



BANCO CENTRAL DO BRASIL

Tabela CCR1: Análise das exposições ao risco de crédito de contraparte (CCR) por abordagem utilizada

Objetivo: Fornecer visão geral da abordagem utilizada para o cálculo do requerimento de capital para o risco de crédito de contraparte em operações de derivativos, operações compromissadas e operações de empréstimo de ativos, e fornecer os principais parâmetros empregados, conforme estabelecido na Circular nº 3.809, de 2016, e nos Anexos I e II da Resolução BCB nº 229, de 2022.

Não devem ser incluídas as exposições a contrapartes centrais (CCPs), que devem ser reportadas na tabela CCR8.

Conteúdo: Exposições sujeitas ao risco de crédito de contraparte, montante dos ativos ponderados pelo risco (RWA) e seus parâmetros de cálculo.

Frequência: Semestral.

Formato: Fixo.

Comentários: Devem ser explicados os principais determinantes de mudanças significativas em relação à divulgação anterior.

		a	b	d	e	f
		Valor de reposição	Exposição potencial futura	Alpha empregado no cômputo da EAD regulatória	EAD pós-mitigação	RWA
1	Abordagem SA-CCR			1.4		
1.1	Abordagem CEM					
3	Abordagem Simples - mitigação do CCR (operações compromissadas e empréstimo de ativos)					
4	Abordagem Abrangente - mitigação do CCR (operações compromissadas e empréstimo de ativos)					
6	Total					



BANCO CENTRAL DO BRASIL

	Instruções de preenchimento
	Linhas 2 e 5 e coluna "C" excluídas por não serem aplicáveis ao Brasil.