

Tabela KM1: Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais

Objetivo: Apresentar as principais métricas estabelecidas pela regulamentação prudencial.

Úido:

Frequência: Trimestral.

ato:

ntári

|   | a                 | b                 | c                 | d                 | e                 |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|   | March-22          | December-21       | September-21      | June-21           | March-21          |
| <b>Capital regulamentar - valores</b>   |                   |                   |                   |                   |                   |
| 1 Capital Principal   | 5,725,426,022.45  | 4,813,120,802.45  | 4,816,997,625.02  | 4,661,491,000.59  | 4,398,854,349.67  |
| 2 Nível I   | 5,725,426,022.45  | 4,813,120,802.45  | 4,816,997,625.02  | 4,661,491,000.59  | 4,398,854,349.67  |
| 3 Patrimônio de Referência (PR)   | 5,725,426,022.45  | 4,813,120,802.45  | 4,816,997,625.02  | 4,661,491,000.59  | 4,398,854,349.67  |
| 3b Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente                         | 0.00              | 0.00              | 0.00              | 0.00              | 0.00              |
| 3c Destaque do PR   | 0.00              | 0.00              | 0.00              | 0.00              | 0.00              |
| <b>Ativos ponderados pelo risco (RWA) - valores</b>                           |                   |                   |                   |                   |                   |
| 4 RWA total   | 31,603,956,922.05 | 32,328,289,073.87 | 34,504,567,145.65 | 34,633,989,217.53 | 35,124,703,994.96 |
| <b>Capital regulamentar como proporção do RWA</b>                             |                   |                   |                   |                   |                   |
| 5 Índice de Capital Principal (ICP)   | 18.12             | 14.89             | 13.96             | 13.46             | 12.52             |
| 6 Índice de Nível 1 (%)   | 18.12             | 14.89             | 13.96             | 13.46             | 12.52             |
| 7 Índice de Basileia  | 18.12             | 14.89             | 13.96             | 13.46             | 12.52             |
| <b>Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA</b>             |                   |                   |                   |                   |                   |
| 8 Adicional de Conservação de Capital Principal - ACPConservação (%)          | 2.00              | 2.00              | 1.63              | 1.62              | 1.25              |
| 9 Adicional Contracíclico de Capital Principal - ACPCContracíclico (%)        | 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 (%)  | 2.00              | 2.00              | 1.63              | 1.62              | 1.25              |
| 12 Margem excedente de Capital Principal (%)                                  | 8.12              | 4.89              | 4.34              | 3.83              | 3.27              |
| <b>Razão de Alavancagem (RA)</b>  |                   |                   |                   |                   |                   |
| 13 Exposição total  | 56,933,748,236.69 | 53,400,379,070.64 | 55,534,599,923.96 | 52,204,406,658.18 | 71,474,025,032.30 |
| 14 RA (%)   | 10.06             | 9.01              | 8.67              | 8.93              | 6.15              |
| <b>Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)</b>                                |                   |                   |                   |                   |                   |
| 15 Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA)                                    | NA                | NA                | NA                | NA                | NA                |
| 16 Total de saídas líquidas de caixa  | NA                | NA                | NA                | NA                | NA                |
| 17 LCR (%)  | NA                | NA                | NA                | NA                | NA                |
| <b>Indicador de Liquidez de Longo Prazo (NSFR)</b>                            |                   |                   |                   |                   |                   |
| 18 Recursos estáveis disponíveis (ASF)  | NA                | NA                | NA                | NA                | NA                |
| 19 Recursos estáveis requeridos (RSF)   | NA                | NA                | NA                | NA                | NA                |
| 20 NSFR (%)   | NA                | NA                | NA                | NA                | NA                |

**Tabela OV1: Visão geral dos ativos ponderados pelo risco (RWA)**

Apresentar  
 Informações  
 Frequência:  
 Formato:  
 Comentários:

|    |  | a                 | b                 | c                         |
|----|--|-------------------|-------------------|---------------------------|
|    |  | RWA               |                   | Requerimento mínimo de PR |
|    |  | March-22          | December-21       | March-22                  |
| 0  | Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada   | 20,290,852,918.78 | 21,593,421,148.36 | 1,623,268,233.50          |
| 2  | Risco de crédito em sentido estrito  | 14,918,821,544.53 | 15,543,452,913.22 | 1,193,505,723.56          |
| 6  | Risco de crédito de contraparte (CCR)  | 2,519,882,730.15  | 2,536,817,166.83  | 201,590,618.41            |
| 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   | 2,466,802,672.84  | 2,450,461,396.62  | 197,344,213.83            |
| 9  | Do qual: mediante demais abordagens  | 53,080,057.31     | 86,355,770.21     | 4,246,404.58              |
| 10 | Acréscimo relativo ao ajuste associado à variação do valor dos derivativos em decorrência de variação da qualidade creditícia da contraparte (CVA) | 1,498,886,597.61  | 1,389,985,934.17  | 119,910,927.81            |
| 12 | Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes identificados  | 327,469,911.79    | 326,273,255.22    | 26,197,592.94             |
| 13 | Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes inferidos conforme regulamento do fundo  | -                 | -                 | 0.00                      |
| 14 | Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes não identificados  | -                 | -                 | 0.00                      |
| 16 | Exposições de securitização - requerimento calculado mediante abordagem padronizada  | -                 | -                 | 0.00                      |
| 25 | Valores referentes às exposições não deduzidas no cálculo do PR  | 1,025,792,134.70  | 1,796,891,878.93  | 82,063,370.78             |
| 20 | Risco de mercado   | 8,140,898,895.82  | 7,836,452,650.89  | 651,271,911.67            |
| 21 | Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWAMPAD)   | 8,140,898,895.82  | 7,836,452,650.89  | 651,271,911.67            |
| 22 | Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWAMINT)  | 0                 | 0                 | 0.00                      |
| 24 | Risco operacional  | 3,172,205,107.45  | 2,898,415,274.61  | 253,776,408.60            |
| 27 | Total (2+6+10+12+13+14+16+25+20+24)  | 31,603,956,922.05 | 32,328,289,073.86 | 2,528,316,553.76          |

**Tabela MR1: Abordagem padronizada - fatores de risco associados ao risco de mercado**

Divulgar o

Conteúdo: RWAMPAD.

Frequência: Trimestral.

Formato: Fixo.

Comentário

|     |  | March-22                |
|-----|--|-------------------------|
|     | <b>Fatores de risco</b>                                | <b>RWAMPAD</b>          |
| 1   | Taxas de juros   | 5,431,744,144.89        |
| 1.a | Taxas de juros prefixada denominadas em Real (RWAJUR1) | 2,097,537,640.38        |
| 1.b | Taxas dos cupons de moeda estrangeira (RWAJUR2)        | 2,635,103,750.63        |
| 1.c | Taxas dos cupons de índices de preço (RWAJUR3)         | 699,102,753.88          |
| 1.d | Taxas dos cupons de taxas de juros (RWAJUR4)           | 0.00                    |
| 2   | Preços de ações (RWAACS)                               | 2,146,969,687.63        |
| 3   | Taxas de câmbio (RWACAM)                               | 562,185,063.32          |
| 4   | Preços de mercadorias (commodities) (RWACOM)           | 0.00                    |
| 9   | <b>Total</b>   | <b>8,140,898,895.84</b> |

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

Em Reais Mil

| Fatores de Risco | 01/03/22   |            | 01/12/21   |            | 01/09/21   |            |
|------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
|                  | Comprada   | Vendida    | Comprada   | Vendida    | Comprada   | Vendida    |
| Taxas de Juros   | 33,089,424 | 25,712,217 | 63,688,653 | 51,364,586 | 85,262,098 | 79,283,478 |
| Taxas de Câmbio  | 34,611,324 | 27,950,262 | 29,129,712 | 18,741,339 | 36,138,657 | 23,815,056 |
| Ações            | 26,543,323 | 24,515,989 | 13,002,409 | 14,840,226 | 20,429,514 | 20,107,939 |

**Operações no Brasil - Sem Contraparte Central**

Em Reais Mil

| Fatores de Risco | 01/03/22  |           | 01/12/21  |           | 01/09/21  |           |
|------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|                  | Comprada  | Vendida   | Comprada  | Vendida   | Comprada  | Vendida   |
| Taxas de Juros   | 80,431    | 4,752,874 | 2,539,968 | 3,143,917 | 834,900   | 726,010   |
| Taxas de Câmbio  | 2,694,631 | 2,595,213 | 159,356   | 220,363   | 154,695   | 220,363   |
| Ações            | 5,416,248 | 4,025,895 | 7,116,444 | 5,560,191 | 5,994,164 | 4,841,932 |

**Operações no Exterior - Com Contraparte Central**

Em Reais Mil

| Fatores de Risco   | 01/03/22 |         | 01/12/21 |         | 01/09/21 |         |
|--------------------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|
|                    | Comprada | Vendida | Comprada | Vendida | Comprada | Vendida |
| <i>Sem Posição</i> |          |         |          |         |          |         |

**Operações no Exterior - Sem Contraparte Central**

Em Reais Mil

| Fatores de Risco | 01/03/22   |            | 01/12/21   |            | 01/09/21   |            |
|------------------|------------|------------|------------|------------|------------|------------|
|                  | Comprada   | Vendida    | Comprada   | Vendida    | Comprada   | Vendida    |
| Taxas de Juros   | 35,084,479 | 35,517,938 | 53,669,323 | 59,431,130 | 91,445,358 | 86,573,373 |
| Taxas de Câmbio  | 50,057,593 | 41,759,391 | 62,101,738 | 56,788,272 | 59,036,494 | 56,265,467 |
| Ações            | 12,994,225 | 7,839,150  | 15,799,088 | 8,782,926  | 14,915,596 | 7,682,223  |