

Termo de compromisso

Instituições participantes: Mercantil do Brasil Corretora S.A. – CTVM e Mercantil do Brasil Distribuidora S.A. de Títulos e Valores Mobiliários (“Mercantil”)

Código: Administração de Recursos de Terceiros (“Código de ART”)

Data da assinatura: 27/12/2021

Foi aberto **PAI (Procedimento para Apuração de Irregularidades) nº ART002/2021¹** para apuração de eventuais descumprimentos aos artigos 4º, inciso II e 16, parágrafo único, das Regras e Procedimentos de Apreçamento nº 01²; e aos seguintes dispositivos do Código de ART: artigo 35, parágrafo único do Anexo I; artigo 7º, inciso II, c/c o artigo 6º, inciso II.

Ementa

TERMO DE COMPROMISSO³. Instituições prestadoras de serviços de administração de fundos de investimento. (i) Indícios de falhas no processo de precificação de ativos de crédito privado; (ii) Indícios de utilização de formas estáticas baseadas em custo de aquisição para a precificação dos ativos de crédito privado investidos pelos fundos de investimento; (iii) Indícios de falta de diligência na atividade de precificação e desatualização no Manual de Precificação.

A celebração de termo de compromisso foi considerada conveniente e oportuna a fim de assegurar que os potenciais descumprimentos apurados no PAI não ocorram futuramente.

¹ O PAI trata de assuntos abarcados pelo Convênio para Aproveitamento da Autorregulação na Indústria de Fundos de Investimento Brasileira, firmado entre a Comissão de Valores Mobiliários e ANBIMA, conforme Anexo I do Convênio e seu pilar de Supervisão do Mercado.

² Regras e Procedimentos ANBIMA para Apreçamento nº 01, de 23 de maio de 2019.

³ Os fatos descritos em ementa apontam os temas supervisionados que estão em suposta irregularidade. Contudo, a celebração de Termo de Compromisso não acarreta confissão quanto à matéria de fato, nem reconhecimento da irregularidade da conduta analisada, e, ainda, suspende o PAI ou Processo em relação às partes até que as obrigações estabelecidas no Termo de Compromisso tenham sido cumpridas e evidenciadas, quando, então, o PAI ou Processo, será arquivado.



Compromissos assumidos:

(i) Revisão dos processos e metodologia de precificação de ativos alocados nas carteiras dos fundos administrados; (ii) Apresentar o seu Manual de Precificação revisado, de forma a refletir as alterações introduzidas na metodologia; (iii) Apresentar à ANBIMA, mensalmente, até o 5º (quinto) dia útil do mês seguinte pelo período de 06 (seis) meses a contar da celebração do Termo de Compromisso, todas as atas das reuniões e documentos apreciados nas reuniões do Subcomitê de Precificação; (iv) Apresentar à ANBIMA relatório de auditoria interna, comprovando a implementação das novas metodologias de precificação de ativos adotadas, conforme refletidas no Manual de Precificação revisado; (v) Realizar treinamento aos colaboradores que aborde todas as regras do Código de ART, em especial sobre os temas e regras relacionados ao apreçamento de ativos, seguido de envio à ANBIMA dos materiais utilizados e da lista de presença dos participantes; e (vi) Realizar contribuição financeira no valor total de R\$ 50.000,00 (cinquenta mil reais), destinada a custear eventos e ações educacionais a serem promovidos pela ANBIMA.

