

CARTA-CIRCULAR 3.376

Dispõe sobre procedimentos para a remessa das informações relativas às exposições ao risco de mercado, de que trata a Circular nº 3.429, de 2009.

A remessa das informações de que trata o art. 1º da Circular nº 3.429, de 14 de janeiro de 2009, deve ser realizada por meio do Demonstrativo de Risco de Mercado (DRM), conforme a codificação do Catálogo de Documentos (Cadoc), apresentada no anexo a esta Carta-Circular.

2. O DRM deve ser remetido ao Banco Central do Brasil - Departamento de Monitoramento do Sistema Financeiro e de Gestão da Informação (Desig), por meio do aplicativo PSTAW10 (intercâmbio de informações), na forma da Carta-Circular nº 2.847, de 13 de abril de 1999, disponível para download na página do Banco Central do Brasil na Internet (<http://www.bcb.gov.br/?PSTAW10>).

3. O arquivo do DRM deve ser:

I - elaborado no formato XML (eXtensible Markup Language);

II - validado, antes de sua remessa, utilizando o esquema de validação XSD (XML Schema Definition).

4. Os modelos do DRM, em formato Excel, os leiautes do DRM, em formato XML, as instruções de preenchimento, os arquivos exemplo, os esquemas de validação XSD e o programa validador estão disponíveis na página do Banco Central do Brasil na Internet, no endereço <http://www.bcb.gov.br/htms/pstaw10docs.asp>.

5. As instituições que atenderem aos critérios de dispensa para a remessa dos documentos mencionados no item 1, previstos nos incisos III e V do § 1º do art. 1º da Circular nº 3.429, de 2009, devem registrar comunicação informando a partir de qual data-base deixará de remeter o documento.

6. A forma de registro da comunicação referida no item anterior será estabelecida em comunicado específico a ser divulgado pelo Desig.

7. A instituição responsável por consolidado econômico-financeiro integrado somente por instituições financeiras ou instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil também pode registrar comunicação, nos termos referidos no item 5, para liberá-la da remessa do documento de código 2060.

8. As instituições dispensadas ou liberadas da remessa do DRM, que deixarem de registrar a comunicação referida nos itens 5 e 7, sujeitam-se às penalidades previstas na legislação vigente, desde a data-limite para a remessa até a data do registro da comunicação.

9. A remessa dos documentos referidos no item 1 deve ser retomada quando ocorrer a perda da condição para a dispensa ou para a liberação, ficando as instituições obrigadas a registrar comunicação informando a partir de qual data-base tornará a remeter o documento

10. A utilização dos modelos, dos leiautes, das instruções de preenchimento, dos arquivos exemplo, dos esquemas de validação e do programa validador do DRM, em função de quaisquer ajustes realizados, deve ser adotada na forma estabelecida em comunicado específico.

11. Devem ser registrados e mantidos atualizados no Sistema de Informações sobre Entidades de Interesse do Banco Central (Unicad) os dados referentes ao:

I - diretor responsável referido no art. 10 da Resolução nº 3.464, de 26 de junho de 2007;

II - empregado indicado para responder a eventuais questionamentos sobre o DRM da instituição.

12. Fica revogada a Carta-Circular nº 3.312, de 28 de abril de 2008.

Brasília, 9 de fevereiro de 2009.

Departamento de Monitoramento do Sistema Financeiro e de Gestão da Informação (Desig)

Cornélio Farias Pimentel
Chefe de Unidade

Anexo

Codificação do Catálogo de Documentos - Cadoc
Demonstrativo de Risco de Mercado (DRM)

Instituição Financeira não pertencente a Conglomerado Financeiro (mediante a utilização do Documento de Código 2040, para transferência de arquivos no Programa PSTAW10):

- a) 05.1.3.010-2, para as Agências de Fomento ou de Desenvolvimento;
- b) 12.1.3.270-8, para as Associações de Poupança e Empréstimo;
- c) 20.1.3.268-0, para os Bancos Comerciais;
- d) 21.1.3.001-4, para as Sociedades Corretoras de Câmbio;
- e) 22.1.3.268-8, para os Bancos de Desenvolvimento;
- f) 24.1.3.474-9, para os Bancos de Investimento;
- g) 26.1.3.270-1, para os Bancos Múltiplos;
- h) 27.1.3.000-8, para os Bancos de Câmbio;
- i) 28.0.3.640-3, para o Banco Nacional de Desenvolvimento Econômico e Social;
- j) 38.1.3.001-4, para a Caixa Econômica Federal;
- k) 39.1.3.031-2, para as Companhias Hipotecárias;

- l) 43.1.3.004-7, para as Cooperativas Centrais de Crédito;
- m) 44.1.3.267-3, para as Cooperativas de Crédito;
- n) 45.1.3.003-8, para as Confederações de Cooperativas de Crédito;
- o) 77.1.3.268-8, para as Sociedades de Arrendamento Mercantil;
- p) 79.1.3.467-7, para as Sociedades Corretoras de Títulos e Valores Mobiliários;
- q) 81.1.3.268-1, para as Sociedades de Crédito, Financiamento e Investimento;
- r) 83.1.3.270-6, para as Sociedades de Crédito Imobiliário; e
- s) 85.1.3.467-8, para as Sociedades Distribuidoras de Títulos e Valores Mobiliários.

Conglomerados Financeiros (mediante a utilização do Documento de Código 2050, para transferência de arquivos no Programa PSTAW10):

- a) 42.1.3.267-5, para os Conglomerados Financeiros, optantes pela apuração de limites em bases consolidadas.

Consolidados Econômico-financeiros (mediante a utilização do Documento de Código 2060, para transferência de arquivos no Programa PSTAW10):

- a) 41.1.3.001-8, para os Consolidados Econômico-financeiros, conforme Resolução 2.723/2000.