

## Termo de Compromisso

**Instituição:** Citibank Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.

**Código:** Código de Fundos de Investimento

**Data da assinatura:** 27/11/2017

**PAI nº F015/2016:** apuração de eventuais descumprimentos aos art. 6º, incisos I e II do Código de Fundos de Investimento, art. 29, e art. 18, caput e § 1º do Código de Fundos de Investimento combinado com o art. 15 da Deliberação ANBIMA nº 75 do Conselho de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento.

### Ementa

**Termo de Compromisso:** Instituição administradora de fundos de investimento. Adoção de procedimento divergente ao estipulado no Manual de Marcação a Mercado (“MaM”), na reprecificação de ativos de crédito privado. Permitir a aquisição e manutenção de ativo de crédito privado sem observar os requisitos previstos no Código de Fundos de Investimento para aquisição dessa modalidade de ativo.

**Compromissos assumidos:** (i) revisar o manual de MaM para refletir com mais propriedade o procedimento de *valuation* adotado; (ii) registrar a nova versão do manual de MaM junto à ANBIMA no prazo de 30 (trinta) dias; (iii) rever a precificação de todos os ativos caracterizados como de crédito privado que estejam nas carteiras dos fundos de investimento administrados, à luz do manual de MaM revisado, no prazo de 45 (quarenta e cinco) dias, sendo que a respectiva revisão será aprovada formalmente em reunião pelo Comitê de *Valuation*, cuja ata de reunião será disponibilizada à ANBIMA; (iv) implementar melhorias no processo de produção de evidências para proporcionar comprovação mais adequada dos procedimentos seguidos, informações levantadas e decisões tomadas; (v) redigir novo manual de registro e produção de evidências de *valuation*, que será entregue à ANBIMA no prazo de 30 (trinta) dias; (vi) efetuar verificações pré-liquidação de transações com crédito privado dos fundos de investimento administrados e exigir de gestores a certificação de que o emissor do crédito dispõe de demonstrações financeiras auditadas; (vii) redigir novo manual interno de checagem de critérios pré-liquidação de transações, que será entregue à ANBIMA no prazo de 30 (trinta) dias; (viii) efetuar contribuição financeira no valor de R\$ 260.000,00 (duzentos e sessenta mil reais) para custear projetos educacionais da ANBIMA.

