

CONGLOMERADO PRUDENCIAL BNP PARIBAS BRASIL

RELATÓRIO INFORMATIVO SOBRE GERENCIAMENTO DE RISCOS BASILEIA – PILAR III

RESOLUÇÃO BCB 54/20

1º TRIMESTRE DE 2023



BNP PARIBAS

O banco
para um mundo
em mudança

Introdução.....	3
Tabela KM1 - Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais	4
Tabela OV1: Visão geral dos ativos ponderados pelo risco (RWA).....	5
Tabela MR1: Abordagem padronizada - fatores de risco associados ao risco de mercado.....	6
Tabela OPD: Total da exposição a instrumentos financeiros derivativos	7



Introdução

Este documento é elaborado conforme estabelecido pela Circular 3.930 E Resolução 54, do Banco Central do Brasil, para as empresas do Conglomerado Prudencial do BNP Paribas Brasil.

O Conglomerado Prudencial BNP Paribas Brasil contempla empresas financeiras e não-financeiras do BNP Paribas Brasil e da Cetelem Brasil.

Outras informações e demonstrações contábeis do Grupo BNP Paribas Brasil estão disponibilizadas nos seguintes sites:

<https://brasil.bnpparibas/pt/>

<http://www.cetelem.com.br>



Tabela KM1 - Informações quantitativas sobre os requerimentos prudenciais

	R\$ mil				
Capital Regulamentar	Mar-23	Dec-22	Sep-22	Jun-22	Mar-22
1 - Capital Principal	3.925.954	3.854.052	4.019.799	4.022.815	3.967.072
2 - Nível I	4.958.748	4.416.256	4.578.705	4.586.542	3.967.072
3 - Patrimônio de Referência (PR)	5.880.369	5.360.555	5.528.384	5.546.485	4.869.495
3b - Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente	-	-	-	-	-
3c - Destaque do PR	-	-	-	-	-
Ativos ponderados pelo risco (RWA)					
4 - RWA Total	35.462.585	34.169.897	38.989.735	39.257.804	42.049.606
Capital regulamentar como proporção do RWA					
5 - Índice de Capital Principal (ICP)	11,07 %	11,28 %	10,31 %	10,25 %	9,43 %
6 - Índice de Nível 1 (%)	13,98 %	12,92 %	11,74 %	11,68 %	9,43 %
7 - Índice de Basileia	16,58 %	15,69 %	14,18 %	14,13 %	11,58 %
Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA					
8 - Adicional de Conservação de Capital Principal - ACPConservação (%)	2,50 %	2,50 %	2,50 %	2,50 %	2,00 %
9 - Adicional Contracíclico de Capital Principal - ACPContracíclico (%)	-	-	-	-	-
10 - Adicional de Importância Sistêmica de Capital Principal - ACPSistêmico (%)	-	-	-	-	-
11 - ACP total (%)	2,50 %	2,50 %	2,50 %	2,50 %	2,00 %
12 - Margem excedente de Capital Principal (%)	4,07 %	4,28 %	3,24 %	3,18 %	1,43 %
Razão de Alavancagem (RA)					
13 - Exposição total	49.002.193	50.960.188	54.115.467	53.768.390	49.565.777
14 - RA (%)	10,12 %	8,67 %	8,46 %	8,53 %	8,00 %
Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)					
15 - Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA)	-	-	-	-	-
16 - Total de saídas líquidas de caixa	-	-	-	-	-
17 - LCR (%)	-	-	-	-	-
Indicador de Liquidez de Longo Prazo (NSFR)					
18 - Recursos estáveis disponíveis (ASF)	-	-	-	-	-
19 - Recursos estáveis requeridos (RSF)	-	-	-	-	-
20 - NSFR (%)	-	-	-	-	-



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

	Mar-23	Dec-22	R\$ mil Requerimento Mínimo
0 - Risco de Crédito - tratamento mediante abordagem padronizada	27.125.312	26.018.165	2.170.025
2 - Risco de crédito em sentido estrito	19.056.574	19.046.265	1.524.526
6 - Risco de crédito de contraparte (CCR)	5.037.622	3.787.413	403.010
7 - Do qual: mediante abordagem padronizada para risco de crédito de contraparte (SA-CCR)	-	-	-
7a - Do qual: mediante uso da abordagem CEM	3.938.229	3.175.209	315.058
9 - Do qual: mediante demais abordagens	1.099.392	612.204	87.951
10 - Acréscimo relativo ao ajuste associado à variação do valor dos derivativos em decorrência de variação da qualidade creditícia da contraparte (CVA)	2.001.628	2.154.187	160.130
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	1.029.488	1.030.301	82.359
20 - Risco de Mercado	3.857.118	3.608.894	308.569
21 - Do qual: requerimento calculado mediante abordagem padronizada (RWAMPAD)	3.857.118	3.608.894	308.569
22 - Do qual: requerimento calculado mediante modelo interno (RWAMINT)	-	-	-
24 - Risco operacional	4.480.156	4.542.838	358.412
27 - TOTAL	35.462.585	34.169.897	2.837.007



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

	R\$ mil
Capital Regulamentar	Mar-23
Taxas de juros	3.487.083
Taxas de juros prefixada denominadas em Real (RWAJUR1)	1.075.599
Taxas dos cupons de moeda estrangeira (RWAJUR2)	2.301.755
Taxas dos cupons de índices de preço (RWAJUR3)	109.730
Taxas dos cupons de taxas de juros (RWAJUR4)	-
Preços de ações (RWAACS)	4.419
Taxas de câmbio (RWACAM)	356.867
Preços de mercadorias (commodities) (RWACOM)	8.748
Total	3.857.118



Tabela OPD: Total da exposição a instrumentos financeiros derivativos

R\$ mil

Mar-23	Posição Comprada – Liquidadas em contraparte central – No Brasil	Posição Comprada – Liquidadas em contraparte central – No exterior	Posição Comprada – Não liquidadas em contraparte central – No Brasil	Posição Comprada – Não liquidadas em contraparte central – No exterior	Posição Vendida – Liquidadas em contraparte central – No Brasil	Posição Vendida – Liquidadas em contraparte central – No exterior	Posição Vendida – Não liquidadas em contraparte central – No Brasil	Posição Vendida – Não liquidadas em contraparte central – No exterior
Taxas de juros	53.796.595	0	24.640.861	0	-38.436.219	0	-44.246.671	0
Taxas de câmbio	24.031.053	0	27.984.057	0	-6.849.962	0	-40.745.447	0
Preço de ações	0	0	487.196	0	0	0	-486.379	0
Preços de mercadorias (commodities)	0	0	846.939	0	0	0	-845.545	0

