

São Paulo, 21 de junho de 2016.

Comunicado de Supervisão

Ref.: Laudo Anual de Avaliação do Processo de *Suitability* de Derivativos de Balcão e COE do Código de Negociação de Instrumentos Financeiros

Prezados Senhores,

O artigo 20 da Deliberação 10 do Conselho de Negociação de Instrumentos Financeiros estabelece que as instituições participantes devem elaborar laudo descritivo (“Laudo de Derivativos”) referente ao processo de negociação de derivativos de balcão, que será enviado anualmente à ANBIMA, **até o último dia útil de julho**, contendo informações referentes ao período entre o primeiro dia útil do mês de julho do ano civil anterior e o último dia útil do mês de junho do mês civil corrente, em conformidade com os itens mínimos estabelecidos pelo § 3º desse mesmo artigo.

Adicionalmente, o artigo 9º, parágrafo único da Deliberação 14, estabelece que as instituições participantes devem elaborar laudo descritivo (“Laudo de COE”) acerca do processo de emissão, distribuição, colocação e negociação de Certificados de Operações Estruturadas (“COE”) e encaminhá-lo, juntamente com o Laudo de Derivativos, em seção separada.

Nesse sentido, solicitamos às instituições participantes do Código de Negociação de Instrumentos Financeiros que preencham cada aba da planilha no modelo anexo (uma para Derivativos e outra, caso aplicável, para o COE) e enviem uma versão digitalizada com as devidas assinaturas e outra versão em formato “xls”, compactadas em uma única pasta.

O envio dos laudos referente ao período de 31/07/2015 a 30/06/2016 deverá ser realizado em papel timbrado da Instituição até o dia 29/07/2016, via SSM, através do módulo “Envio periódico de documentos”. Para acessar a regra, na tela inicial do sistema clique em “Supervisão – ANBIMA comunicando e auxiliando a instituição” > “Envio periódico de documentos” > procure pelo Código para Negociação de Instrumentos Financeiros e selecione “Administrar”.

Para esclarecimentos adicionais, por favor, entre em contato com Diogo Blazeque pelo telefone (11) 3471-5277 ou Fabio Monteiro, pelo telefone (11) 3471-4256.



Certos de contarmos com a contribuição de todos para que sejam atingidos os objetivos da Regulação e Melhores Práticas da ANBIMA, subscrevemo-nos.

Atenciosamente,



Guilherme Benaderet

Superintendente de Supervisão de Mercados

