

BM&FBOVESPA divulga a 11ª carteira do ISE - Índice de Sustentabilidade Empresarial

+ transparência: número de empresas que autorizaram a abertura das respostas do questionário foi de 33 em um total de 35, aumento de 85% para 94% da carteira

+ atratividade: cinco novas empresas participaram do processo do ISE

São Paulo, 26 de novembro de 2015 - A BM&FBOVESPA anunciou hoje a décima primeira carteira do Índice de Sustentabilidade Empresarial (ISE), que vai vigorar de 04 de janeiro de 2016 a 29 de dezembro de 2016. A nova carteira reúne 40 ações de 35 companhias. Elas representam 16 setores e somam R\$ 960,52 bilhões em valor de mercado, o equivalente a 44,75% do total do valor das companhias com ações negociadas na BM&FBOVESPA com base no fechamento de 24/11/2015 (no ano anterior, somavam R\$ 1,22 trilhão em valor de mercado, o equivalente a 49,87% do total).

A nova carteira do ISE também traz expressivo aumento da transparência por parte das companhias. A porcentagem de empresas que autorizaram a abertura das respostas do questionário saltou de 85% para 94%. Este ano 33 de 35 empresas autorizaram e no ano passado, 34 de 40. As respostas estão publicadas no site do índice: www.isebvmf.com.br.

São convidadas a participar do processo anual do ISE -- cujo parceiro técnico desde a criação do índice é o Centro de Estudos em Sustentabilidade da Fundação Getulio Vargas (GVces) -- as companhias que detêm as 200 ações mais líquidas da Bolsa na virada da carteira. Para o processo da carteira anunciada hoje, foram convidadas 180 companhias. Destas, 46 concorreram em uma ou mais categorias (42 Elegíveis à carteira, 01 como Treineira e 03 no Simulado).

A definição da carteira ISE 2016 ocorreu durante um ano emblemático para o índice, em que foram comemorados os seus 10 anos. Nesta década, o ISE teve rentabilidade de +128,88% contra +51,28% do Ibovespa (base de fechamento em 24/11/2015). No mesmo período, o ISE teve menor volatilidade: 25,57% em relação a 42,81% do Ibovespa. Esta carteira também inaugura o “Ciclo Longo” do questionário, um processo de revisão aprofundado que será realizado a cada três anos. Para chegar à versão que as companhias responderam foram consideradas mais de 580 contribuições de empresas e outros stakeholders colhidas em um amplo processo de consulta, realizado em 2014 e 2015. Os resultados, debatidos e aprovados pelo Conselho Deliberativo do ISE no início de junho, indicam importantes tendências no campo da Sustentabilidade Empresarial.

O processo da carteira 2016 do ISE contou com a Asseguração externa da KPMG, que emitiu parecer de “Asseguração Limitada sem ressalvas”. A asseguarção do processo do ISE é realizada desde 2012, o que confere ainda mais credibilidade e confiabilidade ao índice. Além disso, o ISE segue com a parceria de monitoramento diário de imprensa feito pela empresa Imagem Corporativa.

Nova Carteira – 2016

| | | | | | | |
|-----------------|-------|-------------|-------------|------------------|--------------|------------|
| AES Tiete | BRF | Copel | Eletrobras | Fleury | Light | SulAmerica |
| B2W | CCR | CPFL | Eletropaulo | Itaúsa | Natura | Telefônica |
| Banco do Brasil | Cemig | Duratex | Embraer | Itaú Unibanco | Oi | Tim* |
| Bradesco | Cesp* | Ecorodovias | Even | Klabin | Lojas Renner | Tractebel |
| Braskem | Cielo | EDP | Fibria | Lojas Americanas | Santander | Weg |

**empresas que não divulgaram as respostas de seu questionário*

Carteira atual – 2015

| | | | | | | | |
|-----------------|--------|-------------|-------------|---------------|------------------|-------------|-----------|
| AES Tiete | BRF | Copel | Eletrobras | Fleury | JSL | Natura | Tim* |
| B2W | CCR | CPFL | Eletropaulo | Gerdau* | Klabin | Sabesp* | Tractebel |
| Banco do Brasil | Cemig | Duratex | Embraer* | Gerdau MET* | Light | Santander | Vale |
| Bradesco | Cielo | Ecorodovias | Even | Itaúsa | Lojas Americanas | SulAmerica | Weg |
| Braskem | Coelce | EDP | Fibria | Itaú Unibanco | Lojas Renner | Telefônica* | |

**empresas que não divulgaram as respostas de seu questionário*

OPA BicBanco - Fechamento de capital em 28/10/2015

Raio X da carteira

- 75% das empresas incluem avaliações e discussões periódicas de temas socioambientais nas reuniões do Conselho de Administração ou de comitês que reportam a ele.
- 56% das empresas contam com uma ou mais mulheres em seus Conselho de Administração, como conselheiras efetivas (em 2015: 46%). 22% contam com a participação de um ou mais negros no Conselho de Administração, como conselheiros efetivos.
- 93% declaram possuir política corporativa sobre mudanças climáticas aprovada pelo Conselho de Administração ou pela alta direção (em 2015: 83%).
- 56% das empresas incluem critérios/indicadores relacionados ao seus desempenhos socioambientais entre as métricas de avaliação e de remuneração variável de seus administradores (conselheiros e/ou diretores).
- 80% das empresas afirmam ter uma política de riscos e 92%, uma gestão de riscos corporativos com aspectos socioambientais.
- 100% das empresas publicam Relatório de Sustentabilidade conforme as diretrizes da GRI (em 2015: 93%).

- 93% das empresas adotam procedimentos ou práticas de avaliação de potenciais impactos (positivos ou negativos) sobre a biodiversidade, sendo que 10% o fazem de forma sistemática também em sua cadeia de valor.
- 93% das empresas afirmam que se comprometem com metas de redução de GEE previamente estabelecidas (em 2015: 67%) e, destas, 53% atingiram seus objetivos ou mesmo os superaram (em 2015: 49%). 7% ainda não estabeleceram metas (em 2015: 33%).
- 89% das empresas possuem processos e procedimentos implementados em relação à aplicação de critérios socioambientais para a gestão de todos os seus fornecedores críticos. Dessas apenas 37% tem exigência de cumprimento da legislação trabalhista em relação ao quadro de empregados dos fornecedores críticos.

Sobre o ISE

- *O Índice de Sustentabilidade Empresarial (ISE) foi criado em dezembro de 2005, sendo o quarto do tipo no mundo (1º: Nova Iorque; 2º: Londres; 3: Johannesburgo).*
- *Seus objetivos são atuar como indutor de boas práticas no meio empresarial brasileiro e ser uma referência para o investimento socialmente responsável.*
- *O ISE reflete o retorno médio de uma carteira teórica de ações de empresas de capital aberto e listadas na BM&FBOVESPA com as melhores práticas em sustentabilidade.*
- *Seu desenho metodológico é de responsabilidade do Centro de Estudos em Sustentabilidade (GVces) da FGV-EAESP e tem por base um questionário com sete dimensões: Ambiental, Social, Econômico-Financeira, Governança Corporativa, Geral, Natureza do Produto e Mudanças Climáticas. A avaliação das empresas é feita em dois âmbitos: quantitativo (respostas do questionário) e qualitativo (envio de documentos comprobatórios de forma amostral).*
- *O ISE tem como parceiros ainda: KPMG, parceiro de Asseguração de processo; e Imagem Corporativa, parceiro de monitoramento de imprensa.*
- *O índice é calculado pela BM&FBOVESPA em tempo real ao longo do pregão, considerando os preços dos últimos negócios efetuados no mercado à vista. São convidadas a participar do processo as empresas que detém as 200 ações mais negociadas no pregão em termos de liquidez.*
- *O ISE conta com uma opção ao investidor atento a esta agenda. Trata-se do ETF ISUS11 (fundo de índice), listado em 31/10/2011. Os fundos de índices, conhecidos no mundo todo como ETFs (Exchange Traded Funds), são espelhados em índices e suas cotas são negociadas em Bolsa da mesma forma que as ações.*
- *O mais alto nível de governança do ISE é o CISE - Conselho Deliberativo do ISE, presidido pela BM&FBOVESPA, e composto por mais 10 entidades: Associação dos Analistas e Profissionais de Investimento do Mercado de Capitais (Apimec) – vice-presidente do CISE, Associação Brasileira das Entidades Fechadas de Previdência Complementar (Abrapp), Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais (Anbima), Grupo de Institutos Fundações e Empresas (GIFE), Instituto dos Auditores Independentes do Brasil (IBRACON), Instituto Brasileiro de Governança Corporativa (IBGC), Instituto Ethos de Empresas e Responsabilidade Social, International Finance Corporation (IFC), Programa das Nações Unidas para o Meio Ambiente (PNUMA) e Ministério do Meio Ambiente.*