

Relatório de Gestão de Riscos - Circular 3930/2019 – Mar/20
KM1 – Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais

	Mar.20	Dez.19	Set.19	Jun.19	Mar.19
	a	b	c	d	e
Capital regulamentar - valores					
1 Capital Principal	1,278,882,592.45	1,245,472,492.05	1,212,258,251.34	1,352,344,506.04	1,295,924,280.90
2 Nível I	1,278,882,592.45	1,245,472,492.05	1,212,258,251.34	1,352,344,506.04	1,295,924,280.90
3 Patrimônio de Referência (PR)	1,278,882,592.45	1,245,472,492.05	1,212,258,251.34	1,352,344,506.04	1,295,924,280.90
3b Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente	-	-	-	-	-
3c Destaque do PR	-	-	-	-	-
Ativos ponderados pelo risco (RWA) - valores					
4 RWA total	10,447,480,650.59	10,055,687,027.78	9,277,412,861.90	8,693,285,663.21	9,079,046,273.09
Capital regulamentar como proporção do RWA					
5 Índice de Capital Principal (ICP)	12.24%	12.39%	13.13%	15.61%	14.33%
6 Índice de Nível 1 (%)	12.24%	12.39%	13.13%	15.61%	14.33%
7 Índice de Basileia	12.24%	12.39%	13.13%	15.61%	14.33%
Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA					
8 Adicional de Conservação de Capital Principal - ACPConservação (%)	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
9 Adicional Contracíclico de Capital Principal - ACPContracíclico (%)	0.00%	0.00%	0.00%	2.50%	2.50%
10 Adicional de Importância Sistêmica de Capital Principal - ACPsistêmico (%)	0.00%	0.00%	0.00%	2.00%	2.00%
11 ACP total (%)	2.50%	2.50%	2.50%	7.00%	7.00%
12 Margem excedente de Capital Principal (%)	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
Razão de Alavancagem (RA)					
13 Exposição total	10,714,267,006.30	10,284,831,911.67	9,352,818,683.47	8,790,132,338.09	9,583,129,473.98
14 RA (%)	11.94%	12.10%	12.95%	15.38%	13.52%
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)

	Mar.20	Dez.19	
	a	b	c
	RWA		Requerimento mínimo de PR
0 Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada	9,513,206,867.68	9,139,746,638.28	761,056,549.41
2 Risco de crédito em sentido estrito	9,478,096,664.16	9,113,488,728.36	758,247,733.13
6 Risco de crédito de contraparte (CCR)	32,347,703.52	25,688,772.52	2,587,816.28
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
Acréscimo relativo ao ajuste associado à variação do valor dos derivativos em decorrência de variação da qualidade creditícia da contraparte (CVA)	2,762,500.00	569,137.40	221,000.00
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	934,273,782.91	915,940,389.50	74,741,902.63
27 Total (2+6+10+12+13+14+16+25+20+24)	10,447,480,650.59	10,055,687,027.78	835,798,452.05