

Tabela CCR8: Informações sobre o risco de crédito de contraparte associado a exposições a contrapartes centrais

Objetivo: Fornecer visão abrangente das exposições a contrapartes centrais.

Conteúdo: Exposições e RWA.

Frequência: Semestral.

Formato: Fixo.

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

		a	b
		Exposição após mitigação	RWA
1	Exposições a QCCPs (total)		
2	Exposições associadas a operações a serem liquidadas em QCCPs, das quais:		
3	(i) Derivativos de balcão		
4	(ii) Derivativos padronizados		
5	(iii) Empréstimos de ativos e operações compromissadas		
I	(iv) Demais operações		
7	Colaterais financeiros constituídos, exceto como margem de variação, prontamente restituídos à instituição, em caso liquidação, falência ou providência similar das QCCPs		
8	Colaterais financeiros constituídos, exceto como margem de variação, que não sejam prontamente restituídos à instituição, em caso liquidação, falência ou providência similar das QCCPs		
9	Participação integralizada em fundos de garantia mutualizados		
10	Participação em fundo de garantia mutualizado, contingente e futuro, passível de ser exigido por QCCPs		
11	Exposições a CCPs não qualificadas (total)		
12	Exposições associadas a operações liquidadas em CCPs não qualificadas, das quais:		
13	(i) Derivativos de balcão		
14	(ii) Derivativos padronizados		
15	(iii) Empréstimos de ativos e operações compromissadas		
II	(iv) Demais operações		

17	Participação em fundos de garantia mutualizados contingente e futuro passíveis de serem exigidos por QCCPs		
18	Colaterais financeiros constituídos, exceto como margens de variação, que não sejam prontamente restituídos à instituição, em caso liquidação, falência ou providência similar das CCPs não qualificadas		
19	Participação integralizada em fundos de garantia mutualizados		
20	Participação em fundo de garantia mutualizado, contingente e futuro, passível de ser exigido por CCPs não qualificadas		

Nº da linha	Instruções de preenchimento
	Linhas 6 e 16 excluídas por não serem aplicáveis no Brasil.
1	Contraparte central qualificada (QCCP): conforme art. 67 da Resolução BCB nº 229, de 2022.
2	Exposições associadas a operações a serem liquidadas em QCCPs: os valores informados nas linhas 3, 4 e 5 consideram as transações não incluídas em acordo de compensação.
7	Colaterais financeiros constituídos, exceto como margem de variação, prontamente restituídos à instituição, em caso liquidação, falência ou providência similar das QCCPs: Margem de variação de que trata o parágrafo único do art. 4º do Anexo I da Resolução BCB nº 229, de 2022.
9	Participação em fundos de garantia mutualizados: conforme art. 67 da Resolução BCB nº 229, de 2022.
12	Exposições associadas a operações liquidadas em CCPs não qualificada: os valores informados nas linhas 13, 14 e 15 consideram as transações não incluídas em acordo de compensação.
19	Participação em fundos de garantia mutualizados: conforme art. 75 da Resolução BCB nº 229, de 2022.