



ANBIMA

Formulário Metodologia ESG

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

Qual a estrutura do Fundo?

Monoclasse

Razão Social da Classe

CAIXA GLOBAL BONDS CVP FIGUEIRA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE CLASSE DE FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LONGO PRAZO INVESTIMENTO SUSTENTÁVEL - RESPONSABILIDADE LIMITADA

CNPJ da Classe

60.693.050/0001-23

Qual a categoria da Classe?

FIC

O FIC é espelho?

Não

Cadastro do Fundo

Tipo de Classe ASG

IS (Investimento Sustentável)

Detalhar qual é a estratégia de investimento sustentável da classe.

A CLASSE investe em fundos de investimento sustentável que aloquem em títulos de dívida externa sustentáveis de emissão privada e/ou pelo governo brasileiro que gerem benefícios ambientais, climáticos e/ou sociais positivos.

Assinalar qual ou quais aspectos ASG a classe tem como objetivo de sustentabilidade:

Ambiental

Social

Classe Temática?

Não

Classe de Impacto?

Não

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

A classe tem como objetivo perseguir, superar ou replicar índices de sustentabilidade?

Não

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 da classe.

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 pela classe é fator crucial para a tomada de decisão.

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

Due diligence/ Assessment

Due diligence/ Assessment - Descreva de forma detalhada o processo de due diligence realizado, informando quais critérios são observados para a aquisição do portfólio da classe.

Os fundos selecionados são fundos de investimento sustentável que buscam promover boas práticas e benefícios ambientais, climáticos e/ou sociais positivos por meio de investimentos em títulos sustentáveis. Para atingimento deste objetivo os fundos de investimento são avaliados e selecionados segundo seus objetivos, metodologias e processos de investimento sustentável. A gestora de investimento passa por avaliação quanto às suas práticas como companhia e de gestão de investimento responsável. As carteiras de ativos que compõem os fundos de investimento alocados são acompanhadas mensalmente quanto ao cumprimento dos seus objetivos de investimento sustentável.

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.

Considerando que a classe 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).

Sim

Considerando a resposta apresentada no item anterior, caso o ativo apresente alinhamento ao objetivo da classe, porém possua controvérsias e riscos relacionados aos demais aspectos ASG, assinalar se referido investimento poderá ser adquirido pela classe:

Não

Considerando a possibilidade de investimento em ativos que possuam controvérsias em aspectos ASG não ligados diretamente ao objetivo da classe, detalhar os critérios de decisão para o investimento, bem como quais procedimentos e métricas de acompanhamento são estabelecidos:

Como a CLASSE investe por meio de fundos de investimento sustentáveis, o tratamento de controvérsias ASG concentra-se na avaliação e acompanhamento dos fundos investidos e das gestoras externas responsáveis, que considera, inclusive, as controvérsias referentes a governança. Este acompanhamento é realizado considerando os processos ASG internos, como avaliações de notícias, ratings ASG e

acompanhamento das gestoras. Avaliações que observem o agravamento das controvérsias ou falhas na resposta da gestora podem levar a ações de engajamento, reavaliação, desinvestimento e/ou restrição de aportes.

Informar como é dada a transparência aos investidores da classe a respeito dos possíveis impactos sustentáveis atrelados aos demais aspectos ASG do ativo para além daquele alinhado ao objetivo da classe.

Os possíveis impactos ASG identificados são comunicados por meio do formulário de monitoramento de ações continuadas do fundo de investimento, modelo da ANBIMA, disponibilizada no site da gestora.

Indicadores

As classes 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 as classes 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	acompanhamento dos fundos investidos quanto ao alinhamento do objetivo de investimento sustentável					carteira do fundo de investimento fornecido pela gestora		Mensal
ASG	acompanhamento das gestoras investidas					formulário de acompanhamento respondido		Anual

pela gestora

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 da classe, 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?

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

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

As carteiras dos fundos investidos são acompanhadas por meio de notícias e quanto ao cumprimento de seus objetivos de investimento sustentável. Os gestores de investimento são acompanhados por meio de processo de avaliação de investimento responsável em seus processos.

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?

360

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	due diligence do processo de investimento responsável da			avaliação dos processos do gestor em relação a

	gestora do processo de investimento responsável gestora	investimento responsável
Proprietário	modelo de avaliação de notícias dos emissores alocados nos fundos de investimento	monitoramento de notícias dos ativos/emissores investidos nos fundos de investimento

Quais fontes são utilizadas no processo de monitoramento?

Assesment preenchido pela própria instituição
Sites, jornais e publicações

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

Não

Engajamento

As classes 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

Desinvestimento
Outros

Descreva sobre outros conjuntos de ações:

O acompanhamento dos objetivos dos fundos de investimento é realizado juntamente com as gestoras e a ação de engajamento ocorre quando identificado que a carteira não esteja alinhada ou quando for identificada alguma controvérsia.

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

Por se tratar de um fundo que investe em cotas de fundos, o engajamento será realizado com as gestoras investidas. O acompanhamento dos objetivos dos fundos de investimento é realizado juntamente com as gestoras e a ação de engajamento ocorre quando identificado que a carteira não esteja alinhada ou quando for identificada alguma controvérsia nos ativos alocados pelas gestoras. O contato com as gestoras poderá ser realizado por meio de reuniões e comunicação por e-mail, podendo resultar em desinvestimento caso não haja alinhamento quanto às ações identificadas.

Quando o processo de engajamento se dá também por meio da participação em assembleia, quando a representatividade da classe ou da gestora for insuficiente para influenciar nas decisões,

qual a ação adotada caso a decisão da assembleia for contrária ao voto do gestor?

Não é o caso.

Limitações

A metodologia utilizada pela classe para atingir seu objetivo de sustentabilidade ou a integração de questões ASG, conforme o tipo de classe 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	Sim	Interações com a gestora para a disponibilização da carteira dos fundos de investimento.
Mudanças no nível de comprometimento das companhias investidas com ESG	Sim	O acompanhamento de notícias busca identificar estas mudanças.
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	

Transparência

Divulgar, de forma clara, objetiva e atualizada no Material Publicitário da classe 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 a classe possui material publicitário.

Não

Considerando o dever de dar transparência aos investidores e o fato de que a classe não possui Material Publicitário, informar o link onde constam disponíveis as informações sobre estratégia e ações ASG da classe.

<https://www.caixa.gov.br/caixa-asset/Paginas/default.aspx>

Informar e-mails para recebimento do formulário preenchido:

Email - Obrigatório

gepin@caixa.gov.br

Email - Opcional

gecat@caixa.gov.br

Email - Obrigatório

gefes@caixa.gov.br

Email - Opcional

gecat05@caixa.gov.br