



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
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.

CNPJ da instituição Administradora
02.201.501/0001-61

Razão Social do Fundo
TREND AGUA TECH FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO IS

CNPJ do Fundo
42.403.085/0001-07

Qual a categoria do Fundo?
Fundo de Investimento Multimercado

Cadastro do Fundo

Tipo de Fundos ASG
IS (Investimento Sustentável)

Detalhar qual é a estratégia de investimento sustentável do fundo.

O fundo possui de investimento no ETF Invesco Water Resources ETF, o qual persegue o NASDAQ OMX US Water Index (Índice), que por sua vez é composto por uma cesta de empresas que oferecem produtos e soluções tecnológicas para conservar e purificar a água para residências, empresas e indústrias, assim como o uso responsável.

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:

ODS 6 – Água potável e saneamento

O fundo 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 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:

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.

O monitoramento se dá pela verificação periódica da aderência do ETF investido ao objetivo pretendido.

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

Gestor: <https://www.invesco.com/us/financial-products/etfs/product-detail?audienceType=Investor&ticker=PHO>

Outra metodologia utilizada:

Acompanhamento da aderência do ETF investido ao índice alvo.

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

N/A

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, assim como a realização de operações com derivativos.

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

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?

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	Sim	Anual
Análise de DFs, FRE	Sim	Anual
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 se dá pela verificação periódica da aderência do ETF investido ao índice alvo.

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

Não

Para selecionar 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 tecnologia da água, perseguida bem índice alvo do ETF investido, caso o fundo investido deixe de acompanhá-lo, 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:

Tipo	Nome	Razão Social do Fornecedor	CNPJ do Fornecedor	Descrição das funcionalidades
Terceirizado	Terceirizado	Invesco Distributors, Inc.	00.000.000/000	Acompanhamento dos relatórios e informações do índice alvo.

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

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:

N/A

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?

N/A

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?

N/A

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.

Sim

Informar o link dos materiais publicitários do fundo:

<https://www.xpasset.com.br/fundos/trend-agua-tech/>

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.wanous@xpasset.com.br