

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. Considerar-se-ão, para efeitos deste anexo, os conceitos abaixo:

- I - CR_{cred} - capital de risco de crédito.
- II - CR_{cred1} - capital de risco de crédito referente à parcela 1; e
- III - CR_{cred2} - capital de risco de crédito referente à parcela 2.