



ANBIMA

Formulário Metodologia ASG

Razão social da instituição Gestora

Santander Brasil Gestão de Recursos Ltda

CNPJ da instituição Gestora

10.231.177/0001-52

Razão social da instituição Administradora

SANTANDER DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

CNPJ da instituição Administradora

03.502.968/0001-04

Qual a estrutura do Fundo?

Monoclasse

Razão Social da Classe

SANTANDER PREV ETHICAL 70 SUSTENTABILIDADE IS MULTIMERCADO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

CNPJ da Classe

34.246.384/0001-49

Qual a categoria da Classe?

FIF em Ações

Cadastro do Fundo

Tipo de Classe ASG

IS (Investimento Sustentável)

Detalhar qual é a estratégia de investimento sustentável da classe.

O fundo tem como objetivo alocar recursos em empresas que demonstram consideração por práticas sociais e/ou ambientais. Além disso, busca por empresas que, por iniciativa própria, implementem boas práticas de governança corporativa. Entende-se que:

Práticas Sociais: constituem práticas e políticas internas e externas formuladas e implementadas por empresas que evidenciam a sua preocupação e o envolvimento com aspectos sociais, tais como, mas não limitados a relações de trabalho, relações com a comunidade, relações com seus clientes e/ou consumidores.

Práticas para Proteção do Meio Ambiente: constituem práticas e políticas internas e externas formuladas e implementadas por empresas que evidenciam a sua preocupação e os esforços no cuidado e proteção do meio ambiente.

Boas Práticas de Governança Corporativa: constituem práticas diferenciadas de governança corporativa relacionadas às políticas de uma empresa, código de ética, ouvidoria interna, compliance, ações anticorrupção, entre outros.

Os emissores serão elegíveis a compor a carteira quando suas atividades estiverem explicitamente alinhadas a qualquer conjunto das Práticas, contanto que no curso de suas atividades não seja identificado prejuízo em relação às demais Práticas com os quais não se alinhem explicitamente. No

processo de seleção de emissores e ativos, o Gestor seguirá os seguintes critérios:

- Exclusões de acordo com a política de riscos socioambientais e climáticos do Grupo Santander
- Exclusões de setores sensíveis e/ou ativos com envolvimento em controvérsias
- Seleção Best in Class: Identificação dos emissores mais bem colocados na escala de pontuação de metodologia ESG própria adotada pela Gestora.
- Engajamento.

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

Ambiental

Social

Governança Corporativa

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?

Sim

Para selecionar a opção "Não", desmarque todas as opções abaixo.

Qual índice está atrelado ao objetivo da classe?

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 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:

Best in class

Filtro negativo

Desenvolvimento de rating ASG interno

Best in class - Descreva de forma detalhada a metodologia best in class no contexto do objetivo sustentável da classe, informando os critérios que são observados para a aquisição do portfólio da classe.

Os filtros best-in-class são propostos por meio dos resultados da metodologia proprietária da SAM. Utilizamos dois scores resultantes do processo de análise: o score absoluto de cada companhia e o seu score relativo, que a compara com os pares de seu setor. A combinação dos dois scores é apresentada em uma matriz, que nos indica os quartis dos scores ESG combinados. 20% dos emissores com baixo

desempenho no "Sustainability Rating", rating que compara o emissor com os do mesmo setor, serão excluídos.

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

Indústria Armamentícia

Indústria do carvão (mineração e geradores de energia)

Tabaco

Trabalho escravo

Trabalho infantil

Desenvolvimento de rating ASG interno - Descreva quais dados, métricas e indicadores são utilizados para a definição do rating interno, bem como a memória de cálculo para a definição do score.

O rating ESG interno é calculado por meio da aplicação da base de dados fornecida pelo provedor externo Clarity AI. Os indicadores utilizados são coletados de acordo com grupos de impacto em cada uma das dimensões: ambiental, social e de governança corporativa, sendo Ambiental: 11 grupos de impacto sobre 5 temas (Estratégia ambiental, mudanças climáticas, gestão de recursos naturais, prevenção e controle de poluição e habitats naturais), o Social: 15 grupos de impacto sobre 4 temas (Capital humano, Clientes e Produtos, Relações com comunidades e produtos e serviços sociais) e a Governança: 8 grupos de impacto sobre 2 temas (Governança corporativa e ética nos negócios). A metodologia leva em conta as controvérsias dos emissores e foi construída com base em acordos e normas internacionais. A memória de cálculo dos scores é de propriedade da SAM e todos a base de dados com os scores é compartilhada via planilha e plataforma Alladin com os times ESG e Gestão.

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

As diferentes análises são integradas de acordo com a estratégia do fundo, ou seja, utilizamos dois scores resultantes do processo de análise: o score absoluto de cada companhia e o seu score relativo, que a compara com os pares de seu setor. A combinação dos dois scores é apresentada em uma matriz, que nos indica os quartis dos scores ESG combinados. Além disso, aplicamos filtro de exclusão para setores sensíveis, grupos econômicos de acordo com a Política de riscos socioambientais e climáticos do Grupo Santander e controvérsias. Além disso, o portfólio tem um score mínimo médio ≥ 55 (número que vai de 0-100, oriundo da metodologia própria).

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.

O time Global ESG da SAM coordena o Comitê LATAM ESG, que ocorre mensalmente. Nesta reunião, são apresentados os resultados dos fundos LATAM, com a análise dos scores ESG por fundo, critérios de exclusão e alinhamento com as estratégias de investimentos. Neste comitê são avaliadas as carteiras de cada fundo, e os gestores são responsáveis por esclarecer as posições de cada fundo, incluindo a aquisição de ativos remanescentes ou temporários. O time Global ESG recomenda os ajustes necessários, nos prazos acordados com os gestores, quando aplicável. Além disso, o time de riscos apresenta todo o monitoramento dos fundos, informando se está desenquadrado ou 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
ASG	Score - Rating ESG Mínimo	Portfólio				Clarity AI e metodologia própria SAM	=> 55	Mensal
ASG	Alinhamento ao mandato ESG	Portfólio				Clarity AI e metodologia própria SAM	> 70%	Mensal
ASG	Alinhamento investimento sustentável (SFDR)	Portfólio				Clarity AI e metodologia própria SAM	5-10%	Mensal
ASG	Exclusão dos piores emissores de acordo com o score Sustainability Rating	Portfólio				Clarity AI e metodologia própria SAM	20%	Mensal

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	Mensal
Acompanhamento de índices	Não	
Acompanhamento de ratings	Sim	Mensal
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 da classe?

O departamento de riscos realiza o monitoramento contínuo de desenquadramento dos fundos. Desse modo, caso haja desenquadramento, os desenquadramentos são informados via comitê global Latam e informado via e-mail para tomada de ação.

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?

30

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	Scores ESG SAM			Planilha Excel
Proprietário	Scores ESG SAM			Alladin

Quais fontes são utilizadas no processo de monitoramento?

Agências de Ratings
Sites, jornais e publicações
Outros

Descreva sobre as outras fontes:

Para "Outros", utilizamos a base de dados do provedor externo Clarity AI que incorpora a metodologia ESG do Santander Asset Management. Os dados são monitorados via Aladdin, plataforma utilizada pela SAM.

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 dos ativos investidos

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

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?

O processo de engajamento do Santander Asset Management depende do interlocutor, tipo e do tema/objetivo:

Olhando para o engajamento onde o interlocutor são companhias investidas, ou seja, engajamento com emissores nos quais a SAM investe para entender em primeira mão sobre seu desempenho ESG e/ou promover melhores práticas, podendo incluir ações de diálogo sobre o desempenho global dos emitentes ou o envolvimento em tópicos específicos (por exemplo, clima mudanças, controvérsias, etc.) temos dois tipos:

- a. Individual: A SAM entra em contato diretamente com a companhia.
- b. colaborativo: Engajamento através de grupos de investidores.

Para ambos os tipos, é traçado objetivo para o engajamento, podendo ser sobre:

- (i) transparência e desempenho ESG: Promover a transparência e fortalecer a disponibilidade de dados ESG por parte dos emissores; Fortalecer o desempenho ESG geral dos emissores com base na própria pontuação ESG metodologia desenvolvida pela SAM (sendo possível via Clarity, provedor externo)
- (ii) tema específico: Estabelecer ações de engajamento com emissores em questões específicas de sustentabilidade, como mudanças climáticas ou outras questões como a biodiversidade, questões sociais, etc.
- (iii) controvérsias: Analisar o desempenho ESG de emissores potencialmente expostos a controvérsias ou violações dos padrões internacionais; Promover a conformidade dos emissores com os requisitos legais de cada jurisdição e com os requisitos decorrentes das iniciativas e políticas da SAM.
- (iv) assembleias: Coletar informações adicionais sobre o desempenho das empresas antes de

assembleias gerais e promover o alinhamento com a política de voto da SAM; Explicar os critérios de voto e/ou intenção de voto da SAM nas assembleias gerais.

(v) metas e estratégia ESG: Contribuir para a definição dos planos estratégicos de sustentabilidade das empresas e dos seus; análise de materialidade ESG; Fortalecer o conhecimento dos planos ESG das empresas e promover o alinhamento com as melhores práticas.

(vi) Principal Principal adverse impacts, de acordo com a ESMA (regulação europeia: Estabelecer ações de diálogo com empresas para promover uma gestão adequada dos principais indicadores de impacto adverso, incluindo aspectos ambientais, sociais e de governança.

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?

De imediato, nenhuma ação é tomada. Após a realização da assembleia, os analistas acompanham a companhia nos temas específicos.

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	Acompanhamento junto ao provedor de dados e ao time Global ESG.
Mudanças no nível de comprometimento das companhias investidas com ESG	Sim	Acompanhamento junto ao provedor de dados e ao time Global ESG.
Rebaixamento de rating;	Sim	Acompanhamento junto ao provedor de dados e ao time Global ESG.
Dificuldade na mensuração dos impactos positivo na sociedade	Sim	Acompanhamento junto ao provedor de dados e ao time Global ESG.
Diferentes aspectos ESG podem ter importâncias distintas para diferentes setores ou projetos	Sim	Definição de materialidade setorial, com base em critérios internos da SAM Global.
Conflito de interesse na produção dos dados	Não	
Ausência de auditoria para avaliação dos dados e indicadores	Sim	Checagem de dados pelo provedor.
Os dados e indicadores refletem ações passada ou tempestividade no reporte dos	Sim	Checagem de dados pelo provedor e solicitação às empresas de dados atualizados.

dados

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.santanderassetmanagement.com.br/investimento-responsavel/esg>

Informar e-mails para recebimento do formulário preenchido:

Email - Obrigatório

asset.compliance@santanderam.com

Email - Obrigatório

assetESG@santanderam.com

Email - Opcional

Email - Opcional