

Evolução da Carteira de Derivativos - Carteira de Negociação e Carteira Bancária
Operações no Brasil - Com Contraparte Central

Em Reais Mil

Fatores de Risco	31/12/2020		30/09/2020		30/06/2020	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Taxas de Juros	40,233,674	32,074,213	23,879,831	33,693,705	23,842,692	8,779,674
Taxas de Câmbio	16,523,444	15,062,333	11,423,875	9,004,516	14,382,472	13,709,824
Ações	24,924,580	25,162,108	20,405,271	18,987,036	15,412,072	14,144,284

Operações no Brasil - Sem Contraparte Central

Em Reais Mil

Fatores de Risco	31/12/2020		30/09/2020		30/06/2020	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Taxas de Juros	4,407,639	4,085,973	5,222,815	4,348,143	4,066,715	3,890,767
Taxas de Câmbio	14,589,961	14,789,215	9,144,526	7,244,426	8,317,563	8,803,744
Ações	9,606,687	677,003	8,275,990	646,785	8,188,921	1,123,789

Operações no Exterior - Com Contraparte Central

Em Reais Mil

Fatores de Risco	31/12/2020		30/09/2020		30/06/2020	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
<i>Sem Posição</i>						

Operações no Exterior - Sem Contraparte Central

Em Reais Mil

Fatores de Risco	31/12/2020		30/09/2020		30/06/2020	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Taxas de Juros	18,273,271	8,999,240	6,889,111	1,791,046	8,686,699	2,966,556
Taxas de Câmbio	17,888,242	12,390,608	17,061,331	29,054,798	27,203,036	20,308,893
Ações	1,742,406	10,129	420,818	427,403	665,657	964,222