

BOLETIM INFORMATIVO – 0005/2018

Publicações relacionadas a Gerenciamento de Riscos

Maio/2018

Banco Central do Brasil



PUBLICADOS

Título: Circular nº 3.899, 17/5/2018

Data/Hora Documento: **17/5/2018 18:02**

Assunto: Altera a Circular nº 3.862/2017, que estabelece os **procedimentos** para o **cálculo da parcela dos ativos ponderados pelo risco na forma simplificada** (RWAS5) referente às exposições ao **risco de crédito** sujeitas ao cálculo do requerimento de capital mediante abordagem padronizada (RWACSimp).

Responsável: SECRE

Título: Carta Circular nº 3.882, 25/5/2018

Data/Hora Documento: **25/5/2018 12:07**

Assunto: Altera a redação da Carta Circular nº 3.853/2017, que detalha rubricas contábeis a serem utilizadas no **cálculo da parcela dos ativos ponderados pelo risco na forma simplificada** (RWAS5) no que se refere ao **risco de crédito**.

Responsável: Dereg

CONSULTA PÚBLICA

Continua em andamento a consulta pública comentada no Boletim Informativo 0003/2018:

Publicação: Edital 61/2018

Divulga minuta de circular que dispõe sobre a implantação de **Comitê de Governança** em arranjos de pagamento.

Data de início da consulta: 26/03/2018

Data final da consulta: 21/07/2018

Comissão de Valores Mobiliários



PUBLICADOS

Não houve publicações relacionadas ao tema de Riscos.

CONSULTA PÚBLICA

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

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



BCBS Publications

PUBLICADOS

Publicação: *Criteria for identifying simple, transparent and comparable short-term securitisations*
(<https://www.bis.org/bcbs/publ/d441.htm>)

Data: 14/05/2018

Resumo: A proposição de critérios (17 no total) tem como objetivo auxiliar o setor financeiro a desenvolver estruturas de securitização de curto prazo simples, transparentes e comparáveis (STC) e permitir que envolvidos e investidores avaliem os riscos desse tipo de securitização em comparação a produtos similares. Os critérios levam em consideração as características dos ABCPs (*Asset-backed commercial paper*), tais como:

- (a) O curto prazo de vencimento do título emitido;
- (b) As diferentes formas de estrutura dos programas;
- (c) A existência de múltiplas formas de liquidez e facilidades de suporte de crédito.

Ressalta-se que os critérios não são exaustivos e que as partes interessadas devem considerar critérios adicionais e mais detalhados conforme suas necessidades e aplicações específicas.

Publicação: *Capital treatment for simple, transparent and comparable short-term securitisations*
(<https://www.bis.org/bcbs/publ/d442.htm>)

Data: 14/05/2018

Resumo: Este documento estabelece diretrizes e requisitos adicionais com o objetivo de aplicar o tratamento de capital regulatório preferencial para os bancos que atuam como investidores ou patrocinadores de estruturas de securitização STC de curto prazo. Uma vez atendidos esses requisitos adicionais, a mesma redução de capital aplicável às demais estruturas de securitização STC poderá ser aplicada às de curto prazo.

As orientações e os requisitos adicionais definem que:

- Os investidores tenham acesso mensal a informações de desempenho e características-chave da estrutura ABCP (*asset-backed commercial paper*);
- O patrocinador deve fornecer suporte cobrindo 100% do valor nominal das notas emitidas contra quaisquer perdas;
- O risco de resgate dos ativos subjacentes seja abordado sob a perspectiva do patrocinador; e
- As transações financiadas pelo canal tenham uma estrutura legal exigível e que informações relevantes estejam disponíveis e sejam divulgadas pelo patrocinador aos investidores.

O Comitê esclarece que a implementação dessa estrutura não é mandatória. As jurisdições que considerarem que os custos superam os potenciais benefícios podem optar por não implementar.

BIS – Bank for International Settlements



BCBS Publications

CONSULTA PÚBLICA

Continua em andamento a consulta pública comentada no Boletim Informativo 0003/2018:

Publicação: *Revisions to the minimum capital requirements for market risk*

(<https://www.bis.org/bcbs/publ/d436.htm>)

Data de início da consulta: 22/03/2018

Data final da consulta: 20/06/2018