

Tabela OV1 - Trimestral

Jun-20

Modelo - Fixo



		RWA		Requerimento mínimo de PR
		T	T-1	T
0	Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada	6,522,223,396.28	6,411,817,704.43	521,777,871.70
2	Risco de crédito em sentido estrito	5,577,520,855.79	5,206,383,954.32	446,201,668.46
6	Risco de crédito de contraparte (CCR)	944,702,540.49	1,115,306,955.52	75,576,203.24
7	Do qual: mediante abordagem padronizada para risco de crédito de contraparte (SA-CCR)	0.00	0.00	0.00
7a	Do qual: mediante uso da abordagem CEM	944,702,540.49	1,115,306,955.52	75,576,203.24
9	Do qual: mediante demais abordagens	0.00	0.00	0.00
10	Acréscimo relativo ao ajuste associado à variação do valor dos derivativos em decorrência de variação da qualidade creditícia da contraparte (CVA)	45,374,061.39	90,126,794.58	3,629,924.91
12	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes identificados	0.00	0.00	0.00
13	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes inferidos conforme regulamento do fundo	0.00	0.00	0.00
14	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes não identificado	0.00	0.00	0.00
16	Exposições de securitização - requerimento calculado mediante abordagem padronizada	0.00	0.00	0.00
25	Valores referentes às exposições não deduzidas no cálculo do PR	0.00	0.00	0.00
20	Risco de mercado	1,112,488,425.53	770,999,001.39	88,999,074.04
21	Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWAMPAD)	1,112,488,425.53	770,999,001.39	88,999,074.04
22	Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWAMINT)	0.00	0.00	0.00
24	Risco Operacional	602,229,511.94	602,229,511.94	48,178,360.96
27	<b>Total (2+6+10+12+13+14+16+25+20+24)</b>	<b>8,282,315,395.14</b>	<b>7,785,046,217.76</b>	<b>622,803,697.42</b>