



Metodologia de envio de dados

Informações técnicas – Base de dados de fundos de investimento

Data: 22/07/19

Sumário

1. OBJETIVO DA BASE DE DADOS	3
2. BASE LEGAL	3
3. INFORMAÇÕES ENVIADAS À ANBIMA	3
4. PERIODICIDADE DE ENVIO	4
5. PRAZOS E REGRAS DE DIVULGAÇÃO	4
6. MÉTRICAS PARA VALIDAÇÃO DAS INFORMAÇÕES RECEBIDAS	5
7. PARTICIPAÇÃO EM RANKINGS E ESTATÍSTICAS	6
8. FORMAS DE ENVIO DE INFORMAÇÕES	6
9. DISPOSIÇÕES FINAIS	7

1. OBJETIVO DA BASE DE DADOS

A base de dados armazena e disponibiliza ao mercado informações de cadastro e as movimentações periódicas da indústria de fundos brasileira.

2. BASE LEGAL

As instituições aderentes ao Código de Fundos (“Código”) devem, obrigatoriamente, enviar informações cadastrais e periódicas de fundos de investimento e fundos de investimento em cotas de fundos.

3. INFORMAÇÕES ENVIADAS À ANBIMA

I. **Informações cadastrais:** são referentes às características dos fundos enviadas no momento do registro na ANBIMA e sempre que houver algum tipo de alteração durante o período em que o fundo estiver ativo. A lista das informações cadastrais, bem como domínios e regras de negócio, está descrita nos manuais ANBIMA de cadastro de fundos.

II. **Informações periódicas:** compõem as movimentações do fundo. São enviadas com a periodicidade estabelecida na Diretriz nº03, capítulo III, seção II. Veja a lista dessas informações:

- patrimônio líquido, com duas casas decimais;
- valor de cota com sete casas decimais;
- valor das cotas emitidas com duas casas decimais;
- valor das cotas resgatadas pelos clientes com duas casas decimais;
- valor das cotas resgatadas pelo come-cotas com duas casas decimais;
- número de cotistas maior que zero;
- valor aplicado em cotas de fundos, com cinco casas decimais (volume financeiro aplicado em cotas de fundos de investimento);
- fundos off-shore devem ter a movimentação informada em dólar (USD);
- amortizações em cota devem ser informadas no campo de “Resgate por Clientes”;
- patrimônio líquido por segmento de investidor em R\$/MIL;
- número de cotistas por segmento de investidor.

4. PERIODICIDADE DE ENVIO

- a. Fundos com cota de abertura (periodicidade diária): realizar o envio do patrimônio líquido e da cota no dia (D0) e as demais informações em D+1.
- b. Fundos com cota de fechamento (periodicidade diária): realizar o envio do conjunto de informações referentes ao dia anterior (D-1).
- c. Fundos com cotas de periodicidade mensal: realizar o envio até o décimo dia útil do mês subsequente, com a consolidação das movimentações ocorridas ao longo do mês (cotas emitidas, cotas resgatadas pelos clientes e cotas resgatadas pelo come cotas), tendo o último dia útil do mês anterior como base.
- d. Formulário de PL e número de cotistas por Segmento de Investidor: realizar o envio até o 10º (décimo) dia útil do mês subsequente.

5. PRAZOS E REGRAS DE DIVULGAÇÃO

- I. Fundos de investimento e fundos de investimento em cotas de fundos (FIC) devem ser enviados até às 22h00.
- II. Para fins de divulgação à imprensa, o envio deve se concretizar até às 13h.
- III. Fundos exclusivos ou reservados não têm suas informações divulgadas à imprensa, ainda que o envio ocorra no horário estipulado para a divulgação. Em caso de interesse, o administrador fiduciário deve solicitar formalmente à ANBIMA.
- IV. Fundos que não são obrigados a divulgar cotas diariamente deverão ser enviados no prazo definido na regulação em vigor.
- V. Fundos que possuem mais de uma classe de cotas deverão enviar informações separadamente para cada classe.
- VI. O cumprimento dos prazos e envio de informações são de total responsabilidade das instituições aderentes ao Código, uma vez que as mesmas estão sujeitas a penalidades previstas no documento em caso de descumprimento, vide Diretriz N°03, capítulo III, art. 16.

6. MÉTRICAS PARA VALIDAÇÃO DAS INFORMAÇÕES RECEBIDAS

Seguimos um processo diário para garantir a qualidade e integridade da base de dados. Para isto, aplica regras de validação, retira e questiona informações sob suspeita de erro, mantendo a integridade dos dados disponíveis em sua base de dados. Os filtros que utilizamos são:

I. Informações divergentes:

- a. PL incompatível com as movimentações do fundo: verifica se o patrimônio líquido informado foge da tolerância de 0,050% dentro da equação: $PL_{D-1} \times (RENTABILIDADE/100+1) + CAPTAÇÃO\ LÍQUIDA - PL_{DO} = 0$.

Divergências iguais ou acima de R\$ 30.000.000,00 (trinta milhões de reais) são notificadas diariamente.

Divergências abaixo de R\$ 30.000.000,00 (trinta milhões de reais) são notificadas semanalmente.

- b. Dados repetidos: quando o patrimônio líquido e/ou o valor da cota em sete casas decimais estão idênticos ao dia anterior.
- c. Dados outliers: quando a rentabilidade diária ultrapassa os quatro desvios em relação à média do seu tipo ANBIMA.

II. Ausências de informações: dentro da série de informações periódicas qualquer ausência encontrada será cobrada conforme as regras a seguir:

- a. Ausências de dez dias úteis em relação a D-3: os controladores de ativos recebem notificações diárias.
- b. Ausências no histórico com prazo superior a D-13: os controladores de ativos recebem notificações semanais.
- c. A partir da segunda cobrança de ausências, independente dos prazos, caso não haja justificativa ou envio das informações solicitadas, o administrador fiduciário será notificado.

Lembramos que as informações retiradas da base de dados por processos de validação de informações são consideradas “informações ausentes” e devem ser reenviadas pela instituição.

7. PARTICIPAÇÃO EM RANKINGS E ESTATÍSTICAS

Independentemente dos prazos determinados para envio de informações presentes nesta metodologia, para participar dos nossos rankings e estatísticas, devem ser observados os seguintes prazos:

Informações cadastrais: novos registros de fundos e alterações de informações cadastrais devem ser enviados corretamente até o terceiro dia útil do mês subsequente ao de referência.

Informações periódicas: devem ser enviadas corretamente até o sétimo dia útil do mês subsequente ao de referência. Fundos cujo prazo para apuração permitido pela legislação em vigor exceda o sétimo dia útil podem enviar a melhor estimativa de valor de cota e patrimônio líquido para o fundo no fechamento do mês. Após o fechamento oficial da cota, os valores devem ser retificados na base de dados.

8. FORMAS DE ENVIO DE INFORMAÇÕES

- I. **Site ANBIMA:** o envio de dados por meio do site é realizado pelo Informante designado pelo administrador fiduciário cadastrado na Associação. As inserções podem ser feitas via upload de dados em arquivo de extensão texto (.TXT) ou digitação. Caso a instituição não tenha o acesso, é necessário que o solicite utilizando o Formulário de Solicitação de Senha/ Cancelamento, disponível no site da ANBIMA. Os acessos são concedidos individualmente e as senhas são pessoais e intransferíveis.
- II. **Sistema Galgo:** o Galgo é um sistema de transição de informações entre o mercado e a Associação, sem vínculo com a ANBIMA. As informações são enviadas em arquivo XML através do portal disponibilizado pela prestadora de serviços.

- III. **Arquivo de extensão texto (.TXT):** em caso de indisponibilidade dos meios de envio, de informações históricas com mais de 90 dias e informações divergentes com mais de dez dias úteis, os dados podem ser enviados em arquivo texto por e-mail.
- IV. A escolha do veículo de envio - site da ANBIMA ou sistema Galgo - fica a total critério da instituição associada/aderente ao Código.

9. DISPOSIÇÕES FINAIS

Atraso no envio de informações diárias: multa de R\$15,00 (quinze reais) limitadas ao valor equivalente a 30 dias de atraso, vide Diretriz N°03, Capítulo III, Seção II, Subseção I Art. 13, Inciso 7º.

Encerramento de fundos: o histórico de informações periódicas deve estar completo pelo menos nos últimos dois anos para que possa ser encerrado na nossa base de dados. Adicionalmente, os dados referentes à data de encerramento do fundo devem seguir a seguinte regra: patrimônio líquido zerado, valor de cota maior que zero, emissão de cotas zerada, resgate total do patrimônio líquido informado e número de cotistas igual a zero.

Encerramento de fundos por incorporação: informa-se patrimônio líquido zerado, valor de cota maior que zero e resgate total do patrimônio líquido do fundo incorporado e o adiciona ao PL e cotas emitidas do fundo incorporador, na data do evento.

Série histórica: quaisquer correções que impliquem mudanças no histórico dos fundos devem ser reportadas à ANBIMA pelo administrador fiduciário ou pelo prestador de serviço delegado por este.