



Metodologia de envio de dados

Base de dados de fundos de investimento

Data: 21/05/2021

Sumário

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

1. OBJETIVO DA BASE DE DADOS

O objetivo desta base de dados é armazenar e disponibilizar ao mercado informações sobre a indústria de fundos brasileira.

2. BASE LEGAL

As instituições aderentes ao código de administração de recursos de terceiros devem, obrigatoriamente, enviar informações cadastrais e periódicas de fundos de investimento e fundos de investimento em cotas de fundos, conforme o capítulo XII do Código ANBIMA para Administração de Recursos de Terceiros e documento de Regras e Procedimentos ANBIMA do Código de Administração de Recursos de Terceiros.

3. INFORMAÇÕES ENVIADAS À ANBIMA

I. **Informações cadastrais:** são informações enviadas no momento do registro do fundo na ANBIMA e que podem ser alteradas sem periodicidade definida. A lista das informações cadastrais, bem como domínios e regras de negócio, estão descritas nos manuais ANBIMA de cadastro de fundos.

II. **Informações periódicas:** dados enviados para ANBIMA com periodicidade definida (diária ou mensal) no momento de registro do fundo. As informações solicitadas são:

- **Patrimônio líquido**, com duas casas decimais;
- **Valor da cota**, com sete casas decimais;
- **Emissão**, com duas casas decimais;
- **Resgate pelos clientes**, com duas casas decimais;
- **Resgate pelo come-cotas**, com duas casas decimais;

- **Número de cotistas**, número inteiro e maior que zero;
- **Valor aplicado em cotas de fundos**, com cinco casas decimais.

Observação 1: Os fundos devem informar dados financeiros na moeda de onde o fundo foi instituído.

Observação 2: Amortizações em cotas devem ser contempladas nos campos de “resgate pelos clientes” e “valor da cota”.

Observação 3: Fundos que possuem mais de uma classe de cotas deverão enviar informações separadamente para cada classe.

Observação 4: O campo de resgate pelo come-cotas deve contemplar os valores pagos de imposto de renda em maio e novembro. Portanto, deve ser preenchido apenas duas vezes ao ano. Nas demais datas, a informação deve constar zerada.

Observação 5: O valor aplicado em cotas de fundos representa o volume financeiro aplicado em cotas de fundos de investimento.

4. PRAZOS DE ENVIO

a. Fundos com cota de abertura (periodicidade diária): realizar o envio de patrimônio líquido e valor da cota na data de referência (D0) e as demais informações periódicas no dia útil seguinte (D+1).

b. Fundos com cota de fechamento (periodicidade diária): realizar o envio do conjunto de informações periódicas no dia útil seguinte à data de referência (D+1).

c. Fundos com cotas de periodicidade mensal: realizar o envio até o décimo dia útil do mês subsequente.

Observação 1: As informações periódicas devem ser enviadas nas suas respectivas datas de referência até às 23h59.

Observação 2: Fundos com periodicidade de atualização mensal devem consolidar, na referência do último dia útil do mês, as movimentações de emissão e resgate pelos clientes ao longo do mês, tendo o último útil do mês anterior como base.

Observação 3: O cumprimento dos prazos e envio de informações são de total responsabilidade das instituições aderentes, uma vez que as mesmas estão sujeitas a penalidades previstas no código de administração de recursos de terceiros.

5. REGRAS DE DIVULGAÇÃO À IMPRENSA

- I. Para fins de divulgação à imprensa, o envio correto dos dados deve se concretizar até às 13h59 da data de divulgação.
- II. 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.

6. MÉTRICAS PARA VALIDAÇÃO DAS INFORMAÇÕES RECEBIDAS

A ANBIMA segue um processo diário para garantir a qualidade e integridade da base de dados. Para isto, aplicam-se regras de validação onde as informações podem ser retiradas e questionadas. Os filtros que utilizamos são:

I. Informações ausentes:

As ausências por falta de envio da instituição ou por terem sido retiradas nos processos de validação da ANBIMA são questionadas mensalmente às instituições aderentes.

II. Informações divergentes:

Análise do patrimônio líquido informado para verificar incompatibilidade com as demais informações periódicas do fundo.

A divergência é apontada e o dado é questionado sempre que o PL informado estiver acima da tolerância de 0,05% dentro da equação:

$$\frac{PL\ D-1 \times (RENTABILIDADE/100+1) + CAPTAÇÃO\ LÍQUIDA - PL\ D0}{PL\ D-1}$$

- a. Divergências de até R\$30.000.000,00: são questionadas mensalmente.
- b. Divergências acima de R\$30.000.000,00: são retiradas da base diariamente e a instituição é notificada para que possa realizar a correção.

Observação: Estar fora dos parâmetros estabelecidos pela ANBIMA não necessariamente indica que o informe esteja errado. Se o mesmo tiver uma justificativa plausível a ANBIMA poderá aceitar a justificativa e voltar com a informação na base de dados.

III. Informe de PL e Cota repetidos com o dia anterior:

Ocorre quando o **Patrimônio Líquido** e/ou o **Valor da Cota** estão idênticos ao dia anterior em 7 casas decimais. Quando isso ocorre, o informe feito pela instituição é retirado da base em todos os dias em que as informações estiverem iguais e a mesma é questionada.

Observação: Estar fora dos parâmetros estabelecidos pela ANBIMA não necessariamente indica que o informe esteja errado. Se o mesmo tiver uma justificativa plausível a ANBIMA poderá aceitar a justificativa e voltar com a informação na base de dados.

IV. Dados outliers:

A conferência de dados outliers é realizada diariamente com os dados recém importados. Consiste

em verificar o comportamento da rentabilidade diária dos fundos através de métodos estatísticos limitando em máximos e mínimos que podem ser aceitos para cada tipo ANBIMA. As informações com rentabilidade fora dos padrões determinados são retiradas da base e questionadas.

Observação: Estar fora dos parâmetros estabelecidos pela ANBIMA não necessariamente indica que o informe esteja errado. Se o mesmo tiver uma justificativa plausível a ANBIMA poderá aceitar a justificativa e voltar com a informação na base de dados.

V. Número de cotistas:

A conferência do número de cotistas é realizada semanalmente em duas etapas:

Na primeira, consiste em enquadrar normas para que os fundos cumpram as regulamentações determinadas para os tipos de investidores (exclusivos, reservados ou sem restrição)

A segunda etapa utiliza métodos estatísticos para verificação das variações diárias na quantidade de cotistas de cada fundo.

Regras para cada tipo de investidor:

- a. **Fundos Exclusivos:** Fundos cadastrados com o tipo de investidor exclusivo devem enviar seus dados periódicos com apenas 1 cotista.
- b. **Fundos Reservados:** Fundos cadastrados com o tipo de investidor reservado devem enviar seus dados periódicos com, no máximo, 50 cotistas.
- c. **Fundos sem restrição:** Não há uma quantidade máxima de cotistas determinada.

Após a primeira conferência, todos os fundos são analisados pelas suas variações diárias.

Observação: Estar fora dos parâmetros estabelecidos pela ANBIMA não necessariamente indica que o informe esteja errado. Se o mesmo tiver uma justificativa plausível a ANBIMA poderá aceitar a justificativa e voltar com a informação na base de dados.

VI. Valor Aplicado em Cotas (VAC):

A conferência do valor aplicado em cotas (VAC) é realizada em duas fases, onde na primeira se estabelecem limites do percentual de VAC em relação ao PL considerando o público ao qual o fundo é destinado, seguindo as normas da CVM. Na segunda, são analisadas as variações diárias do percentual aplicado em cotas com apoio de métodos estatísticos.

Abaixo, as métricas aplicadas na primeira fase de validação:

- a. **Fundos de Investimentos (FI, FF):** A primeira fase de validação é aplicada somente para os tipos ICVM 555, onde os fundos cadastrados como **Investidor Qualificado** podem aplicar, no máximo, 40% do seu patrimônio em cotas e o **Investidor Sem Restrição** deve respeitar o limite de 20%.
- b. **Fundos de Investimentos em Cota (FC, FM):** A primeira fase de validação é aplicada para todos os fundos cadastrados como FC. Estes ativos devem aplicar o percentual mínimo de 95% de seu patrimônio em cotas.

Observação: Estar fora dos parâmetros estabelecidos pela ANBIMA não necessariamente indica que o informe esteja errado. Se o mesmo tiver uma justificativa plausível a ANBIMA poderá aceitar a justificativa e voltar com a informação na base de dados.

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 do ranking.

- **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 por meio do portal disponibilizado pela prestadora de serviços.

III. **Arquivo de extensão texto (.TXT):** em caso de (i) indisponibilidade dos meios de envio, (ii) de informações históricas com mais de 120 dias ou (iii) informações divergentes, os dados podem ser enviados em arquivo texto por e-mail.

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 das informações: multa de R\$15,00 (quinze reais) limitadas ao valor equivalente a

30 dias de atraso.

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.