

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. Devem ser evidenciados os valores relativos ao período corrente (T) e aos quatro períodos anteriores (T-1 a T-4).

Frequência: Trimestral.

Formato: Fixo. Eventuais informações complementares podem ser evidenciadas em linhas adicionais, desde que acompanhadas pelas respectivas definições e explicações sobre seu cálculo. As informações complementares não substituem as requeridas nesta tabela.

Comentários: Devem ser divulgados comentários adicionais para explicar mudanças significativas entre o período informado e os anteriores, bem como os principais indutores dessas mudanças (se devidos a alterações regulatórias, na composição do grupo ou no modelo de negócios da instituição, entre outros).

	a	b	c	d	e
	March-23	December-22	September-22	June-22	March-22
Capital regulamentar - valores					
1 Capital Principal	6,024,571,151.44	6,129,212,284.48	6,067,455,279.29	5,863,095,103.84	5,725,426,022.45
2 Nível I	6,024,571,151.44	6,129,212,284.48	6,067,455,279.29	5,863,095,103.84	5,725,426,022.45
3 Patrimônio de Referência (PR)	6,024,571,151.44	6,129,212,284.48	6,067,455,279.29	5,863,095,103.84	5,725,426,022.45
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	24,905,632,645.32	25,841,415,677.38	32,042,307,181.78	32,190,309,198.35	31,603,956,922.05
Capital regulamentar como proporção do RWA					
5 Índice de Capital Principal (ICP)	24.19	23.72	18.94	18.21	18.12
6 Índice de Nível 1 (%)	24.19	23.72	18.94	18.21	18.12
7 Índice de Basileia	24.19	23.72	18.94	18.21	18.12
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	2.00
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 (%)	2.50	2.50	2.50	2.50	2.00
12 Margem excedente de Capital Principal (%)	13.69	13.22	8.44	7.71	8.12
Razão de Alavancagem (RA)					
13 Exposição total	36,623,192,783.33	49,366,569,057.47	53,843,548,834.16	51,965,012,209.77	56,933,748,236.69
14 RA (%)	16.45	12.42	11.27	11.28	10.06
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.				
Formato: Fixo				
Comentários: Devem ser explicadas as causas de diferenças significativas entre os valores reportados nos períodos T e T-1.				
		a	b	c
		RWA		Requerimento mínimo de PR
		March-23	December-22	March-23
0	Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada	14,388,675,171.82	15,975,889,975.16	1,151,094,013.75
2	Risco de crédito em sentido estrito	11,398,734,917.44	11,920,193,579.98	911,898,793.40
6	Risco de crédito de contraparte (CCR)	1,334,594,727.85	2,163,717,506.41	106,767,578.23
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	1,282,575,408.22	2,122,535,954.51	102,606,032.66
9	Do qual: mediante demais abordagens	52,019,319.63	41,181,551.90	4,161,545.57
10	Acréscimo relativo ao ajuste associado à variação do valor dos derivativos em decorrência de variação da qualidade creditícia da contraparte (CVA)	1,253,990,166.79	1,370,221,366.59	100,319,213.34
12	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes identificados	401,355,359.74	462,342,692.18	32,108,428.78
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	0.00	59,414,830.00	0.00
20	Risco de mercado	6,744,922,600.47	6,323,757,501.97	539,593,808.04
21	Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWAMPAD)	6,744,922,600.47	6,323,757,501.97	539,593,808.04
22	Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWAMINT)	0	0	0.00
24	Risco operacional	3,772,034,873.03	3,541,768,200.25	301,762,789.84
27	Total (2+6+10+12+13+14+16+25+20+24)	24,905,632,645.32	25,841,415,677.38	1,992,450,611.63

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.

Formato: Fixo.

Comentários: Devem ser explicitadas mudanças significativas em relação ao relatório anterior e os principais indutores dessas mudanças.

		March-23
	Fatores de risco	RWAMPAD
1	Taxas de juros	5,984,787,132.25
1.a	Taxas de juros prefixada denominadas em Real (RWAJUR1)	3,853,253,549.75
1.b	Taxas dos cupons de moeda estrangeira (RWAJUR2)	1,729,022,039.50
1.c	Taxas dos cupons de índices de preço (RWAJUR3)	402,511,543.00
1.d	Taxas dos cupons de taxas de juros (RWAJUR4)	0.00
2	Preços de ações (RWAACS)	644,283,033.75
3	Taxas de câmbio (RWACAM)	115,852,434.47
4	Preços de mercadorias (commodities) (RWACOM)	0.00
9	Total	6,744,922,600.47

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

Em Reais Mil

Fatores de Risco	01/03/23		01/12/22		01/09/22	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Taxas de Juros	32,674,102	31,243,608	93,901,135	88,543,003	95,834,136	92,474,376
Taxas de Câmbio	19,137,031	17,951,139	23,532,091	12,728,499	23,510,975	17,412,131
Ações	15,394,714	13,571,472	14,070,619	11,089,323	23,558,255	20,599,907

Operações no Brasil - Sem Contraparte Central

Em Reais Mil

Fatores de Risco	01/03/23		01/12/22		01/09/22	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Taxas de Juros	-	123,156	122,179	1,232,853	29,068	40,064
Taxas de Câmbio	83,642	220,363	106,431	220,363	131,970	220,363
Ações	4,571,609	2,782,085	3,513,969	1,809,412	3,559,632	1,988,917

Operações no Exterior - Com Contraparte Central

Em Reais Mil

Fatores de Risco	01/03/23		01/12/22		01/09/22	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
<i>Sem Posição</i>						

Operações no Exterior - Sem Contraparte Central

Em Reais Mil

Fatores de Risco	01/03/23		01/12/22		01/09/22	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Taxas de Juros	90,164,518	84,292,525	56,440,377	47,019,848	24,131,627	33,266,267
Taxas de Câmbio	10,150,848	9,301,450	19,699,159	15,069,823	18,656,392	18,745,880
Ações	5,890,947	1,835,143	7,105,022	732,771	7,662,628	1,666,429