

OV1 – VISÃO GERAL DOS ATIVOS PONDERADOS PELO RISCO (RWA)

		RWA	
		3/2020	2/2020
0	Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada	3.755.319,00	4.369.029,00
2	Risco de crédito em sentido estrito	3.439.912,00	4.028.331,00
6	Risco de crédito de contraparte (CCR)	315.407,00	340.698,00
7	Do qual: mediante abordagem padronizada para risco de crédito de contraparte (AS-CCR)	0,00	0,00
7a	Do qual: mediante uso da abordagem CEM	315.407,00	340.698,00
9	Do qual: mediante demais abordagens	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)	0,00	0,00
12	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes identificados	0,00	0,00
13	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes inferidos conforme regulamento do fundo	0,00	0,00
14	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes não identificados	0,00	0,00
16	Exposições de securitização - requerimento calculado mediante abordagem padronizada	0,00	0,00
25	Valores referentes às exposições não deduzidas no cálculo do PR	0,00	0,00
20	Risco de mercado	518.652,00	707.703,00
21	Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWA MPAD)	518.651,00	707.703,00
22	Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWA MINT)	0,00	0,00
24	Risco Operacional	479.452,00	447.332,00
27	Total (2+6+10+12+13+14+16+25+20+24)	4.753.423,00	5.524.064,00