



BANCO CENTRAL DO BRASIL

Tabela CCRA: Informações qualitativas sobre o gerenciamento do risco de crédito de contraparte (CCR)

Objetivo: Descrever as principais características do gerenciamento do risco de crédito de contraparte (CCR).

Conteúdo: Informações qualitativas.

Frequência: Anual.

Formato: Flexível.

Devem ser descritas, as políticas e estratégias de gerenciamento do risco de crédito de contraparte conforme estabelecido na Resolução nº 4.557, de 2017, e na Resolução BCB nº 265, de 2022, incluindo as exposições as contrapartes centrais (CCPs), com destaque para:

- (a) O método utilizado para estabelecer os limites internos para fins do gerenciamento das exposições sujeitas ao risco de crédito de contraparte.
- (b) Políticas de avaliação do risco de crédito de contraparte, considerando garantias e outros instrumentos de mitigação.
- (c) O impacto no montante de colaterais que a instituição seria obrigada a empenhar no caso de rebaixamento da sua classificação de crédito.