

CVM desenvolve projetos de supervisão do mercado com base em inteligência de dados

13.12.2022 2 minutos de leitura

Autores

Felipe Palhares

Fernanda Villela

Áreas relacionadas

Proteção de Dados e
Cybersecurity

Assuntos

CVM Tributário Proteção de
Dados e Cybersecurity Felipe
Palhares

Conforme publicado no dia 7 de novembro, a Comissão de Valores Mobiliários (CVM) adotou novas ferramentas de análise e automatização de dados para a supervisão do mercado. São os Projetos Insiders e Outliers, que visam detectar e analisar padrões que passariam despercebidos por ferramentas manuais, segundo Jorge Casara (Gerente de inteligência em supervisão de riscos estratégicos da CVM).

O Projeto Insiders foi desenvolvido com base no Acordo de Cooperação Técnica entre a CVM e o Tribunal de Contas da União (TCU), pelo qual a CVM obteve acesso a dados pertinentes à Administração Pública. Atualmente, a CVM realiza a identificação dos *insiders* primários, como diretores e administradores de companhias. A nova ferramenta visa ampliar este escopo de supervisão, identificando o envolvimento de parentes de 1º grau em operações suspeitas, os chamados *insiders* secundários.

A CVM também desenvolveu o Projeto Outliers para a identificação de "pontos fora da curva" no rendimento de fundos de investimento e na volatilidade de suas cotas. Novamente, a CVM se valeu da automatização do tratamento de dados, dispensando análises manuais. A fim de identificar discrepâncias nos dados fornecidos pelos regulados, a CVM coletará dados históricos dos fundos de investimento e classificação do rendimento de suas cotas.

Para ler sobre os Projetos Insiders e Outliers no portal da CVM, clique aqui.

Para ler o Acordo de Cooperação Técnica entre a CVM e o TCU, clique aqui.

Profissionais que aliam visão jurídica e visão de mercado



Felipe Palhares



Fernanda Villela