãe. Os índices SRI devem ter uma classificação MSCI ESG acima de A e a pontuação MSCI ESG Controversies de 4 ou superior para serem elegíveis. Os atuais constituintes dos índices MSCI SRI devem ter uma classificação MSCI ESG de BB ou superior e a pontuação MSCI ESG Controversies de 1 ou superior para ser elegível. O universo de seleção para os índices MSCI SRI são os constituintes do MSCI Global Investable Market Índices. O Índice é ponderado pela capitalização de mercado ajustada à flutuação.

Detalhamento da metodologia do índice disponível em:

[https://www.msci.com/eqb/methodology/meth\\_docs/MSCI\\_SRI\\_Methodology\\_Feb2021.pdf](https://www.msci.com/eqb/methodology/meth_docs/MSCI_SRI_Methodology_Feb2021.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 USD sem análise ESG

## **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

<b>Tipo de indicador</b>	<b>Descrição</b>	<b>Abrangência</b>	<b>Descrição do Emissor</b>	<b>Descrição da classe</b>	<b>Memória de cálculo</b>	<b>Fonte dos dados</b>	<b>Meta</b>	<b>Periodicidade de avaliação</b>
--------------------------	------------------	--------------------	-----------------------------	----------------------------	---------------------------	------------------------	-------------	-----------------------------------

## 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 contribuírem de forma positiva para o alcance deste objetivo.*

## Como se dá o processo de monitoramento dos ativos?

<b>Processo de monitoramento dos ativos:</b>	<b>Possui?</b>	<b>Qual a periodicidade realizada no monitoramento dos ativos?</b>
Reavaliação dos critérios avaliados para a aquisição	Sim	Anual
Acompanhamento dos indicadores ASG	Sim	Anual
Acompanhamento de mídias e publicações	Sim	Anual
Acompanhamento de índices	Sim	Anual
Acompanhamento de ratings	Sim	Anual
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 MSCI provedora do índice. Caso as empresas não sejam classificadas como best in class de acordo com a metodologia do índice, essas empresas são excluídas do mesmo e, portanto, do fundo. A revisão do índice é anual.

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?

365

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

Tipo	Nome	Razão Social do Fornecedor	CNPJ do Fornecedor	Descrição das funcionalidades

Quais fontes são utilizadas no processo de monitoramento?

Outros

Descreva sobre as outras fontes:

Provedor de índice

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:**

Engajamento realizado pelo provedor do índice. Em caso de má performance o ativo pode ser excluído do índice, o que ocasiona o desinvestimento.

**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 pelo provedor do índice. Em caso de má performance o ativo pode ser excluído do índice, o que ocasiona o desinvestimento.

**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?**

Engajamento realizado pelo provedor do índice. Em caso de má performance o ativo pode ser excluído do índice, o que ocasiona o desinvestimento.

## 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?**

Sim

## Quais limitações da metodologia?

Quais limitações da metodologia?	Possui essa limitação?	Indicar quais as ações e monitoramentos são realizados a respeito dessa limitação?
Não cumprimento do cronograma acordado no respectivo prazo	Não	
Mudanças no nível de comprometimento das companhias investidas com ESG	Não	
Rebaixamento de rating;	Não	
Dificuldade na mensuração dos impactos positivo na sociedade	Não	
Diferentes aspectos ESG podem ter importâncias distintas para diferentes setores ou projetos	Não	
Conflito de interesse na produção dos dados	Não	
Ausência de auditoria para avaliação dos dados e indicadores	Não	
Os dados e indicadores refletem ações passada ou tempestividade no reporte dos dados	Não	
A metodologia do fundo se limita aos indicadores ESG estabelecidos pelo provedor do índice em metodologia específica disponibilizada nas respostas.	Sim	N/A

## 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/insights/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**

**Email - Opcional**