

COMISSÃO PARLAMENTAR DE INQUÉRITO DESTINADA A INVESTIGAR INDÍCIOS DE APLICAÇÃO INCORRETA E DE MANIPULAÇÃO NA GESTÃO DE FUNDOS DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR DE SERVIDORES ESTATAIS E PÚBLICOS OCORRIDO ENTRE 2003 E 2015.

REQUERIMENTO Nº , de 2015
Do Sr. Sérgio Souza

Requer que seja requisitada a transferência dos sigilos bancário, fiscal e eletrônico junto aos órgãos e instituições competentes (incluindo o dossiê integrado da Receita Federal) dos dados do período compreendido entre o janeiro/2004 até dezembro/2015 do **Sr. Antônio Luiz de Mello e Souza**, diretor da empresa Artis Gestora de Recursos S/A, bem como das empresas a seguir relacionadas: **(a)** Artis Gestora de Recursos S.A., CNPJ nº 04.248.117/0001-40; **(b)** Fundo de Investimento em Participações Bioenergia, CNPJ nº 12.565.053/0001-39; **(c)** ASM Asset Management DTVM S.A., CNPJ nº 02.678.955/0001-28; **(d)** ASM Fundo de Investimento em Direitos Creditórios – FCVS, CNPJ nº 07.142.172/0001-49.

Senhor Presidente,

Venho respeitosamente, com fundamento no art. 58, § 3º da Constituição Federal; no art. 2º, da Lei nº1579/52; e no art. 36, inc. II do Regimento Interno da Câmara dos Deputados; apresentar REQUERIMENTO, para que seja requisitada a transferência dos sigilos bancário, fiscal e eletrônico junto aos órgãos e instituições competentes (incluindo o dossiê integrado da Receita Federal) dos dados do período compreendido entre o janeiro/2004 até dezembro/2015 do Sr. Antônio Luiz de Mello e Souza, diretor da empresa Artis Gestora de Recursos S/A, bem como das empresas a seguir relacionadas: **(a)** Artis Gestora de Recursos S.A., CNPJ nº 04.248.117/0001-40; **(b)** Fundo de Investimento em Participações Bioenergia, CNPJ nº 12.565.053/0001-39; **(c)** ASM Asset Management DTVM S.A., CNPJ nº 02.678.955/0001-28; **(d)** ASM Fundo de Investimento em Direitos Creditórios – FCVS, CNPJ nº 07.142.172/0001-49;

JUSTIFICATIVA

Esta Comissão Parlamentar de Inquérito foi criada para investigar indícios de aplicação incorreta de recursos e de manipulação na gestão dos quatro maiores fundos de previdência complementar de funcionários de estatais, a saber: PREVI, FUNCEF, PETROS e POSTALIS.

Dentre os diversos investimentos emblemáticos que compõem o arco de atípica utilização dos recursos de entidades fechadas de previdência complementar, objeto desta CPI, inserem-se as operações ligadas ao Grupo Canabrava. Trata-se imbróglio para o qual foram tragados Postalis e Petros.

O fundador do Grupo Canabrava, Ludovico Giannattasio, atraiu, na alavancagem do negócio, por intermédio do senhor Antônio Luís de Mello e Souza, investimentos de fundos de previdência complementar, dentre eles, Petros e Postalis, que juntos possuem 48,32% do fundo de investimentos utilizado como veículo para captação de recursos, o Fundo de Investimento em Participações (FIP) Bioenergia.

O FIP Bioenergia, com início de operação em 6 de abril de 2011, surgiu seguindo um projeto de arquitetura empresarial visando alavancar desempenho das empresas do Grupo Canabrava. Conforme seu regulamento, o FIP Bioenergia tem como administrador o BNY Mellon Serviços Financeiros Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A.; e como gestor a Artis Gestora de Recursos S.A. (nova denominação social da ASM Administradora de Recursos S.A.), tendo como diretor e responsável do FIP perante a CVM o senhor Antônio Luís de Mello e Souza.

O regulamento do FIP prevê a captação de R\$800.000.000,00 (oitocentos milhões de reais), representado por 8.000 (oito) mil quotas, ao preço de subscrição. Todavia, foram adquiridas 6.710 quotas, sendo as últimas adquiridas entre janeiro e março de 2014, conforme relatório publicado no site da CVM. Naquele momento o patrimônio do FIP estava em R\$ 663.838.035,12. De acordo com o último relatório, referente a setembro de 2015, o patrimônio saltou para R\$ 815.058.591,17.

O FIP Bioenergia desde o início mostrava-se um investimento de alto risco, baseado em premissas muito otimistas, investindo em um setor que enfrentava enormes dificuldades, o sucro-alcooleiro. É importante destacar, que as empresas do grupo Canabrava já operavam em prejuízo quando o fundo foi criado e tinha como premissa para ser rentável, dentre outros aspectos pouco factíveis a manutenção de uma desoneração tributária. Portanto, não era uma alternativa de investimento adequada para fundos de pensão.

Além disso, tem como gestora uma asset que havia se envolvido em uma operação escandalosa, que foi objeto da segunda maior multa já aplicada pela CVM e que havia sido suspensa de operar no mercado de capitais por sete anos, estando operando em função de liminar obtida na justiça. Chama a atenção o fato do BNY Mellon, administrador do FIP Bioenergia e administrador fiduciário de

toda a carteira do Postalis ter contratado como gestora desse FIP uma Asset com o histórico aqui apresentado que, no mínimo, apresentava um risco de imagem para aquele banco e para os fundos de pensão.

A ASM Asset Management, a mesma gestora do FIP Bioenergia, geriu um fundo de investimento chamado ASM FDIC FCVS, que captou, entre 2004 e 2005, R\$ 354 milhões, de acordo com informações publicadas pela imprensa, sendo a maior parte de fundos de pensão. Entre seus cotistas estavam a Petros, Postalis, Real Grandeza (Furnas e Eletronuclear), Celos (Centrais Elétricas de Santa Catarina), Regius (Banco Regional de Brasília), Faceb (Cia. Energética de Brasília), Fioprev (Fundação Oswaldo Cruz) e Portus (Docas). Uma empresa ligada à PUC Rio, a Fundação Padre Leonel Franca, avaliou os títulos FCVS pertencentes à Rioprevidência (fundo de previdência público do Estado do Rio de Janeiro), à época, em R\$ 181 milhões.

Esses títulos foram comprados por quatro pessoas físicas (Eduardo Jorge Chame Saad, Fernando Teixeira de Mello, José de Vasconcellos e Silva e Olímpio Uchoa Vianna), que agiram por meio da empresa Estratégia Investimentos para obter as cotas em leilão. A Estratégia foi a única participante do leilão e comprou as cotas por R\$ 135 milhões, equivalentes a 24.716 contratos. No mesmo dia do leilão, a Estratégia vendeu parte dos contratos adquiridos por R\$ 135,49 milhões aos investidores. Entre janeiro e maio de 2005, os investidores venderam créditos para a Nominal DTVM que os repassou para o fundo ASM FIDC FCVS por um valor total de R\$ 354 milhões. A primeira destas operações ocorreu ainda no mesmo dia do leilão, quando 4.596 contratos foram vendidos para a Nominal por R\$ 142,2 milhões e em seguida repassados para o FDIC por R\$ 142,36 milhões. Além destas operações, os investidores usaram parte dos créditos para adquirir cotas do ASM FIDC FCVS.

A ASM, por meio de duas empresas distintas (ASM Asset Management DTVM e ASM Administradora de Recursos Ltda.) assessorou o Estado do Rio de Janeiro no leilão, de um lado, e captou recursos dos fundos de pensão, de outro lado. Em síntese, ele participou da compra e da venda. Três fundos de pensões aplicaram R\$ 135 milhões antes do leilão ser realizado, dentre eles o Postalis, que aplicou R\$ 80 milhões. A soma das aplicações é exatamente o que as pessoas físicas pagaram no leilão. Os demais fundos de pensão entraram depois, sendo que parcela desses ativos foram posteriormente vendidos para os fundos de pensão com ágio de aproximadamente 160%, por meio do FIDC ASM FCVS, (cujas cotas foram adquiridas pelos fundos de pensão).

A CVM, por intermédio do Processo Administrativo Sancionador CVM nº 6/2007, considerou a negociação ilícita, uma vez que 4 quatros investidores individuais tiveram lucros de mais de R\$ 200 milhões em 2005. O lucro total das operações chegou a R\$ 132,29 milhões para Eduardo Saad, os demais investidores auferiram lucros individuais de cerca de R\$ 27 milhões cada. CVM aplicou aos participantes desse negócio, em 2010, a 2ª maior multa da história dessa Autarquia, no montante de R\$ 504 milhões a nove envolvidos e suspendeu por sete anos o registro de administrador de carteira da ASM Asset Management DTVM e de Antônio Mello. A maior multa foi para o investidor Eduardo Saad, no valor de R\$

264,585 milhões. A CVM aplicou multa de R\$ 54,095 milhões para Fernando Teixeira de Mello, de R\$ 55,301 milhões para José de Vasconcellos e Silva, de R\$ 56,105 milhões para a Olímpio Uchoa Vianna e de R\$ 1,197 milhão para a Estratégia Investimentos.

O BNY Mellon, além de não atentar para uma decisão da CVM sobre a empresa gestora, que ocorrera meses antes da criação do FIP Bioenergia, aplicou nesse fundo recursos do Postalís em limite superior ao permitido pela Resolução nº 3.792/2009 do CMN, que é de 25% do patrimônio do FIP, infringindo cláusula do seu contrato com aquele fundo de pensão e o expondo às sanções da PREVIC.

As empresas do grupo Canabrava vêm apresentando prejuízos sistemáticos, estando algumas delas com passivo a descoberto. Todavia, o patrimônio do FIP está em R\$ 815 milhões, tendo em vista sua atualização ser feita com base critério pré-fixado e não na realidade do investimento. Em depoimento a esta CPI o Senhor Ludovico Giannattasio afirmou que o Patrimônio Líquido (PL) das empresas estava em R\$ 670 milhões. Todavia, os dados dos últimos balanços apontam um PL total de pouco mais de R\$ 100 milhões. O Senhor Antônio Melo acumula as funções de gestor do FIP e dirigente das empresas o que parece representar um conflito de interesses.

Para se ter uma ideia no descontrole e indícios de, no mínimo, graves crimes contra o sistema financeiro, o Conselho de Administração do FIP apenas foi criado em 2014, por exigência da Petros. Questionada por esta CPI acerca do valor patrimonial da Canabrava Participações S.A., que o FIP detém 99,99% das ações, a Petros informou que "não temos a informação, pois as Demonstrações Financeiras da Canabrava Participações S.A. não foram emitidas".

Diante dos fatos e informações apuradas por esta Comissão Parlamentar de Inquérito em audiência de oitiva do Sr. Antônio Luís de Mello e Souza em 17 de novembro de 2015 e de Ludovico Giannattasio em 8 de dezembro de 2015 nesta Casa Legislativa, faz-se oportuno o acesso a tais informações para o regular prosseguimento dos trabalhos investigativos.

Ante o exposto, contamos com o apoio dos nobres pares para a aprovação deste requerimento.

Sala das Comissões, em 16 de dezembro de 2015.

Dep. Sérgio Souza
PMDB/PR