

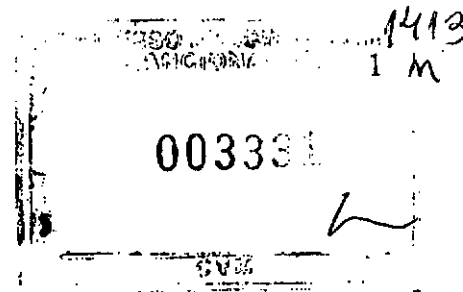
DOC. 33

(Ofício 007/2014 enviado à CVM
por EDUARDO CUNHA)

Impresso por: 170.1335.901-47 AC 4044
Em: 08/09/2014 11:59:28



CVM Comissão de Valores Mobiliários
Protegendo quem investe no futuro do Brasil



OFÍCIO/CVM/SPS/Nº529/2013

Rio de Janeiro, 22 de novembro de 2013

A Sua Excelência o Senhor
EDUARDO COSENTINO DA CUNHA
Deputado Federal
Gabinete Eduardo Cunha
At.: Luciana
Câmara dos Deputados
Anexo IV - Gabinete 510
Brasília - DF - 70160-900

Assunto: Solicitação de informações

Exmo. Sr. Deputado Federal,

Em continuidade às informações encaminhadas pela Presidência da Comissão de Valores Mobiliários (CVM), conforme Ofício/CVM/PTE/Nº132/2013, a Superintendência de Processos Sancionadores (SPS), no uso de suas atribuições legais e regulamentares e em estrito cumprimento de seus respectivos deveres, considerando, ainda, a manifestação contida no Ofício 165/2013/CAB-510, vem solicitar os bons préstimos de V. Exa. no sentido de designar dia, hora e local para a realização de vossa oitiva pessoal, observando-se, assim, todas as prerrogativas inerentes ao relevante cargo público ocupado por V.Exa.

Alternativamente, e visando onerar minimamente a certamente atribulada agenda de V. Exa., esclarecemos que, caso lhe seja mais conveniente, e em substituição a vossa oitiva pessoal, poderão ser apenas respondidas por escrito e encaminhadas a esta SPS as perguntas abaixo formuladas.

Com relação à vossa atuação nos mercados futuros de Dólar Americano e Índice Bovespa da Bolsa de Mercadorias e Futuros (BM&F), no período de abril de 2004 a setembro de 2005:



CVM *Comissão de Valores Mobiliários*
Protegendo quem investe no futuro do Brasil

003333

11413
2/6 M

1. Quais atividades profissionais, e em quais instituições, V.Exa. exercia no período de abril de 2004 a setembro de 2005?
2. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Prece Previdência Complementar ("Prece"), especialmente no período de abril de 2004 a setembro de 2005?
3. Qual o grau de relacionamento e contato de V. Exa. com pessoas que trabalhavam na Prece, em especial com Paulo Alves Martins, Magda das Chagas Pereira e Ubiratan de Gusmão Campelo Lima?
4. Com quais dirigentes da Cedae – Companhia Estadual de Águas e Esgotos (Rio de Janeiro) V.Exa. se relacionava no período de abril de 2004 a setembro de 2005?
5. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com pessoas que trabalhavam no Postalís – Instituto de Seguridade Social dos Correios e Telégrafos, em especial com Helio Afonso Pereira e Adilson Florêncio da Costa?
6. Quem cuidava dos investimentos de V.Exa. em mercados futuros da BM&F, no período de abril de 2004 a setembro de 2005?
7. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Laeta S. A. DTVM ("Laeta")?
8. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Cruzeiro do Sul Corretora de Mercadorias Ltda. ("Cruzeiro do Sul CM")?
9. Qual o grau de relacionamento e contato de V. Exa. com Lucio Bolonha Funaro?
10. Qual o grau de relacionamento e contato de V. Exa. com Sergio Guaraciaba Martins Reinas?
11. Qual o grau de relacionamento e contato de V. Exa. com Ricardo Caldas Ferreira, Suzanne Marie Meyer Ferreira e Raymond Francis Meyer?
12. Quais os motivos que levaram V. Exa. a ser cliente da Laeta, quem o apresentou e quem o atendia nessa instituição?
13. Quais os motivos que levaram V. Exa. a ser cliente da Cruzeiro do Sul CM, quem o apresentou e quem o atendia nessa instituição?
14. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Quality S. A. CCTVM?

OFÍCIO/CVM/SPS/Nº 529/2013



CVM Comissão de Valores Mobiliários
Protegendo quem investe no futuro do Brasil

003393

3/6

1416
m

15. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com David Jesus-Gil Fernandez, Marcos César de Cássio Lima e Flávio Mário Machado dos Santos?
16. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Kerson Business Corp?
17. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Global Trend Investment LLC ("Global Trend")?
18. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a SCFN Strategy Capital and Finance e o Dartmouth International Group?
19. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Teletrust de Recebíveis S.A., em especial com Jorge Gurgel Fernandes Neto?
20. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Allegro CV?
21. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Stocklos Avendis Ltda. (antiga Erste Banking Empreendimentos, Intermediações e Participações Ltda.)?
22. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a Quantia DTVM Ltda., em especial com Lauro Jose Senra de Gouvêa, Joaquim Candido de Gouvêa e Alexandre Gastaldel Leonardo?
23. Qual o grau de relacionamento de V. Exa. com a NK Prestação de Serviços Sociedade Simples Ltda., em especial com Leonardo Paes Borba e Ricardo Tochikazo Nakatsu?
24. Por quem era feita a transmissão de ordens em nome de V. Exa. à Laeta, para operações em mercados futuros da BM&F, no período de abril de 2004 a fevereiro de 2005? Qual o meio de transmissão utilizado?
25. Quem, na Laeta, recebia as ordens transmitidas em nome de V. Exa. para operações em mercados futuros da BM&F, no período de abril de 2004 a fevereiro de 2005?
26. Por quem era feita a transmissão de ordens em nome de V. Exa. à Cruzeiro do Sul CM, para operações em mercados futuros da BM&F, no período de março a setembro de 2005? Qual o meio de transmissão utilizado?

OFÍCIO/CVM/SPS/Nº 529/2013



CVM *Comissão de Valores Mobiliários*
Protegendo quem investe no futuro do Brasil

003384

14/6 M

1417

27. Quem, na Cruzeiro do Sul CM, recebia ordens transmitidas em nome de V. Exa. para operações em mercados futuros da BM&F, no período de março a setembro de 2005?
28. Lucio Bolonha Funaro tinha autorização para transmitir ordens em nome de V. Exa. à Laeta e à Cruzeiro do Sul CM?
29. V.Exa. realizou algum depósito inicial na Laeta e na Cruzeiro do Sul CM, antes de começar a operar? Em caso positivo, quais os valores e datas?
30. Qual a estratégia de investimento adotada por V.Exa. nas operações realizadas no mercado futuro de dólar da BM&F, no período de abril de 2004 a setembro de 2005?
31. Qual a estratégia de investimento adotada por V.Exa. nas operações realizadas no mercado futuro de índice Bovespa da BM&F, no período de abril de 2004 a setembro de 2005?
32. Como V.Exa. definia o momento de entrada e saída nos mercados futuros da BM&F, no período de abril de 2004 a setembro de 2005?
33. V.Exa. acompanhava o andamento dos pregões e o cumprimento de suas ordens nos mercados futuros da BM&F, no período de abril de 2004 a setembro de 2005? Em caso positivo, qual o meio utilizado? A que atribui o desempenho de V. Exa. na obtenção de "ajustes do dia" em mercado futuro de Dólar Americano na BM&F, operando por intermédio da Laeta, no período de 27 de abril de 2004 a 25 de fevereiro de 2005, sempre em operações *day-trade*, com resultado financeiro bruto positivo de R\$ 422.900,00 e taxa de sucesso de 100%, conforme Quadro I anexo (onde constam os conceitos de "ajuste do dia" e "taxa de sucesso")?
34. A que atribui o desempenho de V. Exa. na obtenção de "ajustes do dia" em mercado futuro de Índice Bovespa na BM&F, operando por intermédio da Laeta, no período de 14 de abril a 25 de novembro de 2004, com resultado financeiro bruto positivo de R\$ 494.490,00 e taxa de sucesso de 83%, conforme Quadro II anexo?
35. A que atribui o desempenho de V. Exa. na obtenção de "ajustes do dia" em mercado futuro de Dólar Americano na BM&F, operando por intermédio da

OFÍCIO/CVM/SPS/Nº 529/2013



CVM Comissão de Valores Mobiliários

Protegendo quem investe no futuro do Brasil

1418
5/6 m
003388

Cruzeiro do Sul CM, no período de 28 de março a 30 de maio de 2005, sempre em operações *day-trade*, com resultado financeiro bruto positivo de R\$ 130.000,00 e taxa de sucesso de 100%, conforme Quadro III anexo?

36. A que atribui o desempenho de V. Exa. na obtenção de "ajustes do dia" em mercado futuro de Índice Bovespa na BM&F, operando por intermédio da Cruzeiro do Sul CM, no período de 30 de maio a 6 de setembro de 2005, com resultado financeiro bruto positivo de R\$ 57.120,00 e taxa de sucesso de 56%, conforme Quadro IV anexo?
37. Informar nome completo, documento de identidade, CPF, estado civil, profissão, endereço, telefone e e-mail.

Esclarecemos, por fim, que caso V. Exa. opte por responder por escrito as questões supramencionadas estas deverão ser encaminhadas aos cuidados desta SPS, localizada na Rua 7 de Setembro, 111, 26º andar, Rio de Janeiro, RJ, CEP 20050-901. Havendo qualquer esclarecimento que se faça necessário, não hesite entrar em contato com o subscritor do presente, no telefone (21) (3554-8533) ou por e-mail sps@cvm.gov.br.

Ressaltamos que os assuntos tratados no presente são de caráter sigiloso, consoante disposto na Lei nº 6.385/76.

CARLOS GUILHERME DE PAULA AGUIAR

SUPERINTENDENTE DE PROCESSOS SANCIONADORES

OFÍCIO/CVM/SPS/Nº 529/2013



CVM Comissão de Valores Mobiliários

Protegendo quem investe no futuro do Brasil

ANEXO

00338

1419 M

Operações de EDUARDO COSENTINO DA CUNHA na BM&F no período de abril de 2004 a setembro de 2005:

CÓPIA ENVIADA AO QUADRO I

QUADRO II

LAETA DTVM				DÓLAR FUTURO		
data	Série	cp	vd	ajuste	G	P
27-abr-04	MAI4	100	100	30.000,00	1	-
28-mai-04	JUL4	50	50	42.000,00	1	-
28-mai-04	JUN4	50	50	42.500,00	1	-
25-jun-04	AGO4	100	100	13.500,00	1	-
25-jun-04	JUL4	100	100	22.500,00	1	-
28-jun-04	AGO4	100	100	75.500,00	1	-
26-jul-04	AGO4	100	100	47.500,00	1	-
22-nov-04	JAN5	120	120	47.400,00	1	-
28-jan-05	FEV5	200	200	50.000,00	1	-
25-fev-05	ABR5	100	100	27.000,00	1	-
25-fev-05	MAR5	100	100	25.000,00	1	-
TOTAIS				422.900,00	11	
TAXA DE SUCESSO				100%		

Fonte: BM&F

LAETA DTVM				IBOVESPA FUTURO		
data	Série	cp	vd	ajuste	G	P
14-abr-04	ABR4	255	255	61.650,00	1	-
14-abr-04	JUN4	250	250	110.700,00	1	-
15-abr-04	JUN4	760	760	36.450,00	1	-
16-abr-04	JUN4	160	160	79.200,00	1	-
26-abr-04	JUN4	300	300	54.000,00	1	-
19-mai-04	JUN4	20	20	(8.400,00)	-	1
25-mai-04	JUN4	150	150	41.250,00	1	-
17-jun-04	AGO4	385	385	35.700,00	1	-
18-jun-04	AGO4	130	130	29.700,00	1	-
23-jun-04	AGO4	150	150	49.500,00	1	-
25-nov-04	DEZ4	10	-	5.880,00	1	-
01-dez-04	DEZ4	20	-	(1.140,00)	-	1
TOTAIS				494.490,00	10	2
TAXA DE SUCESSO				83%		

Fonte: BM&F

QUADRO III

QUADRO IV

CRUZEIRO DO SUL CM				DÓLAR FUTURO		
data	Série	cp	vd	ajuste	G	P
28-mar-05	ABR5	100	100	50.000,00	1	-
27-abr-05	MAI5	200	200	60.000,00	1	-
30-mai-05	JUN5	100	100	20.000,00	1	-
TOTAIS				130.000,00	3	
TAXA DE SUCESSO				100%		

Fonte: BM&F

CRUZEIRO DO SUL CM				IBOVESPA FUTURO		
data	Série	cp	vd	ajuste	G	P
30-mai-05	JUN5	40	40	34.500,00	1	-
09-jun-05	JUN5	40	40	(10.500,00)	-	1
28-jun-05	AGO5	50	50	10.800,00	1	-
29-jun-05	AGO5	50	50	(10.650,00)	-	1
28-jul-05	AGO5	55	55	(6.150,00)	-	1
29-ago-05	OUT5	30	30	13.500,00	1	-
30-ago-05	OUT5	40	40	14.550,00	1	-
31-ago-05	OUT5	-	10	(1.110,00)	-	1
06-set-05	OUT5	50	40	12.180,00	1	-
TOTAIS				57.120,00	5	4
TAXA DE SUCESSO				56%		

Fonte: BM&F

Observações:

- "Ajustes do Dia" é a somatória dos ajustes das operações realizadas em um mesmo pregão, calculados pela fórmula:
 $AD = (PAT - PO) \times M \times n$, onde: AD = valor do ajuste do dia; PAT = preço (em pontos) de ajuste do dia;
 PO = preço (em pontos) da operação; M = valor em reais de cada ponto, estabelecido pela BM&F; n = nº de contratos.
- Séries diferentes negociadas no mesmo pregão são consideradas como pregões diferentes.
- Taxa de sucesso é o percentual de pregões com resultado positivo em relação ao total de

OFÍCIO/CVM/SPS/Nº 529/2013



Câmara dos Deputados
Deputado Federal
Eduardo Cunha

4420
000557
M

SECRETARIA DE ADMINISTRAÇÃO

00333

CVM

Ofício GAB: 510 nº 007/2014

Cópia enviada ao

Brasília-DF, 08 de janeiro de 2014.

Prezados,

Com relação ao ofício CVM/SPS/Nº 529/2013, tenho a esclarecer o que se segue: Se desejar a minha oitiva pessoal, poderei fazê-lo no dia 25/02, às 08h00min horas no Gabinete da Liderança PMDB, no prédio principal da Câmara dos Deputados.

Se a título de antecipação, passo a algumas considerações sobre os quesitos apontados:

Item 1 – Deputado Federal desde 01/02/2003 até a presente data;

Itens 2, 3, 5, 10, 11, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20, 21, 22, 23 – Nenhum;

Item 4 – Pela posição de Deputado Federal no Estado do Rio de Janeiro, obviamente me relacionava com todos os dirigentes de empresas e Secretário, sem exceção. Aliás, os Diretores atuais são os mesmos dessa época, menos o diretor Presidente, que à época era Secretário de Estado;

Item 6 – Eu mesmo;

Itens 7 e 8 – Somente clientes;

Item 9 – Apenas conheço;

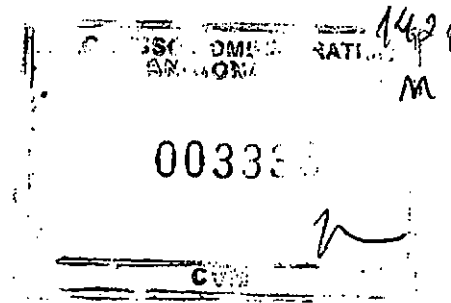
Item 12 e 13- Nenhum motivo específico, não me lembro como fui apresentado. Pelo longo período já passado, é impossível recordar o fato, assim como de quem me atendia nessa instituição, porque nunca era um operador específico. Causa estranheza que essa autarquia após 10 anos dos fatos queira que uma pessoa com atividade tão intensa como a minha, tenha esse tipo de recordação, por melhor que seja minha memória;

Item 24 – Por mim mesmo, via telefone. Numa possível eventualidade, alguma ordem por e-mail ou fax. Pelo tempo decorrido em que essa autarquia faz esses questionamentos, fica difícil precisar se teve alguma ordem que não tenha sido efetuada via telefone. O mais fácil seria pedir as gravações das ordens à corretora;

CUM GERENCIA DE DOCUMENTAÇÃO RJ 15/JAN/2014 09:37



Câmara dos Deputados
Deputado Federal
Eduardo Cunha



Item 25 – Mais uma vez me estranha essa autarquia querer exigir de uma pessoa que tem atividade profissional tão intensa como a minha, recordar desses detalhes, por melhor que seja a minha memória. Entretanto não era ninguém específico, tanto que não me recordo. Obviamente para dar mais celeridade às ordens era a primeira pessoa que atendia ao telefone na mesa de operações da corretora;

Item 26 – Por mim mesmo, via telefone, numa possível eventualidade alguma ordem por e-mail ou fax, mas pelo excesso de demora dessa autarquia nesses questionamentos fica difícil precisar se teve alguma ordem, o mais óbvio me parece ser solicitar a instituição, que acredito eu, deve manter todos esses arquivos, a não ser que os prazos estejam prescritos;

Item 27 – A primeira pessoa que atendia ao telefone na mesa, para dar mais agilidade à execução das ordens;

Item 28 – Nunca teve qualquer procuração pública minha, ou qualquer tipo de instrumento, como é natural para se praticar esse tipo de ato;

Item 29 – Impossível me recordar de um detalhe desses passados 10 anos;

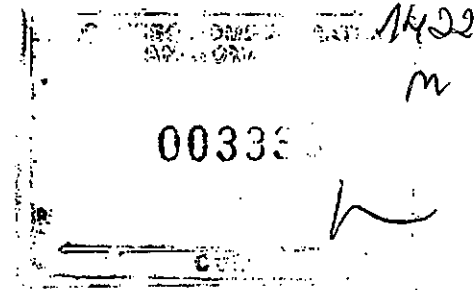
Item 30 e 31 – Nunca utilizei estratégia, sempre utilizei minha formação acadêmica, aliada a minha experiência no Mercado com meu sentimento do Mercado no momento e para o próximo período curtíssimo de tempo para a tomada de posições;

Item 32 – Tinha parâmetros próprios para entrar e sair do Mercado para cada posição aberta, sempre tinha preço de stop loss, o que limitava o meu risco e limitava dentro do intra day o meu lucro. Sempre era informado da abertura, fechamento ou aumento do lote de uma posição;

Item 33 – O cumprimento das ordens sim, como já informei anteriormente em várias questões pelo telefone, o andamento do pregão não, porque como disse minhas ordens sempre tinham stop loss ou preço de abertura e de stop loss. Eu nem sempre operava day trade, essas foram as operações por essa autarquia pinçadas, não acho que no universo de 8 pregões ter um acerto de 100% dentro de um período de 10 meses seja grande. Quando opero estou convicto da posição que estou abrindo, por isso que meu índice de acerto é grande. A taxa de sucesso representa pouco porque a amostra é pequena num tempo muito longo;



Câmara dos Deputados
Deputado Federal
Eduardo Cunha



Item 34 – Todas as minhas operações foram declaradas ao IR e recolhidas todas as obrigações tributárias correspondentes. Se pude ter rendimentos positivos, é porque fui eficiente na avaliação de conjunturas, não tenho como me recordar de situações antigas e inclusive fora do prazo de prescrição do IR, onde sequer tenho mais qualquer documentação ou registro. Além disso foram selecionadas 12 operações em 8 meses, sem verificar outras posições se estava ou não fazendo hedge, se tive ou não outros prejuízos. Lamento questionar parte dos detalhes das minhas operações 10 anos depois.

Item 35 – Aqui a situação é mais esdrúxula porque se examina uma amostra de 3 pregões com 100% de acerto e se acha um grande acerto, quando a probabilidade é de 33% se fossem abertas todas as posições no mesmo dia. Pelo visto para essa autarquia o que está chamando a atenção é o índice de acerto, não importando o tamanho da amostra e nem o período decorrido. Me estranharia se em 360 pregões consecutivos eu ganhasse 360 vezes, e mesmo assim como agente Fiscalizador ainda iria analisar se não seria hedge, o que pelo que vi não foi feito por essa autarquia;

Item 36 – A um desempenho inferior ao obtido nas questões 33, 34, 35, além da amostra ser maior em relação ao período, do que as outras analisadas.

Acho estranho esse tipo de questionamento, não entendo a sua motivação e relembro que não assiste amparo legal para me investigar fora da minha prerrogativa de foro.

Sem mais para o momento, despeço-me

Atenciosamente,

EDUARDO CUNHA

Deputado Federal

Ilmo. Sr.

Carlos Guilherme de Paula Aguiar

CVM – Comissão de Valores Mobiliários

Rua Sete de Setembro, 111 – 2º andar.

Centro – Rio de Janeiro/RJ

003340

1423

m

Géométrie

COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CHEFIA DE GABINETE DA PRESIDÊNCIA
PROTOCOLO DE SERVIÇO EXTERNO

OFICIO/CVM/PTE/Nº 132/2013

DESTINATÁRIO:

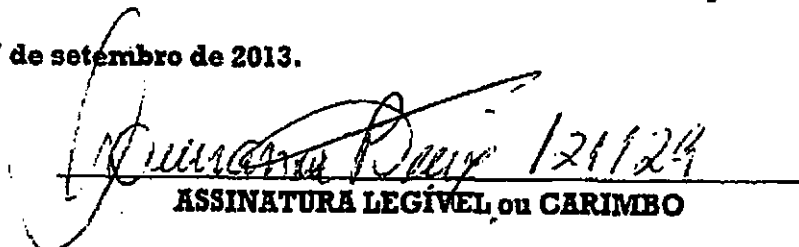
Sr. Eduardo Consentino da Cunha
Deputado Federal
QD SQS 311 - Aptº 604 - Bloco I - Asa Sul
Brasília / DF

PEO - Sra. Cristiane Brotherhood - Malote CVM/Brasília

REMETENTE:

Dr. Leonardo P. Gomes Pereira
Presidente da Comissão de Valores Mobiliários
Rua Sete de Setembro, 111 - 32º and. - Centro / 20050-901 - Rio de Janeiro - RJ

DATA: 11 de setembro de 2013.


ASSINATURA LEGÍVEL ou CARIMBO



CVM Comissão de Valores Mobiliários



EXPEDIÇÃO DE CORRESPONDÊNCIA - EDC

HORA	DATA	COMP. ORG.
	03/09/13	CGP

ESPÉCIES / NÚMERO	DESTINATÁRIO	ENDEREÇO	TIPO
OFÍCIO/CVM/PTE/Nº 132/13	Sr. Eduardo Consentino da Cunha, Deputado Federal	QD SQS 311 – Aptº 604 – Bloco I – Asa Sul – Brasília – DF PEO – Sra. Cristiane Brotherhood	Malote Brasilia
			CAM GERENCIA DE DOCUMENTACAO RJ
			03 SET 2013 15:42
PREPARADO POR	VISTO POR	RECEBIDO POR	
<i>Marielza Cândida de Freitas</i>		- 3 SET. 2013	

AS: 9/9/13

Impresso por: 110.725.907-47
Em: 08/09/2016 - 11:34:00 AM

CVM | SEDE | RJ
JORGE D. OLIVEIRA
Mat 7.000.653

00334
M

1424

1425
M

00334

Acha Nº CGP:

Entrada de Correspondência

Nº CGP:	Data de Entrada	Documento
1092	10/06/2013	Fax OF. Nº 165/2013/GAB-510

Origem:
Eduardo Cunha, Deputado Federal - Câmara dos Deputados

Interessado/Remetente
Eduardo Cunha

Assunto
Refere-se ao OFÍCIO/CVM/SPS/Nº 298/2013, assinado pelo Superintendente Pablo W. Renteria/SPS, solicitando informações.

Data	Providência	Destinatário:				
10/06/2013	Para ciência e adoção de providências cabíveis. At. Gustavo	SPS/Pablo				
		<table border="1"> <tr> <th>Prazo:</th> <th>Follow-Up:</th> </tr> <tr> <td>0</td> <td>10/06/2013</td> </tr> </table>	Prazo:	Follow-Up:	0	10/06/2013
Prazo:	Follow-Up:					
0	10/06/2013					

Observações

Impresso por: 110.735.907-17 AC 4044
Em: 08/09/2016 14:59:28

