



**ANBIMA**

## Formulário Metodologia ASG

**Razão social da instituição Gestora**

XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA.

**CNPJ da instituição Gestora**

37.918.829/0001-88

**Razão social da instituição Administradora**

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S/A

**CNPJ da instituição Administradora**

01.522.368/0001-82

**Razão Social do Fundo**

AVIVA INVESTORS GLOBAL CREDIT INTEGRATED DOLAR ADVISORY  
MASTER FIM CRÉDITO PRIVADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR

**CNPJ do Fundo**

37.979.956/0001-97

**Qual a categoria do Fundo?**

Fundo de Investimento Multimercado

## Cadastro do Fundo

**Tipo de Fundos ASG**

Integra questões ASG

**Descreva em linhas gerais a metodologia adotada referente ao compromisso do fundo de integrar questões ASG.**

O fundo tem como objetivo alocar preponderantemente em cotas do fundo internacional Aviva Investors Global High Yield Bond Fd I USD Cap, que por sua vez, aloca em High Yield Bonds emitidos por empresas de qualquer parte do mundo, com ênfase na América do Norte e na Europa. O processo de investimento do investido integra questões ESG, em que o Gestor leva em consideração critérios ambientais, sociais e de governança em sua decisão de alocação.

O fundo investido tem como índice de referência o Bloomberg Global High Yield Excl CMBS & EMG 2% Cap, bem como persegue a regulamentação Europeia, sendo classificado como Artigo 8º, conforme descrição no site da Gestora: Aviva Investors Global High Yield Bond Fund I USD Acc | LU0367993663.

**Assinalar qual ou quais aspectos ASG o fundo tem como compromisso de integração ASG:**

Ambiental

Social

Governança Corporativa

**Assinalar caso o fundo tenha como prática de integração o alinhamento com algum/uns dos ODS abaixo:**

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

Não

## Processo de Análise e Seleção de Ativos Sustentáveis

*Informar os critérios de seleção de investimentos e a alocação de ativos de acordo com a avaliação de suas características ASG.*

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

Conferência de fontes públicas  
Utilização de ratings externos  
Outros

**Conferência de fontes públicas - Descreva quais dados públicos são primordiais para análise dos ativos e como são integrados à metodologia de seleção e aquisição de ativos.**

A validação da classificação do ativo segundo a perseguição do artigo 8º, da Regulação SFDR.

**Qual agência de rating ou fornecedor é contratado para o fornecimento do rating? - O rating ASG quando fornecido por agência classificadora de risco, deve ser utilizado como informação adicional à avaliação dos critérios ASG e não como condição suficiente para sua aquisição e monitoramento.**

Outros

**Outro Rating Externo**

Acompanhamento da Regulação europeia SFDR

**Outra metodologia utilizada:**

N/A

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

A alocação do ativo será baseada na sua classificação, segundo a Regulação europeia SFDR.

**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.**

Poderão ser adquiridos apenas cotas de fundos de zeragem.

## 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.*

**O fundo possui indicador de acompanhamento do processo de integração ASG?**

Não

**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.

## 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	Não	
Acompanhamento dos indicadores ASG	Não	
Acompanhamento de mídias e publicações	Sim	Anual
Acompanhamento de índices	Não	
Acompanhamento de ratings	Não	
Análise de DFs, FRE	Sim	Anual
Análise de due diligences	Sim	Anual

**Detalhar com base no item acima, como os fatores ASG são integrados no processo de monitoramento dos ativos adquiridos.**

O monitoramento se dá pela verificação periódica da classificação do fundo investido, classificado como Artigo 8º, pela Regulamentação SFDR.

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

Não

Para seleccionar a opção "Sim", desmarque todas as opções abaixo.

**Informar quais as ações adotadas e prazo máximo permitido para a manutenção do ativo nessas condições na carteira do fundo?**

Comunicação aos investidores do fundo

Outros

**Descreva sobre outros procedimentos:**

Considerando ser um fundo com estratégia voltada a temática de integrar questões de sustentabilidade,

caso o fundo deixe de ser classificado como Artigo 8º pela regulação Europeia, prosseguiremos com o ajuste do objetivo do nosso fundo localmente, devendo tal mudança ser comunicada aos cotistas de forma tempestiva.

**Detalhar as ações acima assinaladas e o prazo máximo permitido para a manutenção do ativo na carteira do fundo.**

Imediato.

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

<b>Tipo</b>	<b>Nome</b>	<b>Razão Social do Fornecedor</b>	<b>CNPJ do Fornecedor</b>	<b>Descrição das funcionalidades</b>
Terceirizado	Site do Gestor	Aviva Investors	00.000.000/0000-00	Acompanhamento dos relatórios e informações do fundo investido.

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

Agências de Ratings  
Demonstrações financeiras  
Sites, jornais e publicações

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

Não

## **Engajamento**

*Para os fundos que integram é facultativo possuírem processos de engajamento junto aos emissores dos ativos.*

**Possui processo de engajamento junto aos emissores do ativos investidos?**

Não

## **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.**

Não

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

<https://www.xpasset.com.br/fundos/aviva-investors-global-credit-esg-integrated-dolar-advisory/>

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

**Email - Obrigatório**

controles@xpasset.com.br

**Email - Obrigatório**

aloc@xpasset.com.br

**Email - Opcional**

camila.monteiro@xpasset.com.br

**Email - Opcional**

camila.monteiro@xpasset.com.br