

Relatório de Gestão de Riscos - Circular 3930/2019 – Set/20

KM1 – Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais

	Set.20	Jun.20	Mar.20	Dez.19	Set.19	
	a	a	a	b	c	
	T	T - 1	T - 2	T - 3	T - 4	
Capital regulamentar - valores						
1	Capital Principal	1,341,624,204.46	1,296,498,156.47	1,278,882,592.45	1,245,472,492.05	1,212,258,251.34
2	Nível I	1,341,624,204.46	1,296,498,156.47	1,278,882,592.45	1,245,472,492.05	1,212,258,251.34
3	Patrimônio de Referência (PR)	1,341,624,204.46	1,296,498,156.47	1,278,882,592.45	1,245,472,492.05	1,212,258,251.34
3b	Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente	-	-	-	-	-
3c	Destaque do PR	-	-	-	-	-
Ativos ponderados pelo risco (RWA) - valores						
4	RWA total	10,511,064,255.53	9,971,568,211.00	10,447,480,650.59	10,055,687,027.78	9,277,412,861.90
Capital regulamentar como proporção do RWA						
5	Índice de Capital Principal (ICP)	12.76%	13.00%	12.24%	12.39%	13.13%
6	Índice de Nível 1 (%)	12.76%	13.00%	12.24%	12.39%	13.13%
7	Índice de Basileia	12.76%	13.00%	12.24%	12.39%	13.13%
Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA						
8	Adicional de Conservação de Capital Principal - ACPConservação (%)	1.25%	1.25%	2.50%	2.50%	2.50%
9	Adicional Contracíclico de Capital Principal - ACPContracíclico (%)	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
10	Adicional de Importância Sistêmica de Capital Principal - ACPsistêmico (%)	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
11	ACP total (%)	1.25%	1.25%	2.50%	2.50%	2.50%
12	Margem excedente de Capital Principal (%)	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Razão de Alavancagem (RA)						
13	Exposição total	11,467,460,240.51	10,707,439,879.00	10,714,267,006.30	10,284,831,911.67	9,352,818,683.47
14	RA (%)	11.70%	12.11%	11.94%	12.10%	12.95%
Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)						
15	Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA)					
16	Total de saídas líquidas de caixa					
17	LCR (%)					
Indicador de Liquidez de Longo Prazo (NSFR)						
18	Recursos estáveis disponíveis (ASF)					
19	Recursos estáveis requeridos (RSF)					
20	NSFR (%)					

OV1 – Visão geral dos ativos ponderados pelo risco (RWA)

	Set.20	Jun.20		
	a	b	c	
	RWA		Requerimento mínimo de PR	
	T	T - 1	T	
0	Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada	9,555,391,148.57	9,037,294,428.09	764,431,291.89
2	Risco de crédito em sentido estrito	9,436,457,823.36	8,975,054,051.74	754,916,625.87
6	Risco de crédito de contraparte (CCR)	111,637,981.91	57,759,126.35	8,931,038.55
7	Do qual: mediante abordagem padronizada para risco de crédito de contraparte (SA-CCR)	NA	NA	NA
7a	Do qual: mediante uso da abordagem CEM	NA	NA	NA
9	Do qual: mediante demais abordagens	NA	NA	NA
10	Acréscimo relativo ao ajuste associado à variação do valor dos derivativos em decorrência de variação da qualidade creditícia da contraparte (CVA)	7,295,343.30	4,481,250.00	583,627.46
12	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes identificados			
13	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes inferidos conforme regulamento do fundo			
14	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes não identificados			
16	Exposições de securitização - requerimento calculado mediante abordagem padronizada			
25	Valores referentes às exposições não deduzidas no cálculo do PR			
20	Risco de mercado	-	-	-
21	Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWAMPAD)	NA	NA	NA
22	Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWAMINT)	NA	NA	NA
24	Risco operacional	955,673,106.96	934,273,782.91	76,453,848.56
27	Total (2+6+10+12+13+14+16+25+20+24)	10,511,064,255.53	9,971,568,211.00	840,885,140.44