



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

### Tabela MR2: Informações sobre as variações do $RWA_{MINT}$

**Objetivo:** Apresentar informações das variações dos ativos ponderados pelo risco referentes às exposições sujeitas ao risco de mercado na abordagem de modelos internos ( $RWA_{MINT}$ ), de que trata a Circular nº 3.646, de 2013, para apuração do requerimento de capital.

**Escopo:** Obrigatória para instituições que utilizem modelos internos para o cálculo do requerimento de capital para risco de mercado.

**Conteúdo:**  $RWA_{MINT}$ .

**Frequência:** Trimestral.

**Formato:** Fixa, porém podem ser adicionadas novas linhas entre as linhas 7 e 8 para divulgar elementos adicionais que expliquem variações do  $RWA_{MINT}$ .

**Comentários:** Nos casos em que o requerimento de capital para as colunas (a) ou (b), linhas 1 ou 8, não for calculado diretamente pelo modelo, mas pela média de 60 dias, deve ser adicionada linha para ajuste regulatório de forma a garantir a conciliação dos dados requerida pela tabela. 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	e	f
		VaR	VaR estressado	Outros	$RWA_{MINT}$ total
1	$RWA_{MINT}$ na data-base anterior				
2	Mudanças nos níveis de risco				
3	Atualizações e mudanças no modelo interno				
4	Metodologia e regulação				
5	Aquisições e vendas				
6	Mudanças nas taxas de câmbio				
7	Outros				
8	$RWA_{MINT}$ na data-base atual				

Nº da linha	Instruções de preenchimento
1	$RWA_{MINT}$ , de que trata a Circular nº 3.646, de 2013, na data-base do trimestre anterior ao de referência.
2	Mudanças nos níveis de risco da carteira de negociação devido a alterações nas posições mantidas pela instituição.
3	Atualizações significativas ou alterações no escopo do modelo interno, por exemplo, recalibragem.
4	Mudanças na metodologia de cálculo devido a alterações regulatórias.
5	Mudanças devido a aquisições, vendas ou alienações de linhas de produtos ou de participações societárias.



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

6	Mudanças devido a alterações nas taxas de câmbio.
7	Mudanças não atribuíveis às demais categorias. Linhas adicionais podem ser inseridas entre as linhas 7 e 8 para detalhar os principais elementos destas mudanças.
8	RWA <sub>MINT</sub> na data-base ao final do trimestre de referência. Este valor deve ser equivalente à soma das linhas 1 a 7.
<b>Cód. Coluna</b>	<b>Instruções de preenchimento</b>
	Colunas c, d, excluídas por não serem aplicáveis no Brasil.
a	Valor do VaR apurado conforme o art. 8º da Circular nº 3.646, de 2013.
b	Valor do VaR estressado apurado conforme o art. 10 da Circular nº 3.646, de 2013.
e	Parcelas do RWA <sub>MINT</sub> não reportadas nas colunas “a” e “b”.
f	RWA <sub>MINT</sub> total conforme art. 6º da Circular nº 3.646, de 2013. Este valor corresponde à soma dos valores reportados nas colunas “a”, “b”, e “e”. O valor deve ser o mesmo informado na tabela OV1, linha 22.