

BOLETIM INFORMATIVO – 0006/2018

Publicações relacionadas a Gerenciamento de Riscos

Junho/2018

Banco Central do Brasil



PUBLICADOS

Título: Circular nº 3.904, 6/6/2018

Data/Hora Documento: **6/6/2018 18:00**

Assunto: Estabelece os procedimentos para o **cálculo do valor da exposição relativa ao risco de crédito da contraparte** decorrente de operações com **instrumentos financeiros** derivativos sujeita ao cálculo do requerimento de capital mediante **abordagem padronizada** (RWACPAD), de que trata a Resolução nº 4.193/2013.

Responsável: SECRE

Esta Circular entra em vigor em **1º de junho de 2019**.

Título: Comunicado nº 32.139, 7/6/2018

Data/Hora Documento: **7/6/2018 18:00**

Assunto: Divulga o valor do **Adicional Contracíclico de Capital Principal** relativo ao Brasil (ACCPBrasil).

Responsável: SECRE

Resumo: O Comitê de Estabilidade Financeira (Comef) decidiu manter inalterado o valor atualmente fixado em 0%.

Título: Circular nº 3.905, 21/6/2018

Data/Hora Documento: **21/6/2018 18:00**

Assunto: Altera a Circular nº 3.869/2017, que estabelece a metodologia de **apuração do indicador Liquidez de Longo Prazo** (NSFR) e a Circular nº 3.749/2015, que estabelece a **metodologia de cálculo do indicador Liquidez de Curto Prazo** (LCR).

Responsável: SECRE

As alterações na metodologia do LCR entram em vigor na **data da publicação** e as alterações da apuração do NSFR entram em vigor em **1º de outubro de 2018**.

Título: Comunicado nº 32.251, 29/6/2018

Data/Hora Documento: 29/6/2018 10:07

Assunto: Comunica às instituições financeiras e demais instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil, optantes pelo **Segmento 5** (S5), a disponibilização para consulta do **cálculo do requerimento mínimo** de que trata a Resolução nº 4.606/2017.

Responsável: DESIG

Título: Carta Circular nº 3.890, 29/6/2018

Data/Hora Documento: 29/6/2018 16:24

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 3.663/2014.

Responsável: DESIG

Banco Central do Brasil



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: *Progress in adopting the "Principles for effective risk data aggregation and risk reporting"* (<https://www.bis.org/bcbs/publ/d443.htm>)

Data: 21/06/2018

Resumo: O Comitê de Basileia publicou seu mais recente relatório contendo o **status de implementação dos Princípios para uma efetiva agregação de dados e reporte de risco** pelos bancos.

Os resultados baseiam-se em pesquisa de autoavaliação respondida por autoridades supervisoras de **instituições sistemicamente importantes em nível global (G-SIBs)** e contemplam os avanços alcançados em 2017.

Esforços foram direcionados, contudo observou-se que a maioria das G-SIBs teve progresso marginal na implementação desses princípios, em relação ao estágio detectado em 2016, devido principalmente à complexidade e à interdependência dos projetos de melhoria de TI.

Considerando o estágio de implementação detectado e com o objetivo de promover a adoção desses princípios, o Comitê fez as seguintes recomendações:

- Os bancos devem continuar a implementar os Princípios de acordo com as metas planejadas acordadas com seus supervisores, considerando também como a implementação beneficiaria outras iniciativas e requisitos relacionados a dados;
- Os supervisores devem manter ênfase em assegurar que os bancos implementem integralmente os Princípios. Isso inclui reuniões em 2018 com os conselhos de administração e/ou alta administração dos bancos para receber atualizações sobre o progresso da implementação. Adicionalmente, devem manter a cooperação entre supervisores.

O Comitê continuará a monitorar o progresso dos G-SIBs na adoção dos Princípios e planeja conduzir a próxima avaliação em 2019.

Publicação: *Treatment of extraordinary monetary policy operations in the Net Stable Funding Ratio* (<https://www.bis.org/bcbs/publ/d444.htm>)

Data: 29/06/2018

Resumo: O Comitê de Basileia publicou um **documento técnico complementar** referente ao tratamento de operações extraordinárias de política monetária do banco central para retirada de **liquidez** do mercado.

A alteração apresentada para essas operações permite que os créditos do banco central possam utilizar um fator FRS (Fator de Ponderação de Recursos Requeridos) reduzido, sendo que aqueles com prazo de vencimento residual igual ou superior a seis meses, o fator FRS não deve ser inferior a 5%.

CONSULTA PÚBLICA

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