

CONSELHO DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

DELIBERAÇÃO Nº 66

O Conselho de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento, no exercício das atribuições a ele conferidas pelo Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento (“Código de Fundos”), em consulta aos seus membros realizada em 18 de junho de 2015.

Delibera:

Atualizar as Diretrizes para Envio de Informações de Fundos de Investimento, nos termos do artigo 11, § 1º Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento, com o objetivo de adequar à nova regulamentação vigente.

Esta deliberação revoga e substitui, a partir da data de sua publicação, a deliberação Nº 59, de 13 de abril de 2015.

São Paulo, 01 de Outubro de 2015.

Luciane Ribeiro

**Presidente do Conselho de Regulação e Melhores Práticas
para Fundos de Investimento**

São Paulo

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

www.anbima.com.br

Rio de Janeiro

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

ANEXO A DELIBERAÇÃO Nº 66

CONSELHO DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

DIRETRIZES PARA ENVIO DE INFORMAÇÕES DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

CAPÍTULO I - OBJETIVOS

Artigo 1º – A presente Diretriz tem por objetivo fixar as regras para o envio de informações relativas aos Fundos de Investimento que compõem a Base de Dados da Associação (“Base de Dados ANBIMA”), nos termos do Artigo 10 do Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento (Código de Fundos).

CAPÍTULO II – PRINCÍPIOS

Artigo 2º - A Base de Dados ANBIMA visa:

I. O correto cumprimento dos objetivos e princípios gerais do Código de Fundos, principalmente no que tange à padronização dos procedimentos, qualidade e disponibilidade das informações, bem como à promoção e divulgação das mesmas de forma transparente ao mercado e aos investidores;

II. Dotar a indústria de Fundos de Investimento de regras operacionais para o envio e atualização de informações de Fundos de Investimento junto à Base de Dados.

Artigo 3º – O envio e atualização de informações à Base de Dados ANBIMA pelas Instituições Participantes devem observar os seguintes princípios:

I. Exatidão: as informações devem estar corretas;

II. Pontualidade: as informações devem ser enviadas dentro dos prazos estipulados;

III. Regularidade: as informações devem ser enviadas na periodicidade devida;

São Paulo

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

www.anbima.com.br

Rio de Janeiro

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

IV. Integridade: todas as informações requeridas devem ser enviadas, não havendo lacunas na Base de Dados.

CAPÍTULO III - SÉRIE HISTÓRICA DE INFORMAÇÕES DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

Artigo 4º – A série histórica anterior ao registro a ser incorporada à Base de Dados ANBIMA terá, no máximo, 10 (dez) dias, a contar da data do registro do Fundo de Investimento.

Artigo 5º - Quando de seu registro, os Fundos de Investimento serão classificados pelas Instituições Participantes em classes, categorias e subcategorias, nos termos definidos pela ANBIMA.

Parágrafo Único – A classificação atribuída ao Fundo de Investimento quando do seu registro deverá ter consistência entre a descrição dos tipos divulgados pela ANBIMA assim como com o objetivo, política de investimento e riscos divulgados no prospecto, formulário de informações complementares, lâmina de informações essenciais, regulamento do Fundo de Investimento e resultados obtidos por sua carteira.

Artigo 6º – Quando houver inconsistência na classificação adotada pela Instituição Participante, esta poderá ser alterada em até 15 (quinze) dias a contar da data de registro. Após esse período, a mudança na classificação de um Fundo de Investimento observará o disposto no Artigo 7º desta Diretriz.

Artigo 7º – A Instituição Participante poderá solicitar, a qualquer tempo, a reclassificação do Fundo de Investimento na Base de Dados ANBIMA, mediante a apresentação de:

I – Ata da Assembleia que deliberou pela alteração na classificação do Fundo de Investimento; ou

II - Fato relevante divulgado ao mercado informando a alteração e os motivos que fundamentaram tal decisão; ou

III – Declaração informando que a totalidade dos cotistas do Fundo de Investimento aprovou a alteração na classificação do Fundo de Investimento.

§ 1º – Tal alteração tornar-se-á efetiva após a primeira data de conversão do fundo, respeitado um prazo mínimo de 30 (trinta) dias.

São Paulo

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

www.anbima.com.br

Rio de Janeiro

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

§ 2º - O prazo disposto no §1º, bem como o envio do fato relevante previsto no inciso II, ambos deste artigo, não serão aplicados para os casos em que as alterações forem aprovadas pela totalidade dos cotistas.

Artigo 8º – O disposto nos artigos 6º e 7º desta Diretriz não será considerado quando a alteração decorrer de mudanças na regulamentação.

Artigo 9º – Considera-se como data de início de funcionamento de um Fundo de Investimento, para fins de divulgação de histórico de rentabilidade, resultados e comparativos, a data em que o Fundo realizou sua primeira captação de recursos.

Parágrafo único – Nos casos de incorporação, fusão, cisão ou mudança da instituição administradora e/ou gestora do Fundo de Investimento, para efeito de manutenção ou perda da série histórica de informações de Fundos de Investimento na Base de Dados ANBIMA, deverá ser observado o disposto nos artigos 10, 11 e 12 desta Diretriz.

Artigo 10 – As Instituições Participantes devem observar:

I - No caso de incorporação de Fundo de Investimento, a divulgação da rentabilidade, patrimônio líquido, comparações de rentabilidades ou simulações acerca das performances do Fundo de Investimento incorporador deve ser feita como se o mesmo fosse novo. Entretanto, o Fundo de Investimento incorporador pode divulgar sua rentabilidade histórica observada anteriormente à incorporação, se o patrimônio líquido do Fundo de Investimento incorporado for equivalente a até 2 (duas) vezes o valor de seu patrimônio líquido anterior à incorporação e desde que seja indicada, de forma destacada, a data da incorporação. Se o Fundo resultante for um novo Fundo (ou fusão), aplicar-se-á a presente regra, com mesmos requisitos, observado que o patrimônio líquido do Fundo do qual se deseja divulgar a rentabilidade histórica deve ser equivalente a, no mínimo 1/3 (um terço) do patrimônio líquido do Fundo de Investimento resultante.

II - No caso de cisão de Fundo de Investimento, se a política de investimento dos Fundos resultantes desse processo for idêntica à do Fundo cindido, os novos Fundos podem divulgar a rentabilidade histórica do Fundo cindido, desde que seja indicada, com destaque, a data da cisão. Se as políticas de investimento dos Fundos de Investimento resultantes do processo de cisão forem diversas daquela adotada pelo Fundo de Investimento cindido, a divulgação da rentabilidade, patrimônio líquido, comparações de rentabilidades ou simulações acerca das performances dos Fundos de Investimento resultantes da cisão deve ser feita como se os mesmos fossem novos.

São Paulo

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

www.anbima.com.br

Rio de Janeiro

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

III – No caso de fusão de Fundo de Investimento, se a política de investimento do Fundo resultante da fusão for diversa daquela adotada pelo Fundo fundido, a divulgação da rentabilidade, patrimônio líquido, comparações de rentabilidade ou simulações acerca das performances do Fundo resultante deve ser feita como se o mesmo fosse novo.

Artigo 11 – No caso de mudança da instituição administradora de Fundos de Investimento, mantidas suas demais características, pode ser divulgada a rentabilidade histórica de tais Fundos de Investimento, desde que seja indicada, com destaque, a data da alteração tratada neste artigo.

Artigo 12 – No caso de mudança de instituição gestora de Fundos de Investimento a rentabilidade de tais Fundos de Investimento deve ser divulgada como se os mesmos fossem novos.

Parágrafo Único: Excetuam-se do caput do artigo os casos de cisão, fusão e incorporação da instituição gestora, desde que sejam mantidas as demais características do Fundo de Investimento, bem como alterações para empresas integrantes do mesmo grupo. A data da alteração tratada neste parágrafo deve ser indicada com destaque.

Artigo 13 - Para os Fundos que utilizem a Base de Dados ANBIMA para a divulgação de sua série histórica a terceiros, tais como imprensa e assinantes do sistema SI-ANBIMA, a alteração desta condição, ou seja, a não divulgação da referida série histórica, deverá ser solicitada à Comissão de Acompanhamento de Fundos de Investimento, mediante envio de carta contendo a justificativa.

§ 1º – A Comissão de Acompanhamento analisará a solicitação descrita no caput deste artigo no prazo de 30 (trinta) dias contados de seu recebimento pela Área de Supervisão da ANBIMA, devendo ser mantida a divulgação durante o período de análise.

§ 2º – A opção de não divulgação de série histórica a terceiros é facultada apenas a Fundos de Investimento que sejam registrados na Base de Dados ANBIMA como: (i) reservados; (ii) exclusivos; ou (iii) previdenciários.

Artigo 14 – A ANBIMA poderá, por meio de seus organismos de representação, expedir metodologias, critérios e procedimentos para apuração das informações para envio a Base de Dados ANBIMA, as quais deverão ser observadas pelas Instituições Participantes.

Artigo 15 – As Instituições Participantes deverão ter um processo formalizado dos procedimentos operacionais e das metodologias utilizados para apuração das informações que serão enviadas para a Base de Dados ANBIMA, de modo a permitir o cumprimento das regras dessas Diretrizes.

São Paulo

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

www.anbima.com.br

Rio de Janeiro

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

§ 1º – Qualquer alteração nos procedimentos operacionais e das metodologias utilizados pela Instituição Participante para apuração das informações que serão enviadas para a Base de Dados ANBIMA deverá ser imediatamente comunicada à ANBIMA.

§ 2º - Também deverá ser imediatamente comunicado a ANBIMA quaisquer correções realizadas pela Instituição Participante que impliquem em mudanças na série histórica do seu Fundo de Investimento.

Artigo 16 – A ANBIMA publicará aviso nos rankings e estatísticas sobre a ocorrência de eventuais erros nas informações já divulgadas e/ou alterações dos procedimentos e metodologias adotados pelas Instituições Participantes.

§ 1º - O aviso disporá acerca da informação objeto do erro e/ou da alteração dos procedimentos ou metodologia, assim como identificará a Instituição Participante responsável pela respectiva mudança.

§ 2º - Os rankings e estatísticas divulgados posteriormente aos procedimentos previstos nos parágrafos anteriores incorporarão as informações revisadas sempre que houver esta possibilidade, sendo que os rankings e estatísticas já publicados não sofrerão qualquer alteração.

CAPÍTULO IV - PRAZOS PARA ENVIO

Artigo 17 – Todas as informações devem ser mantidas atualizadas de acordo com os prazos definidos nesta Diretriz.

§ 1º - As informações cadastrais deverão observar os prazos constantes do Capítulo do Código de Fundos que trata do Registro dos Fundos de Investimento na ANBIMA.

§ 2º - As informações de cota, patrimônio líquido, emissão e resgate de cotas e número de cotistas de Fundos de Investimento devem ser enviadas diariamente, em horário a ser divulgado pela Área de Supervisão da ANBIMA, devendo observar:

I. Para os Fundos com cota de abertura deverá ser enviada a cota do dia e o conjunto de informações referentes ao dia anterior.

II. Para os Fundos com cota de fechamento deverá ser enviado o conjunto de informações referentes ao dia anterior.

São Paulo

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

www.anbima.com.br

Rio de Janeiro

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

§ 3º - As informações utilizadas para elaboração dos rankings e estatísticas devem ser enviadas periodicamente, obedecendo os prazos estipulados nas circulares específicas divulgadas pela ANBIMA.

§ 4º - Caso o Fundo de Investimento opte por divulgar rentabilidade ajustada ao repasse realizado diretamente ao cotista de dividendos, juros sobre capital próprio ou outros rendimentos advindos de ativos financeiros que integrem a carteira, deverá enviar o “valor do provento por cota” na data *ex-ante*.

Artigo 18 - Independentemente dos prazos constantes nesta Diretriz ou no Capítulo do Código de Fundos que trata do Registro dos Fundos de Investimento na ANBIMA, a participação nos rankings elaborados pela ANBIMA a partir de informações da Base de Dados de Fundos de Investimento só será possível se o fundo enviar solicitação de registro, com as informações pertinentes corretas, até o 3º dia útil do mês seguinte ao de referência do ranking.

CAPÍTULO V - MONITORAMENTO DA BASE DE DADOS

Artigo 19 – A Área de Supervisão da ANBIMA supervisionará o disposto nesta Diretriz e poderá:

I – enviar comunicação à Instituição Participante solicitando modificações que entender necessárias nas informações enviadas à Base de Dados ANBIMA;

II – submeter os casos em que haja indícios de descumprimento das regras estabelecidas nesta Diretriz à Comissão de Acompanhamento;

III – solicitar novas informações para compor a Base de Dados ANBIMA e alterar os procedimentos e processos de envio, buscando seu aperfeiçoamento.

IV – Aplicar a multa definida no art. 11, do Código de Fundos.

São Paulo

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

www.anbima.com.br

Rio de Janeiro

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