



**ANBIMA**

## Formulário Metodologia ASG

**Razão social da instituição Gestora**

Jive Asset Gestão de Recursos Ltda.

**CNPJ da instituição Gestora**

13.966.641/0001-47

**Razão social da instituição Administradora**

XP Investimentos Corretora de Câmbio, Títulos e Valores Mobiliários S.A.

**CNPJ da instituição Administradora**

02.332.886/0001-04

**Razão Social do Fundo**

Jive Bossanova Master High Yield – Fundo De Investimento Cotas De Fundos De Investimento Multimercado Crédito Privado

**CNPJ do Fundo**

43.121.036/0001-36

**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.**

A gestora possui implementada a Política Socioambiental de Investimentos que detalha os procedimentos, bem como o fluxo a ser seguido para avaliação de potenciais investimentos a serem feitos pelos Fundos nos Ativos, incluindo o seu posterior monitoramento.

Além da presente política, a avaliação socioambiental dos ativos é baseada nas melhores práticas de mercado, de acordo com a legislação nacional (Código Civil Brasileiro) e boas práticas internacionais aplicáveis (IFC Performance Standards/ Padrões de Desempenho da IFC).

Para garantir que as decisões de investimento estejam alinhadas com o objetivo de mitigar Riscos Socioambientais e potencializar Impactos Socioambientais Positivos, todas as decisões de investimento relacionadas aos Ativos dos Fundos devem observar a presente política, considerando:

- A relação de atividades excluídas;
- A relação da legislação Brasileira aplicável;
- A Avaliação Socioambiental.

**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:**

Análise de reputação e risco de imagem

Filtro negativo

Due diligence/ Assessment

Conferência de fontes públicas

Desenvolvimento de rating ASG interno

**Análise de reputação e risco de imagem - Descreva de forma detalhada qual a avaliação sobre risco de imagem é realizada no contexto do objetivo do fundo, informando quais critérios são observados para a aquisição do portfólio do fundo.**

A avaliação de risco de imagem consiste na avaliação do CNAE dos ativos para verificar se as atividades ou setores estão inseridas dentro da Lista de Atividades Excluídas, na captura e análise de mídias negativas e verificação da existência de processos judiciais relacionados a questões socioambientais.

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

Apostas

Bebidas Alcoólicas

Indústria Armamentícia

Indústria do carvão (mineração e geradores de energia)

Pornografia

Tabaco

Trabalho infantil

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

Conforme estabelecido na Política Socioambiental de Investimentos da gestora, o processo de diligência dos ativos é conduzido em duas fases distintas: a avaliação preliminar do risco e a diligência socioambiental.

Durante a etapa inicial de avaliação do risco socioambiental dos ativos, são aplicados critérios de filtro negativo e conduzida uma verificação de informações de fontes públicas. Com base nesses resultados, determina-se a abordagem a ser adotada na subsequente diligência socioambiental.

A diligência socioambiental compreende a análise aprofundada das informações identificadas na etapa anterior, além da avaliação do impacto socioambiental dos ativos. Essa análise pode ser realizada internamente pela equipe da gestora ou por meio da contratação de consultoria externa.

Este processo de diligência pode englobar a utilização do questionário interno da gestora, a consulta às partes envolvidas e visitas presenciais aos locais pertinentes

**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.**

São conferidos os seguintes dados de fontes públicas: informações divulgadas pelas empresas (FRE, Relatório Anual, Resultados etc), mídias, processos judiciais, infrações, multas em face da contraparte e análise locacional dos ativos envolvidos no projeto, com intuito de identificar sobreposição ou proximidade com territórios de povos tradicionais ou indígenas, unidades de conservação, áreas contaminadas etc.

**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 ASG interno da gestora considera dados quantitativo e qualitativos e incluem aspectos de meio ambiente, social e governança que são avaliados a partir do preenchimento de Questionário Socioambiental interno. A partir da avaliação dessas respostas e metodologia de pontuação definida internamente é obtida a nota que permite classificar o ativo entre A, B, C (sendo A a melhor).

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

A gestora possui implementada a Política Socioambiental de Investimentos que detalha os procedimentos, bem como o fluxo a ser seguido para avaliação de potenciais investimentos a serem feitos pelos Fundos nos Ativos, incluindo o seu posterior monitoramento. Além da política, a avaliação socioambiental dos ativos é baseada nas melhores práticas de mercado, de acordo com a legislação nacional (Código Civil Brasileiro) e boas práticas internacionais aplicáveis (IFC Performance Standards/ Padrões de Desempenho da IFC).

Para garantir que as decisões de investimento estejam alinhadas com o objetivo de mitigar Riscos Socioambientais e potencializar Impactos Socioambientais Positivos, todas as decisões de investimento relacionadas aos Ativos dos Fundos devem observar:

- A relação de atividades excluídas;
- A relação da legislação Brasileira aplicável;
- A Avaliação Socioambiental

A Avaliação Socioambiental do ativo consiste em duas etapas: avaliação preliminar do risco socioambiental do ativo, no qual é aplicado a estratégia de filtro negativo, conferência de fontes públicas de mídias, processos judiciais, infrações etc, com intuito de averiguar se existem elementos que possam indicar o non compliance da empresa em relação a legislação brasileira.

A partir deste resultado é definida qual será a abordagem será aplicada na segunda etapa: diligência socioambiental. A diligência socioambiental consiste no aprofundamento das informações identificadas na primeira etapa e avaliação do impacto socioambiental do ativo e pode ser realizada pela equipe interna da gestora ou através de contratação de consultoria externa.

A abordagem dessa diligência pode incluir no preenchimento do questionário interno da gestora, consulta as contrapartes envolvidas e visitas in loco.

**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 Fundo tem por objeto o investimento preponderante em cotas de fundos de investimento, observado que a alocação de seu Patrimônio Líquido em Ativos ocorrerá da seguinte forma:

- (i) no mínimo 95% (noventa por cento) de seu Patrimônio Líquido deverá ser alocado em cotas do Fundo Master; e
- (ii) a parcela remanescente, correspondente a até 5% (cinco por cento) de seu Patrimônio Líquido, poderá

ser mantida em Disponibilidades ou aplicada em Outros Ativos.

## 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?

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

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

Durante o processo de avaliação preliminar do risco o ativo pode ser classificado entre os riscos: Muito

Baixo, Baixo, Médio, Alto, Muito Alto e Crítico. A partir do resultado do risco é definida a consequência da segunda etapa, consiste em na não necessidade de monitoramento ou diligência adicional de avaliação socioambiental do ativo.

A partir dos resultados da diligência adicional são definidos os planos de ação e frequência do monitoramento.

**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?**

Outros

**Descreva sobre outros procedimentos:**

São realizados esforço contínuos para monitoramento do ativo.

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

Não há prazo máximo permitido para manutenção do ativo.

**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>
Proprietário	Ferramentas online			Ferramentas de busca online

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

Formulário de Referência

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.jiveinvestments.com/>

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

**Email - Obrigatório**

jp@jivemaua.com.br

**Email - Obrigatório**

sarah.sato@jivemaua.com.br

**Email - Opcional**

esg@jiveinvestments.com

**Email - Opcional**