



**ANBIMA**

## Formulário Metodologia ASG

**Razão social da instituição Gestora**

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S/A

**CNPJ da instituição Gestora**

42.040.639/0001-40

**Razão social da instituição Administradora**

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

**CNPJ da instituição Administradora**

00.360.305/0001-04

**Razão Social do Fundo**

FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL ISE - IS

**CNPJ do Fundo**

08.070.838/0001-63

**Qual a categoria do Fundo?**

FIF em Ações

## Cadastro do Fundo

**Tipo de Fundos ASG**

IS (Investimento Sustentável)

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

O objetivo do FUNDO é buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por ativos financeiros de empresas integrantes da carteira teórica do ISE - Índice de Sustentabilidade Empresarial, divulgado pela B3 – Brasil, Bolsa e Balcão, ISE B3, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.

O objetivo de Investimento Sustentável do FUNDO é promover, por meio de investimentos em renda variável que atendam aos critérios da metodologia definida pela B3 para o Índice de Sustentabilidade Empresarial – ISE, aspectos de equilíbrio ambiental e climático, melhora das relações das companhias com seus stakeholders (colaboradores, clientes, fornecedores, sociedade etc.) e/ou de governança corporativa.

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

Ambiental

Social

Governança Corporativa

**Fundo Temático?**

Não

**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?**

ISE - Índice de Sustentabilidade Empresarial

## **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:**

Outros

**Outra metodologia utilizada:**

Replicamos a carteira teórica do ISE da B3.

**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.**

As análises para ativos mantidos para fins de liquidez observam a metodologia de gestão de liquidez aplicado ao fundo considerando projeção de fluxo de caixa baseado em histórico de entradas e saídas, classificação de liquidez que utiliza o histórico de negociação dos ativos no mercado secundário, prazo de cotização e acompanhamento de concentração de volumes por vencimentos, por prazo e por cotistas.

## **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
ASG	Carteira Teórica do ISE B3	Portfólio			N/A	B3	Compor a Carteira Teórica do ISE B3 e manter o comprometimento com a sustentabilidade empresarial	Anual

## 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	Anual
Acompanhamento dos indicadores ASG	Sim	Anual
Acompanhamento de mídias e publicações	Sim	Diária
Acompanhamento de índices	Sim	Diária
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?**

Para verificação da aderência dos ativos que compõem a carteira do ISE da B3, acompanhamos

variações significativas do Score ISE B3, o grau de risco ASG dos emissores e avaliação de notícias que possam gerar impacto significativo.

**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
Proprietário	Rating ASG			Avaliação do grau de risco ASG dos emissores
Terceirizado	Score ISE B3	B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão	0	Acompanhamento e avaliação da variação da pontuação do Score ISE B3
Terceirizado	Bloomberg	Bloomberg Finance LP	0	Dados, Notícias e Controvérsias

**Quais fontes são utilizadas no processo de monitoramento?**

Research

Assesment preenchido pela própria instituição

Sites, jornais e publicações

Outros

**Descreva sobre as outras fontes:**

Site do provedor do índice e informações junto a empresa (exemplo Banco do Brasil).

**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**

Reuniões periódicas com os emissores dos ativos investidos  
Participação ativa nas assembleias (Política de Voto)  
Desinvestimento  
Outros

**Descreva sobre outros conjuntos de ações:**

Reunião junto ao provedor do índice B3.

**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?**

Os engajamentos podem ser realizados junto ao provedor do índice e/ou com as empresas por meio de reuniões e de comunicação eletrônica.

**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?**

Caso a matéria apresente relevância, atuamos por meio de engajamento.

## 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	Sim	Avaliação e levantamento de informações adicionais, podendo levar ao contato com a empresa investida e/ou provedor do índice de referência.
Rebaixamento de rating;	Sim	Avaliação e levantamento de informações adicionais, podendo levar ao contato com a empresa investida e/ou provedor do índice de referência.
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

Sim

Os dados que compõem os indicadores refletem ações passadas, o monitoramento de notícias e comunicação com as empresas busca suprir e atualizar eventuais dúvidas e dados.

## 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.caixa.gov.br/fundos-investimento/fundos-de-acoas/fi-acoas-ise/Paginas/default.aspx>

## Informar e-mails para recebimento do formulário preenchido:

**Email - Obrigatório**

gepin@caixa.gov.br

**Email - Obrigatório**

gerat@caixa.gov.br

**Email - Opcional**

gevar@caixa.gov.br

**Email - Opcional**