



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 10, 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_{DRC}				
9	RWA_{CVA}				
10	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.



BANCO CENTRAL DO BRASIL

5	Mudanças devido a aquisições, vendas ou alienações de linhas de produtos ou de participações societárias.
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 das mudanças atribuíveis às demais categorias.
8	Mudanças devido ao RWA_{DRC} , de que trata a Resolução BCB nº 313, de 2023.
9	Mudanças devido ao RWA_{CVA} , de que trata a Resolução BCB nº 291, de 2023.
10	RWA_{MINT} na data-base ao final do trimestre de referência. Este valor deve ser equivalente à soma das linhas 1 a 9.
Cód. Coluna	Instruções de preenchimento
	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_{MINT} não reportadas nas colunas “a” e “b”.
f	RWA_{MINT} 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.