



COOPERATIVA CENTRAL CREDIMINAS - 1003

Relatório de Gerenciamento de Riscos e de Capital

Pilar 3

2º Trimestre de 2022

Índice

1. Objetivo	3
2. Apresentação	3
3. Gerenciamento de riscos e indicadores prudenciais	4
3.1 Estrutura de Gerenciamento de Riscos	4
3.2 Estrutura de Gerenciamento de Capital	6
3.3 Patrimônio de Referência (PR)	7
3.4 Indicadores de Adequação do Capital	7
3.5 Adicional de Capital Principal	7
3.6 KM1: Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais	8
3.7 Ativos Ponderados pelo Risco (RWA)	8
3.8 OV1: Visão geral dos ativos ponderados pelo risco (RWA)	9
4. Risco de Crédito	9
4.1 Estrutura de Gerenciamento do Risco de Crédito	9
4.2 CR1: Qualidade creditícia das exposições	11
4.3 CR2: Mudanças no estoque de operações em curso anormal	11
5. Risco de Mercado	11
5.1 Estrutura de Gerenciamento do Risco de Mercado	11
5.2 MR1: Abordagem padronizada – fatores de risco associados ao risco de mercado	12
5.3 Carteira de Derivativos	13

1. Objetivo

Em atendimento aos requisitos estabelecidos pelo Banco Central do Brasil (BCB), por meio da Resolução BCB nº 54, de 16 de dezembro de 2020, que dispõe sobre a divulgação do relatório de Pilar 3, apresentamos o relatório do Sicoob Central Crediminas com as informações requeridas pelo BCB.

A Resolução BCB nº 54/2020 define o escopo, o formato e a periodicidade de divulgação das informações. Neste relatório, as informações estão organizadas em tabelas com formato fixo e flexível com o objetivo de manter a comparabilidade entre as instituições, reduzir a assimetria de informações e fomentar a disciplina de mercado.

A política de divulgação do Relatório de Gerenciamento de Riscos e de Capital apresenta a especificação das informações que devem ser divulgadas, as diretrizes e as responsabilidades das áreas envolvidas no processo de elaboração e divulgação do relatório, bem como, a responsabilidade dos controles internos, visando garantir a fidedignidade das informações, conforme estabelecido pelo art. 56 da Resolução CMN nº 4.557, de 23 de fevereiro de 2017.

As informações deste relatório têm como base o trimestre findo em 30 de junho de 2022.

2. Apresentação

O Sicoob Central Crediminas, é uma instituição financeira cooperativa, integrante do Sistema de Cooperativas Financeira do Brasil - Sicoob e tem por objetivo a organização comum e em maior escala dos serviços econômico-financeiro e assistenciais de interesse das cooperativas singulares associadas, integrando e orientando atividades, bem como facilitando a utilização recíproca dos serviços para o alcance dos propósitos sistêmicos.

A gestão integrada de riscos e de capital no âmbito das cooperativas do Sicoob é realizada de forma centralizada pelo Centro Cooperativo Sicoob (CCS), abrangendo, no mínimo, o gerenciamento de capital e os riscos financeiros: crédito, mercado, variação das taxas de juros e liquidez, e os não financeiros: operacional, socioambiental, estratégico, reputação, conformidade, continuidade de negócios.

O Sicoob Central Crediminas conta com equipe responsável pelo gerenciamento de riscos, que promove ações coordenadas na busca por garantir que os objetivos sejam perseguidos dentro de limites aceitáveis de risco, conforme sua definição de apetite ao risco, a qual considera a capacidade para assunção de riscos, a tolerância a riscos e perfil de risco da cooperativa.

O gerenciamento de riscos é integrado e possibilita a identificação, a mensuração, a avaliação, o monitoramento, o reporte, o controle e a mitigação dos efeitos adversos resultantes das interações entre os riscos.

O perfil de risco do Sicoob Central Crediminas está adequado ao seu modelo de negócios, e seus limites regulamentares e gerenciais estão estabelecidos na Declaração de Apetite por Riscos (RAS), aprovada pelo Conselho de Administração.

A cultura de riscos é disseminada por meio de processo estruturado, com base em treinamentos específicos e de caráter obrigatório. Informações sobre os níveis de apetite por riscos apresentados na Declaração de Apetite por Riscos (RAS), políticas,

manuais, estratégias e processos relacionados ao gerenciamento integrado de riscos são disseminadas na Central

3. Gerenciamento de riscos e indicadores prudenciais

3.1 Estrutura de Gerenciamento de Riscos

A estrutura de governança para o gerenciamento de riscos e de capital é composta pelos seguintes órgãos:

a) Estruturas centralizadas de gerenciamento de riscos e de capital do Sicoob que possuem como atribuições:

- a.1) definir as políticas, manuais, procedimentos e sistemas para o gerenciamento de riscos e de capital das entidades do Sicoob;
- a.2) definir e monitorar os indicadores de riscos e capital, regulamentares e gerenciais;
- a.3) providenciar o relacionamento com órgãos de supervisão externa e interna;
- a.4) prestar suporte técnico às entidades de 1º e 2º níveis;
- a.5) reportar, aos órgãos de governança, as informações referentes ao gerenciamento de riscos e de capital das entidades do Sicoob.

b) Conselho de Administração da Cooperativa Central que tem como atribuições:

- b.1) fixar os níveis de apetite por riscos na RAS;
- b.2) aprovar e revisar as políticas, estratégias e os limites de gerenciamento de riscos e o plano de capital;
- b.3) assegurar a aderência da cooperativa às políticas, às estratégias e aos limites de gerenciamento de riscos e de capital estabelecidos;
- b.4) definir o diretor responsável pelo gerenciamento de riscos e de capital;
- b.5) assegurar a correção tempestiva das deficiências da estrutura de gerenciamento de riscos e de capital;
- b.6) autorizar, quando necessário, exceções às políticas, aos procedimentos e aos limites e níveis de apetite por riscos fixados na RAS;
- b.7) promover a disseminação da cultura de gerenciamento de riscos na cooperativa;
- b.8) assegurar recursos adequados e suficientes para o exercício das atividades relacionadas ao gerenciamento de riscos e de capital, de forma independente, objetiva e efetiva;
- b.9) garantir que a estrutura remuneratória adotada pela cooperativa, não incentive comportamentos incompatíveis com os níveis de apetite por riscos fixados na RAS; e
- b.10) assegurar que a cooperativa mantenha níveis adequados e suficientes de capital e de liquidez.

c) Diretoria de riscos e capital da Cooperativa Central que tem como atribuições:

- c.1) supervisionar o desenvolvimento, a implantação e o desempenho da estrutura de gerenciamento de riscos, incluindo seu aperfeiçoamento;
- c.2) subsidiar e participar do processo de tomada de decisões estratégicas relacionadas ao gerenciamento de riscos e de capital, auxiliando o conselho de administração;
- c.3) responsabilizar-se pela adequação da cooperativa aos limites estabelecidos na RAS e aos objetivos estratégicos;
- c.4) reportar, aos órgãos de governança competentes, as informações referentes ao gerenciamento de riscos e de capital;
- c.5) responsabilizar-se pela capacitação adequada dos empregados acerca das políticas, dos relatórios, sistemas e dos modelos da estrutura de gerenciamento de riscos e de capital.

O processo de gerenciamento de riscos é segregado e a estrutura organizacional envolvida garante especialização, representação e racionalidade existindo a adequada disseminação de informações e do fortalecimento da cultura de gestão de riscos na cooperativa.

Visando otimizar a delegação e coordenação de tarefas essenciais ao gerenciamento de riscos, a cooperativa adota modelo de três linhas de defesa, com a seguinte caracterização:

- a) **1ª linha:** controles e gestão operacional aplicados pelas áreas que assumem riscos;
- b) **2ª linha:** áreas específicas para desempenho das atividades de controles internos, gerenciamento de riscos e conformidade, de forma unificada;
- c) **3ª linha:** avaliação independente pela auditoria interna.

O Sicoob utiliza sistemas automatizados e robustos para completo atendimento as normas de capital e para mensuração de riscos, em aderência as determinações e modelos regulatórios.

Os órgãos de governança e a alta administração acompanham permanentemente as atividades e os indicadores de gerenciamentos de riscos, de forma a garantir a eficiência e eficácia do modelo de controle.

O Sicoob, por meio da Superintendência de Gestão Integrada de Riscos do CCS, com reporte ao Diretor de Riscos e Controles, é o responsável pela gestão centralizada e integrada de riscos das entidades do Sicoob. O gerenciamento de riscos, abrange, no mínimo, os riscos de crédito, mercado, variação das taxas de juros, liquidez, operacional, socioambiental e continuidade de negócios, os quais possuem manuais institucionais estabelecendo padrões para as respectivas instrumentalizações.

São implementados mecanismos que possibilitam a identificação, mensuração, avaliação, monitoramento e reporte dos riscos relevantes incorridos pela Cooperativa Central, inclusive dos eventuais riscos não cobertos pelos requerimentos mínimos de capital.

A área responsável pelo gerenciamento de riscos e de capital disponibiliza relatórios gerenciais periódicos de mensuração de riscos e de adequação do capital para a Diretoria e para o Conselho de Administração da Cooperativa Central.

O reporte de riscos ao Conselho de Administração e à Diretoria da Central ocorre de forma permanente, tendo as responsabilidades sobre a comunicação de cada ente participante descrita em políticas e manuais sistêmicos de cada risco financeiro e não financeiro.

O Conselho de Administração e a Diretoria da Central devem informar tempestivamente às estruturas centralizadas de riscos e de capital do Sicoob, qualquer evento que possa provocar impacto no capital da cooperativa, gerando desenquadramento nos níveis do capital regulamentar.

A área responsável pelo gerenciamento de riscos e de capital ou função correlata da Central, por sua vez, deve informar à Diretoria sobre qualquer evento que produza impacto no capital da cooperativa.

O Programa de Testes de Estresse (PTE) está inserido no Gerenciamento Integrado de Riscos da cooperativa e tem o objetivo de identificar impactos de eventos e circunstâncias adversas na cooperativa ou em um portfólio, por meio de exercícios de testes de estresse de sensibilidade. As variáveis do modelo de cenário de estresse e suas estimativas são elaboradas pela estrutura centralizada de riscos do Sicoob.

O principal objetivo é avaliar se, mesmo em situações severamente adversas, a Central teria níveis adequados de capital e liquidez, não impactando a sustentabilidade de suas atividades e do Sicoob.

O acompanhamento do apetite por riscos e a sua consequente mitigação se dá por meio de processos efetivos e periódicos de controles, em que a governança é informada quanto à exposição e a respectiva utilização dos limites vigentes. O reporte é feito por meio de relatórios estruturados com destaque a eventuais exceções dos limites, as quais exigem planos de ação, incluindo datas, para as respectivas adequações.

3.2 Estrutura de Gerenciamento de Capital

A cooperativa dispõe de um plano de capital que prevê as metas e projeções de capital e suas principais fontes. As projeções abrangem o horizonte de 3 (três) anos e possuem periodicidade de revisão anual. São realizados testes de estresse e avaliação de seus impactos no capital.

A cooperativa mantém um conjunto de metodologias que permitem identificar e avaliar os riscos relevantes, de forma a manter capital compatível com os riscos incorridos.

A estrutura de gerenciamento de capital é um processo contínuo que prevê:

- a) monitoramento e controle do capital com objetivo de manter o capital de Nível I e o Patrimônio de Referência em níveis compatíveis com os riscos e exposições incorridos pela cooperativa;
- b) elaboração do planejamento de metas e de necessidade de capital, considerando os objetivos estratégicos da cooperativa;
- c) avaliação prospectiva, buscando a antecipação da necessidade de capital decorrente de possíveis mudanças nas condições de mercado;

- d) avaliação e reporte dos impactos e dos resultados dos testes de estresse no capital; e
- e) reporte de informações gerenciais para a Diretoria e o Conselho de Administração sobre a estrutura de capital da Central e seus níveis de adequação.

3.3 Patrimônio de Referência (PR)

Em conformidade com as Resoluções CMN 4.955/2021, além de regulamentações complementares, o Sicoob Central Crediminas mantém Patrimônio de Referência (PR) compatível com os riscos inerentes às suas atividades. O processo de Adequação do Patrimônio de Referência é acompanhado para atendimento aos requerimentos regulatórios e gestão estratégica da instituição.

O PR é composto pelo Nível I e Nível II, sendo parâmetro para fins de monitoramento e de verificação do cumprimento dos limites operacionais, estabelecidos pelo Banco Central do Brasil (BCB), onde:

- Nível I – composto pelo somatório do Capital Principal e Capital Complementar;
- Nível II – composto por instrumentos elegíveis a capital, basicamente dívidas subordinadas, sujeitos a limitações prudenciais.

3.4 Indicadores de Adequação do Capital

O BCB estabelece os limites operacionais a serem observados pelas instituições financeiras, que são monitorados pela apuração do Índice de Basileia (IB), Índice de Nível I (IN1) e Índice de Capital Principal (ICP), conforme estabelecido pela Resolução CMN 4.958/2021.

3.5 Adicional de Capital Principal

As parcelas de adicional de capital regulamentar visam garantir que as instituições tenham reserva de capital suficiente para enfrentar momentos de crise, reduzindo potencial impacto sistêmico indesejável na economia.

O Adicional de Capital Principal (ACP) passou a vigorar a partir de janeiro de 2016, sendo aplicado de acordo com as Circulares BCB 3.768/2015 e 3.769/2015.

3.6 KM1: Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais

		a	b	c	d	e
		jun-22	mar-22	dez-21	set-21	jun-21
Capital regulamentar						
1	Capital Principal	373.633	387.730	384.829	400.742	391.500
2	Nível I	373.633	387.730	384.829	400.742	391.500
3	Patrimônio de Referência (PR)	373.633	387.730	384.829	400.742	391.500
3b	Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente	-	-	-	-	-
3c	Destaque do PR	-	-	-	-	-
Ativos ponderados pelo risco (RWA)						
4	RWA total	2.315.864	2.616.094	2.184.059	2.744.173	1.939.544
Capital regulamentar como proporção do RWA						
5	Índice de Capital Principal (ICP)	16,13%	14,82%	17,62%	14,60%	20,19%
6	Índice de Nível 1 (%)	16,13%	14,82%	17,62%	14,60%	20,19%
7	Índice de Basileia	16,13%	14,82%	17,62%	14,60%	20,19%
Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA						
8	Adicional de Conservação de Capital Principal - ACPConservação (%)	2,50%	2,00%	2,00%	1,62%	1,63%
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%	2,00%	2,00%	1,62%	1,63%
12	Margem excedente de Capital Principal (%)	9,13%	8,32%	11,12%	8,48%	14,06%
Razão de Alavancagem (RA)						
13	Exposição total	NA	NA	NA	NA	NA
14	RA (%)	NA	NA	NA	NA	NA
Indicador de 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

Em junho/2021, dezembro/2021 e junho/2022 ocorreu a realocação de recursos de DI Banco Sicoob para operações compromissadas com lastro em Título Público Federal, tendo ocasionado uma redução na exposição dos ativos ponderados pelo risco de crédito e conseqüentemente, no resultado do RWA Total. Essa realocação ocorreu em função de questões estratégicas, envolvendo o relacionamento dessa Central com o Banco Sicoob, sendo imediatamente revertida no início do mês subsequente.

3.7 Ativos Ponderados pelo Risco (RWA)

Conforme a Resolução CMN 4.958/2021, que trata dos cálculos dos requerimentos mínimos e do adicional de capital, deve ser apurado o montante dos ativos ponderados pelo risco (RWA), correspondente à soma das seguintes exposições:

$$RWA = RWA_{CPAD} + RWA_{MPAD} + RWA_{OPAD}$$

Sendo:

Risco de Crédito

- RWA_{CPAD} – relativa às exposições ao risco de crédito sujeitas ao cálculo do requerimento de capital mediante abordagem padronizada.

Risco de Mercado

- RWA_{MPAD} – relativa às exposições ao risco de mercado sujeitas ao cálculo do requerimento de capital mediante abordagem padronizada.

Risco Operacional

- RWA_{OPAD} – relativa ao cálculo do capital requerido para o risco operacional mediante abordagem padronizada.

As metodologias utilizadas pelo Sicoob Central Crediminas para a alocação de capital estão em conformidade com a regulamentação em vigor, sendo parte do processo de avaliação da adequação do PR, objetivando apurar a exigência de capital suficiente para cobertura dos riscos inerentes às suas atividades.

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

		R\$ mil		
		a	b	c
		RWA		Requerimento mínimo de PR
		jun-22	mar-22	jun-22
0	Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada	2.204.547	2.504.777	176.364
2	Risco de crédito em sentido estrito	1.781.026	2.138.228	142.482
6	Risco de crédito de contraparte (CCR)	-	-	-
7	Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada para risco de crédito de contraparte (SA-CCR)	NA	NA	NA
7a	Do qual: requerimento calculado 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 qualidade creditícia da contraparte (CVA)	-	-	-
12	Cotas de fundos não consolidados - ativos subjacentes identificados	283.408	221.150	22.673
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	140.112	145.399	11.209
20	Risco de mercado	0	0	0
21	Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWAMPAD)	-	-	-
22	Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWAMINT)	-	-	-
24	Risco operacional	111.317	111.317	8.905
27	Total	2.315.864	2.616.094	185.269

A redução na exposição de Risco de Crédito em relação ao trimestre anterior é justificada pela realocação de recursos de Depósitos Interfinanceiros – DI para operação compromissada com lastro em Título Público Federal.

4. Risco de Crédito

4.1 Estrutura de Gerenciamento do Risco de Crédito

O risco de crédito é a possibilidade de ocorrência de perda associada a:

- não cumprimento pela contraparte de suas obrigações nos termos pactuados;

- b) desvalorização, redução de remunerações e ganhos esperados em instrumento financeiro decorrentes da deterioração da qualidade creditícia da contraparte, do interveniente ou do instrumento mitigador;
- c) reestruturação de instrumentos financeiros; ou
- d) custos de recuperação de exposições caracterizadas como ativos problemáticos.

A estrutura de gerenciamento do risco de crédito prevê:

- a) fixação de políticas e estratégias, incluindo limites de riscos;
- b) estimação (critérios consistentes e prudentes) de perdas associadas ao risco de crédito, bem como a comparação dos valores estimados com as perdas efetivamente observadas;
- c) procedimentos para o monitoramento das carteiras de crédito;
- d) identificação e tratamento de ativos problemáticos;
- e) sistemas, rotinas e procedimentos para identificar, mensurar, controlar e mitigar a exposição ao risco de crédito e o cumprimento das estratégias;
- f) monitoramento e reporte dos limites de apetite por riscos;
- g) informações gerenciais periódicas para as entidades do conglomerado;
- h) modelos para avaliação do risco de crédito de contraparte, de acordo com a operação e o público envolvido, que levam em conta características específicas dos entes, bem como questões setoriais e macroeconômicas;
- i) aplicação de testes de estresse, identificando e avaliando potenciais vulnerabilidades da instituição;
- j) limites de crédito para cada cliente e limites globais por carteira ou por linha de crédito; e
- k) avaliação específica de risco em novos produtos e serviços.

As normas internas do gerenciamento de risco de crédito incluem a estrutura organizacional e normativa, os modelos de classificação de risco de tomadores e de operações, os limites globais e individuais, a utilização de sistemas computacionais, a formação de comitês específicos e independentes e o acompanhamento sistematizado, contemplando a validação de modelos e conformidade dos processos.

Os processos de crédito e de gerenciamento de risco de crédito são segregados e a estrutura organizacional envolvida garante especialização, representação e racionalidade.

4.2 CR1: Qualidade creditícia das exposições

SICOOB					
Tabela CR1: Qualidade creditícia das exposições					
Frequência: Semestral					
Data de Atualização: 30/06/2022					
				R\$ mil	
	a	b	c	g	
	Valor Bruto				
	Exposições caracterizadas como operações em curso anormal	Em curso normal	Provisões, Adiantamentos e rendas a apropriar	Valor Líquido	
1	Concessão de crédito	-	736.397	3.180	733.216
2	Títulos de dívida	-	-	-	-
2a	dos quais: títulos soberanos nacionais	-	-	-	-
2b	dos quais: outros títulos	-	-	-	-
3	Operações não contabilizadas no balanço patrimonial	-	674.458	-	674.458
4	Total	-	1.410.855	3.180	1.407.674

4.3 CR2: Mudanças no estoque de operações em curso anormal

SICOOB		R\$ mil
Tabela CR2: Mudanças no estoque de operações em curso anormal		
Frequência: Semestral		
Data de Atualização: 30/06/2022		
		jun-22 Total
1	Valor das operações em curso anormal no final do período anterior	-
2	Valor das operações que passaram a ser classificadas como em curso anormal no período corrente	-
3	Valor das operações reclassificadas para curso normal	-
4	Valor da baixa contábil por prejuízo	-
5	Outros ajustes	-
6	Valor das operações em curso anormal no final do período corrente	-

A central não possui operações em curso anormal.

5. Risco de Mercado

5.1 Estrutura de Gerenciamento do Risco de Mercado

O risco de mercado é a possibilidade de ocorrência de perdas resultantes da flutuação de valores de mercado de instrumentos detidos pela instituição, e inclui os riscos da variação das taxas de juros, dos preços das ações, da variação cambial e dos preços de mercadorias (commodities).

O Sicoob Central Crediminas utiliza a estrutura centralizada do CCS que dispõe de área especializada para gerenciamento de risco de mercado, com o objetivo de assegurar que o risco da instituição seja administrado de acordo com os níveis definidos na Declaração de Apetite por Riscos (RAS) e com as diretrizes previstas nas políticas e manuais institucionais.

A estrutura de gerenciamento do risco de mercado prevê:

- a) mensuração e avaliação do risco (Value at Risk – VaR);
- b) monitoramento e reporte dos limites;
- c) aplicação cenários de estresse.


Para o cálculo das parcelas de risco de mercado RWA_{JUR1} , RWA_{JUR2} , RWA_{JUR3} , RWA_{JUR4} , RWA_{CAM} , RWA_{COM} e RWA_{ACS} , são utilizadas metodologias padronizadas de acordo como os fatores de risco dos instrumentos classificados na carteira de negociação.

5.2 MR1: Abordagem padronizada – fatores de risco associados ao risco de mercado

		R\$ mil	
		RWA_{MPAD}	
		jun-22	mar-22
1 Taxas de juros		-	-
1a	Taxas de juros prefixada denominadas em Real (RWA_{JUR1})	-	-
1b	Taxas dos cupons de moeda estrangeira (RWA_{JUR2})	-	-
1c	Taxas dos cupons de índices de preço (RWA_{JUR3})	-	-
1d	Taxas dos cupons de taxas de juros (RWA_{JUR4})	-	-
2 Preços de ações (RWA_{ACS})		-	-
3 Taxas de câmbio (RWA_{CAM})		-	-
4 Preços de mercadorias (RWA_{COM})		-	-
9 Total		-	-

A central não possui instrumentos financeiros na carteira de negociação.

5.3 Carteira de Derivativos

 Informações quantitativas dos derivativos classificados na carteira de negociação Frequência: Trimestral Data de Atualização: 30/06/2022				
R\$ mil				
Derivativos no Brasil - Com Contraparte Central				
Fatores de Risco	junho-22		março-22	
	Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
Ações e Índices	-	-	-	-
Câmbio	-	-	-	-
Taxa de juros	-	-	-	-
Commodities	-	-	-	-

Somente posições classificadas na carteira de negociação (trading book).

A central não possui derivativos em carteira.

O Relatório de Pilar 3 foi apresentado e aprovado pelo Conselho de Administração em sua Reunião Ordinária realizada em 24 e 25/08/2022.

JOÃO BATISTA BARTOLI DE NORONHA
Presidente do Conselho de Administração

CARLOS MAURICIO MASCARENHAS MOTA
Conselheiro de Administração

CÉLIO MACHADO DE CASTRO
Conselheiro de Administração

ERIVELTON LAUDIMAR DE OLIVEIRA
Conselheiro de Administração

FRANCISCO COSTA JUNIOR
Conselheiro de Administração

LEONARDO LIMA DIOGO
Conselheiro de Administração

LUCIANO DE OLIVEIRA CUNHA
Conselheiro de Administração

REGINALDO DIAS MACHADO
Conselheiro de Administração

TIAGO AUGUSTO PEREIRA BASILIO
Conselheiro de Administração