



5 de maio de 2022
006/2022-PRE

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

Ref.: **Descontinuação do compartilhamento de alertas pela BSM, referente às alíneas a e g, do inciso II, do artigo 20, da Resolução CVM 50.**

A B3 divulga, por solicitação da BSM Supervisão de Mercados, a descontinuação do compartilhamento de alertas pela BSM, referente às alíneas a e g, do inciso II, do artigo 20, da Resolução CVM 50, de 31 de agosto de 2021, conforme Comunicado Externo BSM – 9/2022 anexo a esta comunicação.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos pelo telefone (11) 2565-6074 ou e-mail bsm@bsmsupervisao.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

4 de maio de 2022

BSM-9/2022

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento Listado

Ref.: Descontinuação do Compartilhamento de Alertas pela BSM, referente às alíneas a e g, do inciso II, do artigo 20, da Resolução CVM nº 50, de 31 de agosto de 2021 (“RCVM 50”)

1. Em outubro de 2017, a BSM Supervisão de Mercados (“BSM”) iniciou o compartilhamento de alertas com os Participantes de operações com indícios de situações representadas pelas alíneas a e g, do inciso II, do artigo 20, da RCVM 50 (“Compartilhamento de Alertas”). O intuito dessa atividade, à época, foi de apoiar os Participantes de mercado do segmento Listado em relação às obrigações trazidas pelas normas de prevenção à lavagem de dinheiro, ao financiamento do terrorismo e ao financiamento da proliferação de armas de destruição em massa (“PLD/FTP”).

2. O Compartilhamento de Alertas foi motivado pelo dever imposto pelos artigos 6º e 7º, da Instrução CVM nº 301/1999 (posteriormente revogada pela Instrução CVM nº 617/2019 e, mais recentemente, substituída pela RCVM 50), vigente à época, especificando os tipos de indícios e operações que deveriam ser observados pelos agentes de mercado e ratificando a forma de comunicação às autoridades públicas. Tais dispositivos, hoje, estão refletidos nos artigos 20, 22 e 23, da RCVM 50.

3. O que se observa, desde então, nas auditorias realizadas pela BSM, é que os Participantes empreenderam esforços para a implementação dos seus próprios controles no âmbito da PLD/FTP, assim como era esperado pela norma.

Com base em um levantamento realizado pela BSM, em outubro de 2021, envolvendo 63 Participantes¹, foi constatado que: (i) 100% dos Participantes possuem plataforma sistêmica contratada para a supervisão de PLD/FTP; (ii) 100% dos Participantes possuem filtros de supervisão próprios de PLD/FTP; (iii) 75% dos Participantes utilizam, complementarmente, as informações disponibilizadas pela BSM² no respectivo monitoramento de *money pass*³; (iv) 52% dos Participantes utilizam sistemas alternativos como ferramenta de supervisão de PLD/FTP; e (v) 48% utilizam sistemas próprios desenvolvidos internamente pelas suas instituições para o cumprimento de seus deveres regulamentares à norma de PLD/FTP.

4. A partir da vigência da Instrução CVM nº 617/2019 (atual RCVM 50), contudo, foi introduzido no ordenamento brasileiro o conceito de Abordagem Baseada em Risco (ABR) no âmbito da PLD/FTP, segundo o qual cada Participante deve possuir uma avaliação de risco personalizada, adequada para os riscos identificados e individualizada para cada situação, avaliação essa que pode variar de acordo com o perfil de seus clientes, produtos oferecidos e volumes operados.

5. Disso decorre que uma solução padronizada, como foi a introdução do Compartilhamento de Alertas disponibilizado pela BSM, passou a ter seu alcance limitado à luz da nova regulação, além do fato de que o Compartilhamento de Alertas se propôs a auxiliar os Participantes em relação às obrigações

¹ Representando a totalidade dos Participantes de mercado do segmento Bolsa).

² Cada Participante deve avaliar, analisar e tratar as informações enviadas pela BSM de acordo com sua Abordagem Baseada em Risco.

³ A prática de *money pass* é caracterizada pela transferência de recursos através de operações no mercado de capitais previamente acordadas entre dois indivíduos. O objetivo dessa prática irregular é que, tendo em vista o alto número de operações diárias no mercado de capitais, o *money pass* se “camufla” no meio de operações regulares e dificulte a identificação de sua prática pelas autoridades reguladoras e autorreguladoras.

estabelecidas unicamente em 2 alíneas, de um inciso, de um artigo⁴, sendo que os Participantes ainda deveriam observar o cumprimento de todos os outros dispositivos expressos na norma.

6. Dessa forma, a BSM comunica ao mercado que, conforme alinhamento feito com a CVM e com a Câmara Consultiva de Mercado da BSM, descontinuará o Compartilhamento de Alertas **a partir de 1º de janeiro de 2023**, devendo cada Participante adaptar, até essa data, seus sistemas e controles internos, se assim for necessário, para detecção de operações que apresentem indícios lavagem de dinheiro, financiamento do terrorismo e financiamento da proliferação de armas de destruição em massa, além de realizar as devidas análises, conclusões e comunicações para o COAF, CVM e demais autoridades competentes, quando necessário.

7. A BSM aproveita para reforçar a importância do contínuo aprimoramento de controle dos Participantes no monitoramento, supervisão e análise de operações com indícios de irregularidades no âmbito da PLD/FTP, e ratifica seu papel de autorregulador dos mercados organizados da B3, destacando a relevância do tema em suas auditorias regulares e específicas junto aos Participantes.

8. Oportunamente, serão divulgados eventos ao mercado sobre boas práticas de detecção, tratamento e análise de operações com indícios de atipicidades no âmbito da PLD/FTP.

⁴ Faz-se, aqui, referência às alíneas a e g, do inciso II, do artigo 20 da RCVM 50, que, por sua vez, refletem, especificamente, às operações cursadas nos mercados organizados da B3 “realizadas entre as mesmas partes ou em benefício das mesmas partes, nas quais haja seguidos ganhos ou perdas no que se refere a algum dos envolvidos” e “realizadas com a aparente finalidade de gerar perda ou ganho para as quais falte, objetivamente, fundamento econômico ou legal”.

9. A BSM se coloca à disposição do mercado para realização de cursos que sejam necessários e demandados pelas instituições e destaca aos Participantes que, para o melhor cumprimento das normas vigentes, devem ser feitos treinamentos aos departamentos envolvidos, como Operações, Produtos, Relacionamento, Risco, *Compliance*, Cadastro, TI, e do envolvimento da alta administração para fixação do tema na condução da cultura organizacional de cada Participante.

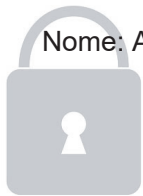
10. Nessa linha, a BSM se faz disponível para auxiliar e atender, no que for possível, empresas e pessoas dedicadas ao desenvolvimento de *softwares* destinados ao monitoramento de operações com indícios de irregularidades no âmbito da PLD/FTP, bem como aproveita para informar que a metodologia utilizada para padronização e identificação de operações com indícios de irregularidades está disponível no site da BSM⁵.

11. Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Acompanhamento de Mercado da BSM, pelo telefone (11) 2565-6074 ou e-mail bsm@bsmsupervisao.com.br.

Atenciosamente,

André Eduardo Demarco
Diretor de Autorregulação

⁵ Disponível em: <https://www.bsmsupervisao.com.br/assets/file/Rotina-PLDFT.pdf>.



:Documento assinado por
Nome: ANDRE EDUARDO DEMARCO
Data: 04/05/2022 16:14:56