

Assunto: Orientações sobre vinculação de ativos

Objetivo: Manual operacional para Supervisionadas, detalhando questões de vinculação nas diversas Câmaras de Custódia.

Este manual contém 4 páginas numeradas.

Coordenação de Monitoramento de Ativos Financeiros e Macroprudencial – COMAP

MANUAIS OPERACIONAIS DOS SISTEMAS SELIC e B3 (Listado e Balcão)

Estes manuais foram obtidos a partir de contato com a B3 e Selic.

A. Manual operacional sobre vinculação de ativos em conta de reserva técnica da B3 (Listado e Balcão)

Este manual foi disponibilizado pela B3, consta no link abaixo e é apresentado a seguir:

[https://www.b3.com.br/data/files/13/86/10/C1/4994E7108BD66BD7AC094EA8/OC%20001-2022%20PRE%20Procedimentos%20Movimenta%C3%A7%C3%A3o%20de%20Ativos%20de%20Titularidade%20de%20Entidades%20Supervisionadas%20pela%20Susep%20Carteira%20de%20Reserva%20T%C3%A9cnica%20\(P\).pdf](https://www.b3.com.br/data/files/13/86/10/C1/4994E7108BD66BD7AC094EA8/OC%20001-2022%20PRE%20Procedimentos%20Movimenta%C3%A7%C3%A3o%20de%20Ativos%20de%20Titularidade%20de%20Entidades%20Supervisionadas%20pela%20Susep%20Carteira%20de%20Reserva%20T%C3%A9cnica%20(P).pdf)

“11 de janeiro de 2022 001/2022-PRE

O F Í C I O C I R C U L A R

Participantes do Listado e Balcão B3

Ref.: Procedimentos para Movimentação de Ativos de Titularidade de Entidades Supervisionadas pela Susep para Carteira de Reserva Técnica

Fazemos referência ao Ofício Circular Eletrônico Nº 1/2022/COMAP/CGMOP/DIR4/SUSEP, por meio do qual a Superintendência de Seguros Privados (Susep) comunica às entidades supervisionadas a implantação, na Central Depositária da B3 – Listado B3, da carteira “Reserva Técnica Susep” (já existente no Balcão B3), para vinculação de ativos de titularidade dessas entidades para cobertura de provisões técnicas, bem como a determinação de que as entidades procedam à movimentação de ativos para referida carteira. Em vista disso, a B3 informa aos agentes de custódia ou à própria entidade supervisionada que seja participante os seguintes procedimentos que deverão ser adotados, mediante instrução das respectivas entidades supervisionadas pela Susep para as quais prestem serviços:

- (i) conceder autorização à B3 para informar à Susep as posições da respectiva entidade mantidas na carteira de reserva técnica;

- (ii) realizar as movimentações de ativos de titularidade das entidades, a fim de constituir ou extinguir garantia de provisões técnicas requeridas pela Susep.

O detalhamento destes procedimentos, incluindo aqueles que já são adotados pelos participantes do Balcão B3, consta do Anexo deste Ofício Circular e dos normativos emitidos pela B3 que regulam suas atividades de Central Depositária e de registradora de ativos.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Depositária e Operações de Balcão pelo telefone (11) 2565-5040 ou pelos e-mails depositaria.listados@b3.com.br e operacaobalcao@b3.com.br.

Coordenação de Monitoramento de Ativos Financeiros e Macroprudencial – COMAP

Anexo do Ofício Circular 001/2022-PRE

1. Procedimentos para autorização do fornecimento de informações à Susep

1.1. Listado B3

A autorização deverá ser registrada pelo agente de custódia ou pela própria entidade supervisionada que seja participante, por meio do sistema SDH – Serviço de Dados Históricos, no menu Reguladores, opção Susep, devendo ser indicadas as contas de custódia da entidade supervisionada que deverão estar contempladas no arquivo diário de posições enviado à Susep.

1.2. Balcão B3

A autorização deverá ser registrada pela entidade supervisionada participante, por meio do sistema NoMe no menu Administração de Participantes > Manutenção > Informações aos Órgãos Reguladores, indicando as contas que deverão estar contempladas nos arquivos diários de posição disponibilizados à Susep.

2. Procedimentos para a movimentação de ativos para a constituição de garantia de reserva técnica – Listado e Balcão B3

Conforme disposto nos normativos que regulam as atividades da Central Depositária da B3 – Listado e Balcão B3 e as atividades de registro de ativos no Balcão B3, a B3 oferece uma estrutura de carteiras que permite a segregação de ativos de titularidade das entidades supervisionadas pela Susep para finalidades específicas, dentre elas a segregação de ativos em garantia de reserva técnica, visando cumprimento da legislação e da regulamentação aplicáveis à Susep

O agente de custódia, mediante instrução da entidade supervisionada, ou, caso aplicável, a própria entidade supervisionada que seja participante, devem instruir a movimentação de ativos aceitos para constituição de reserva técnica para a carteira segregada para esse propósito, conforme previsto nos normativos da B3 e detalhado a seguir.

2.1 Fluxo de alocação de ativos em carteira de reserva técnica – Listado B3

O agente de custódia ou a entidade supervisionada devem instruir diretamente no sistema CAC, via tela, arquivo ou mensagem, o débito dos ativos mantidos na carteira de livre movimentação (2101-6) de titularidade da entidade supervisionada para a carteira de reserva técnica correspondente (Susep 2903-3). Essas transferências poderão ser efetivadas mediante validação da Susep, dependendo da configuração preliminar que a autarquia tenha atribuído às movimentações solicitadas pela respectiva entidade supervisionada.

2.2 Fluxo de alocação de ativos em carteira de reserva técnica – Balcão B3

A entidade supervisionada deve instruir diretamente na plataforma NoMe, via tela ou arquivo, o débito dos ativos mantidos na conta de livre movimentação para a conta destinada a receber os ativos em garantia de reserva técnica (97).

Coordenação de Monitoramento de Ativos Financeiros e Macroprudencial – COMAP

3. Fluxo de remoção de ativos da carteira de reserva técnica – Listado e Balcão B3

O agente de custódia ou a própria entidade supervisionada que seja participante devem instruir a movimentação dos ativos mantidos na estrutura de carteiras de reserva técnica para a posição livre, conforme previsto nos normativos da B3 e detalhado a seguir.

3.1 Fluxo de remoção de ativos da carteira de reserva técnica – Listado B3

O agente de custódia ou a própria entidade supervisionada devem instruir diretamente no sistema CAC, via tela, arquivo ou mensagem, o débito dos ativos de titularidade da entidade supervisionada, mantidos na carteira de reserva técnica (Susep 2903-3), para a carteira de livre movimentação (2101-6). Essas transferências poderão ser efetivadas mediante validação da Susep, dependendo da configuração preliminar que a autarquia tenha atribuído às movimentações solicitadas pela respectiva entidade supervisionada.

3.2 Fluxo de remoção de ativos da carteira de reserva técnica para ativos mantidos no ambiente de registro e/ou no Balcão da Central Depositária da B3

O agente de custódia ou a própria entidade supervisionada devem instruir diretamente na plataforma NoMe, via tela ou arquivo, o débito dos ativos mantidos na conta de reserva técnica (97) para a conta de livre movimentação. Essas transferências poderão ser efetivadas mediante validação da Susep, dependendo da configuração preliminar que a autarquia tenha atribuído às movimentações solicitadas pela respectiva entidade supervisionada.”

B. Manual operacional sobre vinculação de ativos em conta de reserva técnica da SELIC

O Manual do Usuário do Selic (MUS), disponível no portal do Selic (<https://www.rtm.selic.gov.br/portal-selic/>) na área de Documentação/Manuais, contém as orientações acerca do assunto mencionado.

Em particular, a vinculação de títulos públicos federais em conta de ativos garantidores está descrita no item 8.1 do capítulo VII – Vinculações 1013 (página 184).

Já a descrição completa da conta encontra-se no item 4.5 do capítulo IV- Contas (página 40).

FIM