

ANEXO XVI

COMPOSIÇÃO DO CAPITAL BASEADO NO DE RISCO DE CRÉDITO

Art. 1º O capital de risco de crédito das supervisionadas será constituído de acordo com a fórmula a seguir:

$$CR_{cred} = \sqrt{CR_{cred1}^2 + CR_{cred2}^2 + 1,50 \times CR_{cred1} \times CR_{cred2}}$$

Parágrafo único. Consideraram-se, para efeitos deste anexo, os conceitos abaixo:

- I - CRcred : capital de risco de crédito;
- II - CRcred1: capital de risco de crédito referente à parcela 1; e
- III - CRcred2: capital de risco de crédito referente à parcela 2.