

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. |