

Circular N°013/10

São Paulo, 8 de outubro de 2010

Ref...: Procedimentos para migração de Tipos ANBIMA para a nova classificação de fundos Curto Prazo, Referenciados, Renda Fixa e Multimercados Juros e Moeda

Prezados Senhores:

Em virtude das mudanças ocorridas na classificação dos Fundos Curto Prazo, Referenciados, Renda Fixa e Multimercados Juros e Moeda (inclusões, exclusões e alterações de descrição de tipos), nos termos do Anexo à Deliberação N° 43 de 8/outubro/2010, foram definidos os seguintes procedimentos para transição de Tipo ANBIMA sem perda de histórico de rentabilidade.

1. Elegibilidade

Somente poderão migrar de Tipo ANBIMA, sem perda de histórico de rentabilidade, os fundos de investimento que estiverem, até a data da migração, com suas políticas de investimento e respectivas carteiras compatíveis com os conceitos associados aos novos Tipos ANBIMA.

2. Regras de transição

2.1 De: Classificação Atual (Origem)
Para: Classificação Nova (Destino)

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8.501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3471 4200 Fax 11 3471 4230

Tipo ANBIMA - Origem	Tipo ANBIMA - Destino
Curto Prazo	Curto Prazo
Curto Prazo - Aplicação Automática	
Referenciado DI	Referenciado DI
Referenciado Outros	Renda Fixa Índices
Renda Fixa	Renda Fixa
	Renda Fixa Índices
Renda Fixa Médio e Alto Risco	Renda Fixa Crédito Livre
	Renda Fixa Índices

I. Os fundos classificados no Tipo Curto Prazo – Aplicação Automática migrarão automaticamente para o Tipo Curto Prazo e serão identificados na Base de Dados ANBIMA com um atributo chamado Aplicação Automática.

II. Os fundos classificados no Tipo Referenciado DI permanecerão no Tipo Referenciado DI.

III. Os fundos classificados no Tipo Referenciados Outros migrarão automaticamente para o Tipo Renda Fixa Índices.

Visando a manter o alinhamento entre as Classificações CVM e ANBIMA, os fundos atualmente classificados no Tipo Referenciados Outros precisarão alterar a classificação na CVM de Referenciado para Renda Fixa, em até 90 dias da publicação desta Circular.

IV. Os fundos classificados no Tipo Renda Fixa poderão migrar para o Tipo Renda Fixa Índices.

V. O nome do Tipo Renda Fixa Médio e Alto Risco muda para Renda Fixa Crédito Livre. Os fundos classificados no Tipo Renda Fixa Médio e Alto Risco poderão migrar para o Tipo Renda Fixa Índices.

Os fundos Renda Fixa e Renda Fixa Médio e Alto Risco que discriminarem em seu prospecto e regulamento que buscam seguir ou superar o IMA Geral ou seus subíndices, apurados pela ANBIMA, deverão ser classificados no Tipo Renda Fixa Índices.

VI. Os fundos dos demais Tipos ANBIMA Multimercado que quiserem migrar para o Tipo ANBIMA Multimercado Juros e Moeda, com a alteração introduzida pela Deliberação nº 43, deverão observar o disposto no Comunicado 013/2010 [Veja item Processo de Exceção].

3. Prazos

3.1 **Migração:** As instituições deverão preencher os tipos de destino descritos nesta Circular na área restrita do *site* (www.anbid.com.br) e enviar para área de Supervisão (veja Anexo 1) até o dia **30/11/2010**.

No Anexo I, seguem as orientações de acesso e passo a passo para o envio, à área de Supervisão, da lista de fundos que serão objeto da migração.

3.2 Adaptação de documentos dos fundos (regulamentos e prospectos): os fundos que serão objetos de migração de tipo sem perda de histórico deverão adaptar seus prospectos até **31/1/2011** e seus Regulamentos até a próxima Assembleia Geral.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos adicionais que se fizerem necessários.

Atenciosamente,

Hudson Bessa
Gerente de Informações

Guilherme Benaderet
Supervisão de Mercados - Fundos

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8.501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3471 4200 Fax 11 3471 4230

- 1. Tipo**
Filtra os fundos que aparecerão na pesquisa conforme o tipo selecionado.
- 2. Checkbox – Visualizar somente os fundos não preenchidos**
Facilita a visualização dos registros filtrando somente os fundos ainda não preenchidos.
- 3. Botão – Pesquisar**
Realiza a pesquisa conforme o parâmetro.
- 4. Botão – Relatório Geral**
Disponibiliza um relatório de *status* referente ao preenchimento realizado.
Exemplo:

Instituição	XXXXXXXX				
Tipo	Referenciado DI	Total	2	Não Preenchidos	1
Cód. Fundo	Fantasia		Tipo De	Tipo Para	Passível de Perda de Histórico
999999	YYYYYYYY		Referenciado DI		
888888	ZZZZZZZZ		Referenciado DI	Referenciado DI	N
Tipo	Renda Fixa	Total	2	Não Preenchidos	0
Cód. Fundo	Fantasia		Tipo De	Tipo Para	Passível de Perda de Histórico
777777	TTTTTTTT		Renda Fixa	Renda Fixa	N
666666	RRRRRRRR		Renda Fixa	Renda Fixa Índices	N

- 5. Botão Salvar**
Salva todas as alterações realizadas na tela.

Observação - Caso o usuário saia da tela ou avance para a próxima página sem acionar a opção Salvar, todas as alterações serão perdidas.

- 6. Botão Enviar**
A disponibilização dos fundos novos (fundos cadastrados de 26/11/2010 até 29/11/2010) para alteração de tipo ocorrerá sempre no dia seguinte à disponibilização do Código ANBIMA do Fundo. Após 29/11/2010, o tipo de destino dos fundos novos deverá ser informado por *e-mail*.

Observações – Esse botão só é habilitado após o preenchimento de todos os fundos dos tipos disponíveis. Após o envio, os fundos não poderão mais ser alterados, excetuando-se as condições a seguir:

- Liberação por parte da ANBIMA;
- Registro de um novo fundo cujo tipo sofrerá migração;
- Alteração de Tipo de um fundo cujo tipo sofrerá migração.

- 7. Botão Aplicar a todos na tabela**

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8.501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3471 4200 Fax 11 3471 4230

Estabelece para todos os fundos na tela o tipo indicado. Caso o tipo de origem e o tipo indicado sejam diferentes da lista de reclassificação sugerida pela ANBIMA, será enviada a mensagem: "Este tipo pode implicar perda de histórico para o fundo".

Tipo Origem	Tipo Destino
Curto Prazo	Curto Prazo
Curto Prazo - Aplicação Automática	
Referenciado DI	Referenciado DI
Referenciado Outros	Renda Fixa Índices
Renda Fixa	Renda Fixa Índices Renda Fixa
Renda Fixa Médio e Alto Risco	Renda Fixa Crédito Livre Renda Fixa Índices

8. Coluna passível de Perda de Histórico

Esta coluna indica se a alteração de tipo solicitada poderá acarretar ou não perda de histórico do fundo.

9. Reclassificação Renda Fixa (Destino)

Estabelece o tipo a ser migrado. Caso o tipo de origem e o tipo indicado sejam diferentes da lista de reclassificação sugerida pela ANBIMA, será enviada a mensagem: "Este tipo pode implicar em perda de histórico para o fundo".

10. Navegação

Para facilitar o preenchimento os fundos, são mostrados em grupos de 20. A navegação para os demais itens a serem preenchidos é feita através deste item.

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8.501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3471 4200 Fax 11 3471 4230