

CONSELHO DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

DELIBERAÇÃO Nº 42

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 (o "Código"), em sua reunião realizada no dia 22 de junho de 2010;

Considerando:

- A necessidade de estabelecer diretrizes relativas aos procedimentos mínimos de controle e gerenciamento da liquidez das carteiras dos Fundos de Investimento, conforme determinado no Artigo 28, parágrafo 3º, inciso IV do Código;

Delibera:

1. Que as Instituições Participantes gestoras de Fundos de Investimento ("Gestores") devem seguir, no que diz respeito ao gerenciamento da liquidez das carteiras dos Fundos, as normas estabelecidas nas Diretrizes de Liquidez da ANBIMA constantes do documento anexo a esta Deliberação;
2. Que os Gestores devem registrar seus Manuais de Gerenciamento de Liquidez ("Manual" ou "Manuais"), já com as adaptações necessárias ao cumprimento dos procedimentos estabelecidos nas Diretrizes de Liquidez da ANBIMA, até 01 de outubro de 2010.
3. O registro será feito mediante a apresentação de carta de solicitação de registro (modelo disponível em www.anbima.com.br), acompanhada de cópia eletrônica do Manual em CD ou enviada via e-mail para supervisaodeliquidez@anbima.com.br.
 - 3.1. A carta de solicitação de registro, devidamente assinada pelos representantes do Gestor, deverá ser registrada em forma física ou digitalizada e enviada ao e-mail acima.
4. Os Manuais deverão ser registrados na ANBIMA sempre em sua forma mais atualizada, com vistas a atestar as práticas efetivamente utilizadas pelos Gestores no que tange à liquidez das carteiras dos Fundos.
 - 4.1. Sempre que ocorrer mudança no teor do Manual, a nova versão deverá ser registrada na ANBIMA em até 15 (quinze) dias contados da respectiva alteração ou da alteração das práticas anteriormente registradas.

Rio de Janeiro

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

www.anbima.com.br

São Paulo

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

4.2. A substituição da versão vigente do Manual deverá ser acompanhada do registro de uma versão destacando todas as alterações efetuadas ou um documento explicitando as alterações realizadas.

5. Na capa do Manual deverá ser impressa a data de início de vigência daquela versão do documento.

6. Na análise dos Manuais será avaliada a adequação de tais documentos às diretrizes em anexo.

7. A ANBIMA irá monitorar as práticas de gerenciamento de liquidez dos Gestores, verificando sua adequação aos respectivos Manuais, podendo, inclusive, solicitar para este fim relatórios e carteiras dos Fundos de Investimento sob análise.

Esta Deliberação entra em vigor na data de sua divulgação.

São Paulo, 01 de julho de 2010.

Luiz Eduardo Passos Maia
Presidente do Conselho de Regulação e Melhores Práticas de Fundos de Investimento

Rio de Janeiro

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

www.anbima.com.br

São Paulo

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