

ANEXO I

ANEXO II-A À RESOLUÇÃO BCB Nº 470, DE 30 DE ABRIL DE 2025

Classe de risco CSRNSEC - categorias e respectivos ponderadores para o art. 30, caput, inciso I, alínea "a"			
Classificação externa de risco de crédito do Brasil	Categoria do emissor	Setor de atuação	RW
Superior ou igual a BBB- (ou classificação equivalente)	1	Dívida Pública Federal	0,50%
	2	Governos regionais, empresas não financeiras públicas ou de capital misto, educação	1,00%
	3	Financeiro	5,00%
	4	Energia, indústria, agricultura, mineração	3,00%
	5	Bens de consumo e serviços, transporte e armazenamento, atividades administrativas e de suporte	3,00%
	6	Tecnologia, telecomunicações	2,00%
	7	Saúde, concessionárias de serviço públicos, atividades técnicas e profissionais	1,50%
	8	Títulos com características específicas (<i>covered bonds</i>)	2,50%
Inferior a BBB- (ou classificação equivalente)	9	Dívida Pública Federal	0,50%
	10	Governos regionais, empresas não financeiras públicas ou de capital misto, educação	4,25%
	11	Financeiro	5,00%
	12	Energia, indústria, agricultura, mineração	4,25%
	13	Bens de consumo e serviços, transporte e armazenamento, atividades administrativas e de suporte	8,00%
	14	Tecnologia, telecomunicações	5,00%
	15	Saúde, concessionárias de serviço públicos, atividades técnicas e profissionais	6,25%
	8	Títulos com características específicas (<i>covered bonds</i>)	5,25%

ANEXO II

ANEXO I À CIRCULAR Nº 3.876, DE 31 DE JANEIRO DE 2018

Os valores dos cenários padronizados mencionados no art. 11, medidos em pontos-base, são definidos por fator de risco, de acordo com a seguinte tabela:

Fatores de risco	$\bar{R}_{paralelo,f}$	$\bar{R}_{curto,f}$	$\bar{R}_{longo,f}$
Taxas de juros prefixadas referenciadas em reais	400	500	300
Taxas de juros pós-fixadas referenciadas em reais	400	500	300
Taxas de juros em moedas estrangeiras	Paralelo	Curto	Longo
Dólar canadense	200	275	175
Dólar dos Estados Unidos da América	200	300	225
Franco suíço	175	250	200
Euro	225	350	200
Libra esterlina	275	425	250
Iene japonês	100	100	100
Demais moedas	400	500	300