

RANKING ANBIMA DE CUSTÓDIA DE ATIVOS

:: Metodologia ::

OBJETIVO DO RANKING

1. O Ranking ANBIMA tem por objetivo informar ao mercado de maneira transparente e fidedigna os valores da indústria de prestação de serviços de Custódia de Ativos, bem como a representatividade de mercado das instituições participantes.

DAS CONDIÇÕES DE PARTICIPAÇÃO

2. Participarão do Ranking ANBIMA de Custódia de Ativos as Instituições Financeiras aderentes ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Serviços Qualificados ao Mercado de Capitais que prestem os serviços de Custódia de Títulos, Valores Mobiliários, Direitos Creditórios etc., para investidores pessoa física, pessoa jurídica e/ou clientes institucionais, residentes ou não residentes no Brasil.

3. A instituição participante deverá enviar o formulário padrão, impreterivelmente, até o 10º (décimo) dia útil do mês subsequente ao mês de referência das informações.

ELEGIBILIDADE DOS RECURSOS

4. São elegíveis a este Ranking todos os recursos lastreados em ativos financeiros e valores mobiliários para os quais existam contratos de custódia com a instituição participante, excetuando-

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3032 3838 | 3471 4200 Fax 11 3034 1903 | 3471 4230

se, contudo, aqueles recursos que gozem de privilégio legal na administração ou gestão que não tiverem sido alvo de um processo formal de concorrência para escolha de custodiante.

5. Os recursos elegíveis devem estar representados através de fundos de investimento, clubes de investimento e carteiras, ressalvadas as vedações previstas nesta metodologia.

DA DEFINIÇÃO DE CONGLOMERADO ECONÔMICO

6. Para fins deste Ranking, considera-se pertencente ao mesmo grupo econômico, conglomerado ou grupo financeiro qualquer sociedade controlada, controladora, ou sob controle comum da Instituição participante do Ranking.

DOS RANKINGS

7. A ANBIMA divulgará três Rankings de Custódia de Ativos, a saber: Mercado Doméstico, Mercado Externo e Geral, conforme anexo a esta metodologia.

7.1 Além da segregação das informações conforme a origem dos recursos, se provenientes do Mercado Doméstico ou do Mercado Externo, estas serão também segregadas entre as classes “Ativos de Origem da Própria Instituição” e “Ativos de Origem de Outra Instituição”.

7.2 Para a classificação dos ativos entre as Classes “Ativos de Origem da Própria Instituição” ou “Ativos de Origem de Outra Instituição”, deverão ser observados o conceito de conglomerado econômico e a relação entre a instituição participante e o contratante do serviço, gestor, administrador ou emissor conforme os casos definidos a seguir.

Mercado Doméstico:

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3032 3838 | 3471 4200 Fax 11 3034 1903 | 3471 4230

8. Com relação aos recursos provenientes do Mercado Doméstico, os ativos custodiados deverão ser informados nas seguintes categorias: (i) Administradores/Gestores; (ii) Entidades Fechadas de Previdência Complementar (“EFPC”); (iii) Empresas; (iv) Seguradoras; (v) Pessoa Física; (vi) Outros Investidores Institucionais e (vii) Fundo de Investimento em Direitos Creditórios (“FIDC”).

9. Para a categoria “Administradores/Gestores”, deverão ser informados os valores dos ativos custodiados que sejam administrados/geridos via fundos de investimento, clubes de investimento e carteiras. Se o gestor contratado for empresa do mesmo conglomerado econômico, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem da Própria Instituição”. Caso o gestor contratado não seja empresa do mesmo conglomerado econômico do custodiante, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem de Outra Instituição”. Em ambos os casos, o contratante do serviço de custódia deverá ser o próprio administrador/gestor.

10. Para a categoria “Entidades Fechadas de Previdência Complementar”, deverão ser informados os valores dos ativos custodiados que sejam de propriedade desta categoria de investidores. Se a instituição patrocinadora da entidade contratante for empresa do mesmo conglomerado econômico da instituição custodiante, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem da Própria Instituição”. Caso contrário, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem de Outra Instituição”. Em ambos os casos, o contratante do serviço de custódia deverá ser a própria Entidade Fechada de Previdência Complementar, seja através de contrato direto, seja através de anuência no contrato do administrador do fundo de investimento, clube de investimento ou carteira com o custodiante.

11. Para a categoria “FIDC”, deverão ser informados os valores dos ativos custodiados (títulos, valores mobiliários, direitos creditórios, etc) que servem de lastro para Fundos de Investimento em Direitos Creditórios. Os ativos desta categoria deverão ser classificados como “Ativos de Origem de Outra Instituição”.

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3032 3838 | 3471 4200 Fax 11 3034 1903 | 3471 4230

12. Para a categoria “Seguradoras”, deverão ser informados os valores dos ativos custodiados que sejam de propriedade desta Categoria de investidores. Se a Seguradora for do mesmo conglomerado econômico, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem da Própria Instituição”. Caso contrário, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem de Outra Instituição”. Em ambos os casos, o contratante do serviço de custódia deverá ser a própria Seguradora, seja através de contrato direto, seja através de anuência no contrato do administrador do fundo com o custodiante.

13. Para a categoria “Empresas”, deverão ser informados os valores dos ativos custodiados que sejam de propriedade desta Categoria de investidores. Se a empresa for do mesmo conglomerado econômico, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem da Própria Instituição”. Caso contrário, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem de Outra Instituição”. Em ambos os casos, os contratantes do serviço de custódia deverão ser as próprias empresas, seja através de contrato direto, seja através de anuência no contrato do administrador do fundo com o custodiante.

14. Para a categoria “Pessoa Física”, deverão ser informados os valores dos ativos custodiados de investidores pessoas físicas que possuam contrato específico para a prestação deste serviço com uma instituição custodiante. Os ativos de pessoa física sob custódia somente admitem a classificação de “Ativos de Origem de Outra Instituição”. Não inclui, nesta Categoria, o serviço de custódia de ativos prestado por corretoras e distribuidoras de valores como serviço auxiliar ao de corretagem por elas prestado.

15. Para a categoria “Outros Investidores Institucionais”, deverão ser informados os valores dos ativos custodiados de investidores que não se enquadrem nas categorias anteriormente mencionadas. Se o “Investidor Institucional” for do mesmo conglomerado econômico, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem da Própria Instituição”. Caso contrário, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem de Outra Instituição”. Em ambos os casos, o contratante do serviço de custódia deverá ser o próprio “Investidor Institucional”, seja através de contrato direto, seja através de anuência no contrato do administrador do fundo com o custodiante.

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3032 3838 | 3471 4200 Fax 11 3034 1903 | 3471 4230

Mercado Externo:

16. Com relação aos recursos provenientes do Mercado Externo, os ativos custodiados deverão ser informados em duas categorias: (i) *DRs*; (ii) Resolução 2.689;
17. Para a categoria “*DRs*”, deverão ser informados os valores das ações custodiadas pelas instituições financeiras custodiantes *que* servem de lastros para a emissão de recibos de ações que são objetos de negociação no exterior, tanto no mercado norte-americano como em outros, em Bolsa de Valores e no mercado de balcão. Deverão ser classificados como “Ativos de Origem da Própria Instituição” os ativos pertencentes a empresas emissoras de programas de *DRs* que sejam do mesmo conglomerado econômico do custodiante. Caso contrário, os ativos serão classificados como “Ativos de Origem de Outra Instituição”.
18. Para a categoria “Resolução 2.689”, deverão ser informados os valores dos ativos custodiados que dão lastros aos recursos externos aplicados por investidores não residentes que tenham ingressado no Brasil sob a égide da Resolução nº 2.689 do CMN. Se a empresa titular da Conta Coletiva e/ou Proprietária contratante for empresa do mesmo conglomerado econômico, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem da Própria Instituição”. Caso a empresa titular da Conta Coletiva e/ou Proprietária contratante não for empresa do mesmo conglomerado econômico, os ativos deverão ser classificados como “Ativos de Origem de Outra Instituição”.

DAS VEDAÇÕES

19. Os valores relativos às cotas dos fundos de investimento que compõem a carteira não deverão ser informados, para evitar a ocorrência de dupla contagem.
20. Os valores relativos aos derivativos e aos ativos adquiridos no mercado a termo não deverão ser informados. Serão considerados apenas os valores relativos a ativos negociados no mercado à vista.

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3032 3838 | 3471 4200 Fax 11 3034 1903 | 3471 4230

21. Os ativos de propriedade da instituição custodiante e/ou de instituições financeiras autorizadas pelo Banco Central que pertençam ao mesmo conglomerado econômico da instituição financeira custodiante não poderão ser informados, uma vez que não serão computados no Ranking ANBIMA de Custódia de Ativos.

DAS DISPOSIÇÕES GERAIS

22. No caso de operações de Empréstimo de Valores Mobiliários, a posição custodiada a ser considerada será aquela de posse da instituição tomadora do empréstimo na data base, de acordo com manual de precificação e conforme disposto no artigo 23.

23. Os valores informados deverão ser expressos em R\$ mil e deverão refletir os valores dos ativos custodiados, apurados pelo valor registrado na carteira no último dia útil do mês de referência das informações.

24. Caso alguma instituição financeira discorde dos números divulgados pela ANBIMA, deverá fazer um comunicado por escrito relatando os motivos da discordância. Se for constatado algum equívoco, os Rankings a serem publicados no futuro incorporarão as informações revisadas. Os Rankings passados não sofrerão alterações.

Rio de Janeiro

Avenida República do Chile, 230 13º andar
20031-170 Rio de Janeiro RJ Brasil
+ 55 21 3814 3800 Fax 21 3814 3880/3960

www.anbima.com.br

São Paulo

Av. das Nações Unidas, 8501 11º e 21º andares
05425-070 São Paulo SP Brasil
+ 55 11 3032 3838 | 3471 4200 Fax 11 3034 1903 | 3471 4230