



BANCO CENTRAL DO BRASIL

Tabela MR3: Valores dos modelos internos de risco de mercado

Objetivo: Informar os valores (máximo, médio, mínimo e final do trimestre) apurados pelos modelos internos de risco de mercado.

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

Conteúdo: Resultados dos modelos internos de risco de mercado para cálculo do requerimento de capital.

Frequência: Trimestral.

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
VaR (10 dias, 99%)		
1	Máximo	
2	Médio	
3	Mínimo	
4	Final do trimestre	
VaR estressado (10 dias, 99%)		
5	Máximo	
6	Médio	
7	Mínimo	
8	Final do trimestre	

Nº da linha	Instruções de preenchimento
	Linhas 9 a 17 excluídas por não serem aplicáveis no Brasil.
1 a 4	Conforme o art. 21, inciso I, alínea "a", da Circular nº 3.646, de 2013, considerando a totalidade da carteira.
5 a 8	Conforme o art. 21, inciso I, alínea "b", da Circular nº 3.646, de 2013, considerando a totalidade da carteira.