



## Pilar 3

1T2021

<b>Tabela KM1: Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais</b>	<b>3</b>
<b>Tabela OV1: Visão geral dos ativos ponderados pelo risco (RWA)</b>	<b>4</b>
<b>Tabela MR1: Abordagem padronizada - fatores de risco associados ao risco de mercado</b>	<b>5</b>
<b>Tabela OPD: Total de exposição associada a instrumentos financeiros derivativos</b>	<b>6</b>

**Tabela KM1: Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais**

Capital Regulamentar	Mar-21	Dec-20
1 - Capital Principal	R\$ 821,391,469.33	R\$ 820,552,683.60
2 - Nível I	R\$ 821,391,469.33	R\$ 820,552,683.60
3 - Patrimonio de Referencia (PR)	R\$ 821,391,469.33	R\$ 820,552,683.60
3b - Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente	R\$ 0.00	R\$ 0.00
3c - Destaque do PR	R\$ 0.00	R\$ 0.00
<b>Ativos ponderados pelo risco (RWA)</b>		
4 - RWA Total	R\$ 4,175,683,288.61	R\$ 4,550,134,683.17
<b>Capital regulamentar como proporção do RWA</b>		
5 - Índice de Capital Principal (ICP)	19.67 %	18.03 %
6 - Índice de Nível 1 (%)	19.67 %	18.03 %
7 - Índice de Basileia	19.67 %	18.03 %
<b>Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA</b>		
8 - Adicional de Conservação de Capital Principal - ACPConservação (%)	1.25 %	1.25 %
9 - Adicional Contracíclico de Capital Principal - ACPContracíclico (%)	0.00 %	0.00 %
10 - Adicional de Importância Sistêmica de Capital Principal - ACPSistêmico (%)	0.00 %	0.00 %
11 - ACP total (%)	1.25 %	1.25 %
12 - Margem excedente de Capital Principal (%)	10.42 %	8.78 %
<b>Razão de Alavancagem (RA)</b>		
13 - Exposição total	R\$ 20,047,587,842.91	R\$ 31,570,378,843.91
14 - RA (%)	4.10 %	2.60 %
<b>Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)</b>		
15 - Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA)	R\$ 0.00	R\$ 0.00
16 - Total de saídas líquidas de caixa	R\$ 0.00	R\$ 0.00
17 - LCR (%)	0.00 %	0.00 %
<b>Indicador de Liquidez de Longo Prazo (NSFR)</b>		
18 - Recursos estáveis disponíveis (ASF)	R\$ 0.00	R\$ 0.00
19 - Recursos estáveis requeridos (RSF)	R\$ 0.00	R\$ 0.00
20 - NSFR (%)	0.00 %	0.00 %

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

Capital Regulamentar	Mar-21	Dec-20	Requerimento Mínimo
0 - Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada	R\$ 3,071,420,499.67	R\$ 3,273,114,547.05	R\$ 245,713,639.97
2 - Risco de crédito em sentido estrito	R\$ 1,905,699,226.90	R\$ 2,259,697,119.17	R\$ 152,455,938.15
6 - Risco de crédito de contraparte (CCR)	R\$ 1,008,194,689.70	R\$ 848,728,686.74	R\$ 80,655,575.18
7 - Do qual: mediante abordagem padronizada para risco de crédito de contraparte (SA-CCR)	R\$ 0.00	R\$ 0.00	R\$ 0.00
7a - Do qual: mediante uso da abordagem CEM	R\$ 1,008,194,689.70	R\$ 848,728,686.74	R\$ 80,655,575.18
9 - Do qual: mediante demais abordagens	R\$ 0.00	R\$ 0.00	R\$ 0.00
10 - Acréscimo relativo ao ajuste associado à variação do valor dos derivativos em decorrência de variação da qualidade creditícia da contraparte (CVA)	R\$ 113,460,213.17	R\$ 119,732,775.06	R\$ 9,076,817.05
12 - Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes identificados	R\$ 0.00	R\$ 0.00	R\$ 0.00
13 - Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes inferidos conforme regulamento do	R\$ 0.00	R\$ 0.00	R\$ 0.00
14 - Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes não identificados	R\$ 0.00	R\$ 0.00	R\$ 0.00
16 - Exposições de securitização - requerimento calculado mediante abordagem padronizada	R\$ 0.00	R\$ 0.00	R\$ 0.00
25 - Valores referentes às exposições não deduzidas no cálculo do PR	R\$ 44,066,369.90	R\$ 44,955,966.08	R\$ 3,525,309.59
20 - Risco de Mercado	R\$ 690,801,054.82	R\$ 921,522,740.37	R\$ 55,264,084.39
21 - Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWAMPAD)	R\$ 690,801,054.82	R\$ 921,522,740.37	R\$ 55,264,084.39
22 - Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWAMINT)	R\$ 0.00	R\$ 0.00	R\$ 0.00
24 - Risco operacional	R\$ 413,461,734.12	R\$ 355,497,395.75	R\$ 33,076,938.73
27 - TOTAL	R\$ 4,175,683,288.61	R\$ 4,550,134,683.17	R\$ 334,054,663.09

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

Capital Regulamentar	Mar-21
1 Taxas de juros	R\$ 681,185,341.25
1a - Taxas de juros prefixada denominadas em Real (RWAJUR1)	R\$ 58,967,194.00
1b - Taxas dos cupons de moeda estrangeira (RWAJUR2)	R\$ 622,218,147.25
1c - Taxas dos cupons de índices de preço (RWAJUR3)	R\$ 0.00
1d - Taxas dos cupons de taxas de juros (RWAJUR4)	R\$ 0.00
2 - Preços de ações (RWAACS)	R\$ 0.00
3 - Taxas de câmbio (RWACAM)	R\$ 9,615,713.57
4 - Preços de mercadorias (commodities) (RWACOM)	R\$ 0.00
9 - TOTAL	R\$ 690,801,054.82

**Tabela OPD: Total de exposição associada a instrumentos financeiros derivativos**

<b>2020-3</b>			
<b>Fatores de risco</b>		<b>Comprada</b>	<b>Vendida</b>
<b>Brasil</b>			
Taxa de Juros	Não Contaparte Central	R\$ 0	R\$ 0
	Contraparte Central	8,682,917,960.00	661,824,143.00
	<b>Total</b>	<b>8,682,917,960.00</b>	<b>661,824,143.00</b>
Taxa de Cambio	Não Contaparte Central	14,538,636,362.00	16,790,567,929.00
	Contraparte Central	12,148,690,106.00	5,726,207,881.00
	<b>Total</b>	<b>26,687,326,468.00</b>	<b>22,516,775,810.00</b>
Total	Não Contaparte Central	14,538,636,362.00	16,790,567,929.00
	Contraparte Central	20,831,608,066.00	6,388,032,024.00
	<b>Total</b>	<b>35,370,244,428.00</b>	<b>23,178,599,953.00</b>