

# BOLETIM INFORMATIVO – 0011/2018

## Publicações relacionadas a Gerenciamento de Riscos

Novembro/2018

### Banco Central do Brasil



#### PUBLICADOS

**Título:** Carta Circular nº 3.916, 09/11/2018

Data/Hora Documento: 09/11/2018 14:57

Assunto: Altera o **Leiaute** e as Instruções de preenchimento do documento de código 2061 - **Demonstrativo de Limites Operacionais (DLO)**, de que trata a Carta Circular nº 3.663, de 27 de junho de 2014.

**Resumo:** As alterações passam a vigorar a partir da da-base de **Novembro de 2018**. Foram alteradas nomes e descrição de contas e incluído grupo de contas 891 que detalham as parcelas do IRRBB para abordagem padronizada ou modelo interno.

Responsável: DESIG

**Título:** Circular nº 3.916, 22/11/2018

Data/Hora Documento: 22/11/2018 10:00

Assunto: Define e consolida as regras do **recolhimento compulsório sobre recursos a prazo**.

**Resumo:** Definiu e consolidou as **contas COSIF** que compõem o **Valor Sujeito a Recolhimento (VSR)** e a metodologia de **cálculo para recolhimento compulsório** sobre recursos a prazo.

Responsável: SECRE

**Título:** Circular nº 3.917, 22/11/2018

Data/Hora Documento: 22/11/2018 10:01

Assunto: Define e consolida as regras do **recolhimento compulsório sobre recursos à vista**.

**Resumo:** Definiu-se as **contas COSIF** que compõem o **Valor Sujeito a Recolhimento (VSR)** e a metodologia de **cálculo para recolhimento compulsório** sobre recursos à vista.

Responsável: SECRE

**Título:** Resolução nº 4.698, 27/11/2018

Data/Hora Documento: 27/11/2018 18:07

Assunto: **Altera a Resolução nº 4.677**, de 31 de julho de 2018, que estabelece **limites máximos de exposição por cliente e limite máximo de exposições concentradas**.

**Resumo:** Altera **critérios para estimar a exposição** para o cálculo dos limites.

#### CONSULTA PÚBLICA

Não há consultas públicas em aberto relacionadas ao tema de Riscos.

## Comissão de Valores Mobiliários



### PUBLICADOS

Não houve publicações relacionadas ao tema de Riscos.

### CONSULTA PÚBLICA

#### Título: Audiência Pública SDM 05/2018

Tema: Alterações na Instrução CVM nº 505/2011 (normas e procedimentos a serem observados nas operações realizadas com valores mobiliários em mercados regulamentados de valores mobiliários), e revogação da Instrução CVM nº 380/2002 (normas e procedimentos a serem observados nas operações realizadas em bolsas e mercados de balcão organizado por meio da rede mundial de computadores).

Prazo para manifestação: **30/11/2018**

**Resumo:** A Minuta propõe inclusão de dispositivos que visam **aprimorar os mecanismos de controles internos** dos intermediários no que se refere a eventos de risco operacional relacionados à **interrupção de processos críticos e a falhas de segurança da informação**.

Entre as medidas e os deveres propostos estão: desenvolvimento de um plano de continuidade de negócios, tratamento e controle de dados de clientes, segurança cibernética e contratação de serviços prestados por terceiros.

Adicionalmente, introduz novas regras relativas a arquivamento de documentos, aperfeiçoamento da qualidade das informações prestadas no relatório de controles internos, fortalecimento da governança no contexto dos controles internos, introdução de novas definições, provimento de maior detalhamento quanto aos meios de transmissão de ordens.

Em relação à **vigência**, sugere-se um **prazo de 180 dias** para a entrada em vigor da norma.

## Superintendência de Seguros Privados



### PUBLICADOS

Não houve publicações relacionadas ao tema de Riscos.

### CONSULTA PÚBLICA

Não há consultas públicas em aberto relacionadas ao tema de Riscos.

## BIS – Bank for International Settlements



BANK FOR INTERNATIONAL SETTLEMENTS

*BCBS Publications*

### **PUBLICADOS**

**Publicação:** *Implementation of Basel standards - A report to G20 Leaders on implementation of the Basel III regulatory reforms* (<https://www.bis.org/bcbs/publ/d453.htm>)

Data: 23/11/2018

**Resumo:** Comitê de Supervisão Bancária de Basileia apresentou relatório para líderes do G20 apresentando o status de implementação do Acordo de Basileia III dos 27 membros.

O Brasil cumpre em sua totalidade com a regulação para capital baseado em riscos e para o indicador de liquidez de curto prazo (LCR). O indicador de liquidez de longo prazo (NFSR) e limites máximos de exposição por cliente e de exposição concentrada possuem expectativa de estarem completamente implementados até o primeiro semestre de 2019.

A Arábia Saudita é a única jurisdição que implementou 100% do Acordo de Basileia III até o momento.

**Publicação:** *Incentives to centrally clear over-the-counter (OTC) derivatives*

(<https://www.bis.org/publ/othp29.htm>)

Data: 19/11/2018

**Resumo:** Este documento consultivo produzido em conjunto pelo *Financial Stability Board* (FSB), pelo Comitê de Basileia de Supervisão Bancária (BCBS), pelo Comitê de Pagamentos e Infraestrutura de Mercado (CPMI) e pela Organização Internacional de Comissões de Valores Mobiliários (IOSCO) examina os efeitos das reformas regulatórias do G20 sobre os incentivos de compensação central de derivativos de balcão.

O relatório conclui que as reformas - particularmente os requisitos de capital, mandatos de compensação e exigências de margem para derivativos não compensados centralmente - estão atingindo seus objetivos de promover a compensação central, especialmente para os participantes de importância sistêmica do mercado. Isso é consistente com o objetivo de reduzir a complexidade e melhorar a transparência e a padronização nos mercados de derivativos de balcão. Contudo, fora do núcleo de importância sistêmica, os efeitos são menos fortes. Desse modo, o relatório identifica algumas áreas de atuação que podem merecer consideração especial pelos Comitês de Supervisão.

Esse documento ficou sob consulta pública em Agosto/2018.