



BANCO CENTRAL DO BRASIL

Tabela SEC3: Exposições de securitização na carteira bancária e requerimentos de capital - instituição como originadora ou patrocinadora

Objetivo: Apresentar exposições de securitização classificadas na carteira bancária e os respectivos requerimentos de capital quando a instituição atua como originadora ou patrocinadora.

Conteúdo: Valores das exposições, do montante dos ativos ponderados pelo risco (RWA) e dos requerimentos de capital.

Frequência: Semestral.

Formato: Fixo.

Comentários: Devem ser explicitadas mudanças significativas em relação ao relatório anterior e os principais indutores dessas mudanças.

		a	b	c	d	e	h	i	l	m	p	q
		Valores das exposições (por faixas de FPR)					Valor agregado das exposições		RWA		Requerimento de capital	
		≤20%	20% < FPR ≤ 50%	50% < FPR ≤ 100%	100% < FPR < 1.250%	1.250%	Abordagem Padronizada	1.250%	Abordagem Padronizada	1.250%	Abordagem Padronizada	1.250%
1	Exposições totais											
2	Securitização tradicional											
3	Da qual: Securitização											
4	Da qual: com ativos subjacentes de varejo											
6	Da qual: com ativos subjacentes que não sejam de varejo											
8	Da qual: ressecuritização:											
9	Securitização sintética:											
10	Da qual: Securitização:											
11	Da qual: com ativos subjacentes de varejo											
12	Da qual: com ativos subjacentes que não sejam varejo:											
13	Da qual: ressecuritização:											

Definições



BANCO CENTRAL DO BRASIL

Linhas 5 e 7 e colunas “f”, “g”, “j”, “k”, “n” e “o” excluídas por não serem aplicáveis no Brasil.

Varejo: um ativo subjacente associado a exposição de securitização é considerado varejo quando atende aos requisitos previstos na Resolução BCB nº 229, de 12 de maio de 2022.

Ressecuritização: devem ser reportadas as exposições de securitização de que trata o inciso VIII do art. 19, da Resolução BCB nº 229, de 12 de maio de 2022.
