

Visão geral dos Ativos Ponderados pelo Risco – RWA (OV1)

	RWA		Requerimento mínimo de PR ⁽³⁾
	a T Jun-21	b T-1 Mar-21	c T Jun-21
0 Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada - valores em R\$ mil	14.211.815	14.980.667	1.136.945
2 Risco de crédito em sentido estrito ⁽¹⁾	14.211.815	14.980.667	1.136.945
6 Risco de crédito de contraparte (CCR)	-	-	-
7 Do qual: mediante abordagem padronizada para risco de crédito de contraparte (SA-CCR)	-	-	-
7a Do qual: mediante uso da abordagem CEM	-	-	-
9 Do qual: mediante demais abordagens	-	-	-
10 Acréscimo relativo ao ajuste associado à variação do valor dos derivativos em decorrência de variação da CVA	-	-	-
12 Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes identificados	-	-	-
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 ⁽²⁾	-	-	-
20 Risco de mercado - valores em R\$ mil	113.209	3.772	9.057
21 Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWA_{MPAD})	113.209	3.772	9.057
22 Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWA_{MINT})	-	-	-
24 Risco operacional - valores em R\$ mil	1.197.025	1.197.025	95.762
27 Total (2+6+10+12+13+14+16+25+20+24) - valores em R\$ mil	15.522.049	16.181.463	1.241.764

(1) Não contempla operações de Risco de Crédito de Contraparte.

(2) Conforme definido na Resolução nº 4.193/13, art. 4.

Comentários

--