

MPF oferece denúncia contra cartel que manipulou taxa de risco cambial

YAHOO!

Claudio Tognolli

Yahoo Notícias 24 de julho de 2017



Foto: Rafael Neddermeyer/ Fotos Públicas

Funcionários de cinco bancos integravam o grupo que manteve artificialmente o spread, aumentando o lucro das instituições em operações milionárias de câmbio

O Ministério Público Federal denunciou cinco ex-funcionários de grandes bancos internacionais, que operavam no mercado de câmbio offshore, pelo crime de formação de cartel. O grupo ajustou uma margem de spread comum (diferença entre o preço de compra e venda de moeda estrangeira) em Contratos a Prazo com Liquidação Financeira (Non-Deliverable Forwards Real/NDF), que são operações de compra e venda de dólar utilizadas principalmente como garantia (hedge) para evitar as consequências de eventuais flutuações de câmbio.

Além de operarem com margem de spread igual, os ex-funcionários dessas cinco instituições estrangeiras (Standard Chartered, Royal Bank of Canada (RBC), Merrill Lynch, Deutsche Bank e Morgan Stanley)

criaram obstáculos para a atuação de corretores e operadores de câmbio que não participaram do ajuste criado por eles, que inflacionou artificialmente o mercado durante três semanas no mês de novembro de 2009, aumentando o lucro desses bancos em operações milionárias de câmbio.

Para o procurador da República Rodrigo de Grandis, integrante do Grupo de Combate à Cartéis do Ministério Público Federal em São Paulo, autor da denúncia, os cinco acusados, Eduardo Hargreaves, Sergio Correia Zanini, Renato Lustosa Giffoni, Pablo Frisanco de Oliveira e Daniel Yuzo Shimada Kajiya, que tinham entre 27 anos e 35 anos de idade, quando praticaram o delito, incorreram no crime de formação de cartel por meio da fixação artificial de preços para o controle regionalizado do mercado (artigo 4º, inciso II, alíneas “a” e “b” da lei de crimes tributários). Se condenados, os acusados poderão receber penas de 2 a 5 anos de prisão e multa.

O ajuste do spread cambial praticado pelos cinco operadores no mercado de NDF começou a ser debatido por parte deles no dia 28 de outubro de 2009 e a fixação artificial do spread na cotação de -5/+5 começou a ser praticada nos dias 3 e 4 de novembro. A prática de cartel foi mantida até 25 de novembro de 2009, quando foi abandonada unilateralmente por alguns integrantes do grupo.

Além do ajuste do spread, o grupo atuava de modo a impedir que corretores que não concordassem com o spread praticado não participasse das operações de câmbio por eles realizadas. Os operadores diziam que quem tentasse atravessar o preço por eles praticado ou oferecesse outra tabela não conseguiria trabalhar, pois iria “para a geladeira”. Outro integrante do chat dizia que se aparecesse um “gerson (esperto) é fácil descobrir”.

O quinteto utilizava um grupo fechado de chat da plataforma da Bloomberg, batizado por eles de “Butter the Comedian”. Quando começaram a tratar da ideia, eles utilizavam um grupo aberto, o que alertou um deles, que chegou a dizer que manter a conversa naquele canal poderia dar em “SEC”, sigla em inglês para Securities Exchange Commission, órgão americano que fiscaliza operações no mercado de valores.

A previsão estava certa, pois a operação foi denunciada ao CADE (Conselho Administrativo de Defesa Econômica) anos mais tarde por uma das instituições financeiras envolvidas, que fez um acordo de leniência com o órgão. O CADE, por sua vez, acionou o grupo de combate a cartel do MPF, que abriu um procedimento investigatório criminal para investigar a prática anticoncorrencial em 2015.

Durante a investigação, um dos ex-funcionários envolvidos no episódio, Pablo Oliveira, confessou espontaneamente a sua participação. O MPF pediu que seja reconhecida a sua condição de colaborador e que sua pena seja fixada em um terço do mínimo previsto e que ele tenha direito à suspensão condicional do processo, caso confirme em juízo sua confissão.

Outros seis operadores de câmbio que trabalhavam em outras instituições financeiras e que também participaram do chat na plataforma mencionada foram investigados, mas o MPF pediu o arquivamento das acusações contra eles, uma vez que não foram encontradas provas de que no período em que houve o ajuste de preços, eles teriam se envolvido na prática. A denúncia foi protocolada na última quarta-feira (19) e distribuída para a 7ª Vara Federal Criminal na última quinta-feira (20).