



ANBIMA

Formulário Metodologia ESG

Razão social da instituição Gestora

BLACKROCK BRASIL GESTORA DE INVESTIMENTOS LTDA.

CNPJ da instituição Gestora

10.979.208/0001-58

Razão social da instituição Administradora

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

CNPJ da instituição Administradora

01.522.368/0001-82

Qual a estrutura do Fundo?

Monoclasse

Razão Social da Classe

ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE (ICO2) BRASIL IS CLASSE DE ÍNDICE - RESPONSABILIDADE LIMITADA

CNPJ da Classe

15.562.377/0001-01

Qual a categoria da Classe?

Fundo de Índice (ETF)

Cadastro do Fundo

Tipo de Classe ASG

IS (Investimento Sustentável)

Detalhar qual é a estratégia de investimento sustentável da classe.

seguimento de índice subjacente com filtros que privilegiam a eficiência em emissão de gases de efeito estufa, conforme definido pela metodologia do índice.

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

Ambiental

Classe Temática?

Não

Classe de Impacto?

Não

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

ODS 17 – Parcerias e meios de implementação

A classe 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 da classe?

Outros

Outros índices

ÍNDICE CARBONO EFICIENTE (ICO2) BRASIL

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:

Análises quantitativas

Filtro negativo

Análises quantitativas - Descreva de forma detalhada a análise quantitativa realizada no contexto do objetivo da classe, informando os indicadores que são observados para a aquisição do portfólio da classe e a memória de cálculo, quando aplicável.

O objetivo do ICO2 B3 é ser um indicador do desempenho médio dos preços dos ativos pertencentes à carteira do índice IBrA B3 - Índice Brasil Amplo - que se destacam pelos seus melhores coeficientes de emissão de Gases de Efeito Estufa (GEE) e pela adoção de práticas de gestão que conduzam a uma maior eficiência nessas emissões, contribuindo para o avanço da transição energética. Mais informações sobre o índice ICO2 disponíveis em https://www.b3.com.br/pt_br/market-data-e-indices/indices/indices-desustentabilidade/indice-carbono-eficiente-ico2-b3.htm

Filtros negativos - Envolve a exclusão de oportunidades de investimento com base na aplicação de filtro.

Outros

Outros filtros negativos

Empresas são excluídas do índice ao deixar de reportar dados de seu inventário anual de GEE de acordo com o nível de abrangência e prazo definidos pela B3.

Descreva como as diferentes práticas são integradas na metodologia de análise para aquisição de ativos sustentáveis.

Critérios já embutidos na metodologia do índice subjacente.

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.

N/A - o ETF investe no mínimo 95% em empresas integrantes do índice ICO2, e tanto a regulação aplicável quanto o Regulamento do Fundo limitam o leque de investimentos elegíveis para os 5% remanescentes.

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).

Não

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
Ambiental	Ponderações de acordo com razão Emissão de GEE / Receita	Portfólio			Metodologia do Índice	Metodologia do Índice	N/A	Trimestral

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 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	Não	
Acompanhamento dos indicadores ASG	Não	

Acompanhamento de mídias e publicações	Não	
Acompanhamento de índices	Não	
Acompanhamento de ratings	Não	
Análise de DFs, FRE	Não	
Análise de due diligences	Não	
Monitoramento do Índice Subjacente	Sim	Semestral

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?

Os ativos em si não são monitorados, dado que a Gestora não tem discricionariedade para investir; a análise se dá quanto à metodologia do índice, verificando-se se esta ainda atende a algum objetivo ligado à sustentabilidade.

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?

10

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	Aladdin			Sistema de gestão de portfólios e riscos proprietário.

Quais fontes são utilizadas no processo de monitoramento?

Outros

Descreva sobre as outras fontes:

Metodologia do índice ICO2.

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

Outros

Descreva sobre outros conjuntos de ações:

Conferência semestral da metodologia do índice ICO2.

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?

N/A

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?

N/A

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	Não	
Mudanças no nível de comprometimento das companhias investidas com ESG	Sim	Metodologia do índice retira o peso da empresa e a Classe conseqüentemente reduz posição no ativo.
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	Não	

dados

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 obrigatoriedade de compor a carteira da Classe com, pelo menos, 95% de seu patrimônio em ativos que compõem o índice de referência, e a consequente impossibilidade de a gestora promover inclusões e/ou exclusões na carteira da Classe em razão de critérios ESG adicionais. Sim N/A - característica de um Fundo de Índice.

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.

Sim

Informar o link dos materiais publicitários da classe:

<https://www.blackrock.com/br/products/251711/ishares-ndice-carbono-eficiente-ico2-brasil-fundo-de-ndicefund>

Informar e-mails para recebimento do formulário preenchido:

Email - Obrigatório

alexí.atçabahan@blackrock.com

Email - Obrigatório

fabio.arnoni@br.bnpparibas.com

Email - Opcional

Email - Opcional