



BANCO CENTRAL DO BRASIL

Tabela CCR6: Informações sobre o risco de crédito de contraparte associado a derivativos de crédito

Objetivo: Informar as exposições associadas a derivativos de crédito.

Conteúdo: Valor de nocional e valor justo dos derivativos de crédito (risco transferido e risco recebido), antes da compensação entre as posições vendidas e compradas.

Frequência: Semestral.

Formato: Fixo para colunas. As linhas podem ser alteradas para refletir os valores das exposições associadas a derivativos de crédito.

Comentários: Devem ser divulgados comentários adicionais para explicar mudanças significativas entre o período informado e o período anterior, bem como os principais indutores dessas mudanças.

	a	b
	Risco transferido	Risco recebido
Valor Nocional		
Swap de crédito referenciado ao descumprimento de uma única entidade (Single-name CDS)		
Swap de crédito referenciado ao descumprimento de mais de uma entidade		
Swaps de taxa de retorno total		
Valor de nocional total		
Valor justo		
Valor justo positivo (ativo)		
Valor justo negativo (passivo)		