

Tabela KM1: Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais						
Objetivo: Apresentar as principais métricas estabelecidas pela regulamentação prudencial.						
Conteúdo: Informações quantitativas referentes aos componentes do capital regulamentar, à Razão de Alavancagem e aos indicadores de liquidez.						
Frequência: Trimestral.						
	Em Reais mil					
	a	b	c	d	e	
	31/03/21	31/12/20	30/09/20	30/06/20	31/03/20	
Capital regulamentar - valores						
1	Capital Principal	4,398,854.35	4,332,117.59	4,700,212.17	4,609,952.11	4,437,921.12
2	Nível I	4,398,854.35	4,332,117.59	4,700,212.17	4,609,952.11	4,437,921.12
3	Patrimônio de Referência (PR)	4,398,854.35	4,332,117.59	4,700,212.17	5,705,152.11	5,477,661.12
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
Ativos ponderados pelo risco (RWA) - valores						
4	RWA total	35,124,703.99	31,329,359.82	31,383,228.42	26,532,836.98	26,090,343.48
Capital regulamentar como proporção do RWA						
5	Índice de Capital Principal (ICP)	12.52	13.83	14.98	17.37	17.01
6	Índice de Nível 1 (%)	12.52	13.83	14.98	17.37	17.01
7	Índice de Basileia	12.52	13.83	14.98	21.50	20.99
Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA						
8	Adicional de Conservação de Capital Principal - ACPConservação (%)	1.25	1.25	1.25	1.25	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	1.25	1.25	2.50
12	Margem excedente de Capital Principal (%)	3.27	4.58	5.73	10.12	8.51
Razão de Alavancagem (RA)						
13	Exposição total	71,474,025.03	62,804,565.42	70,757,157.54	62,210,029.26	57,862,546.07
14	RA (%)	6.15	6.90	6.64	7.41	7.67
Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)						
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
Indicador de Liquidez de Longo Prazo (NSFR)						
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)				
Objetivo: Apresentar visão geral do montante dos ativos ponderados pelo risco (RWA) utilizado na apuração do requerimento mínimo de Patrimônio de Referência (PR).				
Conteúdo: Informações quantitativas sobre o RWA e o requerimento mínimo de PR conforme estabelecido no art. 4º da Resolução nº 4.193, de 2013.				
Frequência: Trimestral.				
			Em Reais mil	
		a	b	c
		RWA		Requerimento mínimo de PR
		31/03/21	31/12/20	31/03/21
0	Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada	23,438,113.28	21,953,371.24	1,875,049.06
2	Risco de crédito em sentido estrito	17,002,138.20	14,505,887.91	1,360,171.06
6	Risco de crédito de contraparte (CCR)	67,359.73	45,356.07	5,388.78
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	2,537,428.64	3,389,417.28	202,994.29
9	Do qual: mediante demais abordagens	1,021,108.07	1,287,442.77	81,688.65
10	Acréscimo relativo ao ajuste associado à variação do valor dos derivativos em decorrência de variação da qualidade creditícia da contraparte (CVA)	1,117,278.93	1,125,020.44	89,382.31
12	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes identificados	508,117.35	432,148.15	40,649.39
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	1,184,682.36	1,168,098.62	94,774.59
20	Risco de mercado	8,955,698.16	6,790,630.87	716,455.85
21	Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWAMPAD)	8,955,698.16	6,790,630.87	716,455.85
22	Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWAMINT)	-	-	-
24	Risco operacional	2,730,892.56	2,585,357.71	218,471.40
27	Total (2+6+10+12+13+14+16+25+20+24)	31,566,167.29	26,652,499.77	2,525,293.38
Definições				
RWA (T) é o montante dos ativos ponderados pelo risco, conforme definido pela Resolução nº 4.193, de 2013, ao final do trimestre de referência.				
RWA (T-1) é o montante dos ativos ponderados pelo risco referente ao final do trimestre anterior ao de referência.				
Requerimento mínimo de PR (T) é o requerimento do total de PR em Reais, conforme definido na Resolução nº 4.193, de 2013, art. 4º, ao final do				

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

Objetivo: Divulgar o montante dos ativos ponderados pelo risco para o risco de mercado apurado mediante abordagem padronizada (RWAMPAD).

Conteúdo: RWAMPAD.

Frequência: Trimestral.

		Em Reais mil
		31/03/21
Fatores de risco		RWAMPAD
1	Taxas de juros	6,846,786.24
1.a	Taxas de juros prefixada denominadas em Real (RWAJUR1)	2,628,482.73
1.b	Taxas dos cupons de moeda estrangeira (RWAJUR2)	3,839,354.86
1.c	Taxas dos cupons de índices de preço (RWAJUR3)	378,948.65
1.d	Taxas dos cupons de taxas de juros (RWAJUR4)	-
2	Preços de ações (RWAACS)	1,587,388.41
3	Taxas de câmbio (RWACAM)	521,523.51
4	Preços de mercadorias (commodities) (RWACOM)	-
9	Total	8,955,698.16

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

Em Reais Mil

Fatores de Risco	31/03/2021		31/12/2020		30/09/2020	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Taxas de Juros	117,721,723	115,325,386	40,233,674	32,074,213	23,879,831	33,693,705
Taxas de Câmbio	20,593,479	11,476,740	16,523,444	15,062,333	11,423,875	9,004,516
Ações	26,472,014	24,759,787	24,924,580	25,162,108	20,405,271	18,987,036

Operações no Brasil - Sem Contraparte Central

Em Reais Mil

Fatores de Risco	31/03/2021		31/12/2020		30/09/2020	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Taxas de Juros	50,103,395	47,619,266	4,407,639	4,085,973	5,222,815	4,348,143
Taxas de Câmbio	65,955,715	78,105,524	14,589,961	14,789,215	9,144,526	7,244,426
Ações	14,916,996	10,359,669	9,606,687	677,003	8,275,990	646,785

Operações no Exterior - Com Contraparte Central

Em Reais Mil

Fatores de Risco	31/12/2021		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	31/03/2021		31/12/2020		30/09/2020	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Taxas de Juros	80,804,693	79,484,297	18,273,271	8,999,240	6,889,111	1,791,046
Taxas de Câmbio	94,585,756	88,812,037	17,888,242	12,390,608	17,061,331	29,054,798
Ações	8,897,309	4,171,311	1,742,406	10,129	420,818	427,403