

Anexo I - Limites de Risco de Mercado


Última Atualização: Agosto 2022

CNPJ	Métrica	Limite (%PL)	Métrica Adicional	Limite (%PL)	Observações de Metodologia
00.836.263/0001-35	VaR	0,22%	Stress Testing	1,76%	Var Paramétrico
03.319.016/0001-50	T.E.	6,00%	N/A	-	-
04.240.128/0001-83	VaR	0,08%	Stress Testing	0,15%	Var Paramétrico
08.541.158/0001-80	VaR	2,12%	Stress Testing	5,00%	Var Paramétrico
08.669.394/0001-87	VaR	0,05%	Stress Testing	0,10%	Var Paramétrico
08.702.251/0001-20	T.E.	6,00%	Stress Testing	20,00%	-
09.083.848/0001-04	VaR	0,06%	Stress Testing	0,12%	Var Paramétrico
09.083.868/0001-77	VaR	1,77%	Stress Testing	4,45%	Var Paramétrico
09.352.825/0001-40	T.E.	6,00%	N/A	-	-
10.347.453/0001-42	BVaR	0,10%	N/A	-	BVar Paramétrico
10.347.493/0001-94	VaR	0,08%	Stress Testing	0,15%	Var Paramétrico
10.459.310/0001-22	VaR	0,50%	N/A	-	Var Paramétrico
10.459.361/0001-54	VaR	1,15%	N/A	-	Var Paramétrico
13.049.682/0001-79	BVaR	0,10%	N/A	-	BVar Paramétrico
13.611.616/0001-40	BVaR	0,10%	N/A	-	BVar Paramétrico
13.614.709/0001-29	T.E.	12,00%	N/A	-	-
13.614.712/0001-42	VaR	4,50%	N/A	-	Var Paramétrico
14.491.580/0001-71	BVaR	0,10%	N/A	-	BVar Paramétrico
14.491.665/0001-50	VaR	0,08%	Stress Testing	0,15%	Var Paramétrico
20.468.585/0001-86	VaR	0,50%	N/A	-	Var Paramétrico
20.468.746/0001-31	BVaR Histórico	1,00%	N/A	-	BVar Histórico
21.889.006/0001-31	VaR	3,50%	N/A	-	Var Paramétrico
21.937.940/0001-81	VaR	2,15%	Stress Testing	12,00%	Var Paramétrico
22.013.560/0001-13	VaR	2,15%	Stress Testing	12,00%	Var Paramétrico
26.190.993/0001-03	T.E.	6,00%	Stress Testing	20,00%	-
32.471.535/0001-37	VaR	0,90%	N/A	-	Var Paramétrico
32.471.603/0001-68	T.E.	5,00%	N/A	-	-
32.485.462/0001-32	T.E.	2,00%	N/A	-	-
32.485.590/0001-86	BVaR	0,60%	N/A	-	BVar Paramétrico
08.830.058/0001-74	VaR	0,15%	N/A	-	Var Paramétrico
14.435.448/0001-42	BVaR	15,00%	N/A	-	BVar Paramétrico
27.619.757/0001-14	BVaR	15,00%	N/A	-	BVar Paramétrico
32.471.551/0001-20	T.E.	0,50%	N/A	-	-
09.344.799/0001-08	BVaR	0,10%	N/A	-	BVar Paramétrico
06.866.051/0001-87	VaR	0,08%	Stress Testing	0,15%	Var Paramétrico
10.342.116/0001-62	BVaR	0,10%	N/A	-	BVar Paramétrico
13.060.032/0001-24	BVaR	0,10%	N/A	-	BVar Paramétrico
26.253.875/0001-99	VaR	0,12%	N/A	-	Var Paramétrico
10.347.582/0001-30	VaR	0,05%	Stress Testing	0,10%	Var Paramétrico
09.238.487/0001-10	VaR	0,05%	Stress Testing	0,10%	Var Paramétrico
32.655.641/0001-70	T.E.	10,00%	Stress Testing	25,00%	-
10.941.848/0001-79	VaR	0,90%	N/A	-	Var Paramétrico
32.485.602/0001-72	T.E.	6,00%	N/A	-	-
32.471.624/0001-83	T.E.	6,00%	N/A	-	-
42.119.530/0001-01	BVaR	3,27%	N/A	-	BVar Paramétrico
26.978.139/0001-06	Stress	4,00%	N/A	-	-
13.049.660/0001-09	VaR	0,20%	Stress Testing	1,00%	Var Paramétrico
08.533.743/0001-39	VaR	2,20%	N/A	-	Var Paramétrico
09.166.056/0001-95	VaR	0,06%	N/A	-	Var Paramétrico
13.301.457/0001-88	T.E.	0,50%	N/A	-	-
14.491.564/0001-89	VaR	1,00%	Stress Testing	4,00%	Var Paramétrico
26.154.129/0001-48	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
17.709.834/0001-73	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
27.619.922/0001-38	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
27.619.604/0001-77	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
09.620.232/0001-17	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
17.295.128/0001-22	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
07.287.522/0001-65	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico

Anexo I - Limites de Risco de Mercado



Ultima Atualização: Agosto 2022

CNPJ	Métrica	Limite (%PL)	Métrica Adicional	Limite (%PL)	Observações de Metodologia
21.934.961/0001-43	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
17.709.794/0001-60	VaR	0,45%	N/A	-	Var Paramétrico
16.858.948/0001-12	VaR	1,10%	N/A	-	Var Paramétrico
08.853.235/0001-38	VaR	1,40%	N/A	-	Var Paramétrico
16.878.608/0001-53	VaR	1,20%	N/A	-	Var Paramétrico
25.987.643/0001-00	VaR	0,35%	N/A	-	Var Paramétrico
25.999.993/0001-88	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
14.473.010/0001-59	BVaR	1,60%	N/A	-	BVar Paramétrico
25.987.663/0001-72	T.E.	6,00%	N/A	-	-
22.013.592/0001-19	T.E.	5,00%	N/A	-	-
26.344.512/0001-69	VaR	0,50%	N/A	-	Var Paramétrico
32.485.558/0001-09	VaR	0,90%	N/A	-	Var Paramétrico
32.485.565/0001-00	T.E.	12,00%	N/A	-	-
25.987.700/0001-42	VaR	0,95%	N/A	-	Var Paramétrico
20.906.371/0001-44	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
14.435.487/0001-40	VaR	0,90%	N/A	-	Var Paramétrico
10.346.873/0001-04	VaR	0,50%	N/A	-	Var Paramétrico
27.619.801/0001-96	VaR	0,65%	N/A	-	Var Paramétrico
69.093.714/0001-98	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
03.574.147/0001-83	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
71.581.276/0001-59	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
05.925.923/0001-78	VaR	0,80%	N/A	-	Var Paramétrico
22.013.612/0001-51	VaR	1,10%	N/A	-	Var Paramétrico
14.472.938/0001-19	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
26.173.277/0001-00	VaR	2,00%	N/A	-	Var Paramétrico
27.619.587/0001-78	VaR	0,20%	N/A	-	Var Paramétrico
05.426.951/0001-40	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
10.941.806/0001-38	VaR	3,00%	N/A	-	Var Paramétrico
10.924.200/0001-94	VaR	6,00%	N/A	-	Var Paramétrico
10.489.208/0001-70	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
11.733.898/0001-23	VaR	0,75%	N/A	-	Var Paramétrico
31.569.976/0001-03	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
14.435.466/0001-24	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
14.473.061/0001-80	VaR	0,10%	N/A	-	Var Paramétrico
36.157.723/0001-46	VaR	0,15%	N/A	-	Var Paramétrico
09.617.446/0001-34	VaR	0,30%	N/A	-	Var Paramétrico
08.487.045/0001-44	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
13.052.890/0001-27	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
10.489.228/0001-40	VaR	1,10%	N/A	-	Var Paramétrico
07.288.048/0001-96	VaR	1,10%	N/A	-	Var Paramétrico
07.287.974/0001-47	VaR	1,10%	N/A	-	Var Paramétrico
32.485.595/0001-09	VaR	1,40%	N/A	-	Var Paramétrico
17.634.271/0001-00	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
32.485.610/0001-19	VaR	1,40%	N/A	-	Var Paramétrico
07.287.538/0001-78	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
08.853.256/0001-53	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
05.926.147/0001-20	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
07.287.884/0001-56	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
10.489.023/0001-65	VaR	1,70%	N/A	-	Var Paramétrico
10.489.180/0001-70	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
22.013.584/0001-72	VaR	0,70%	N/A	-	Var Paramétrico
25.987.689/0001-10	VaR	1,10%	N/A	-	Var Paramétrico
08.418.598/0001-45	VaR	1,40%	N/A	-	Var Paramétrico
14.472.960/0001-69	VaR	1,10%	N/A	-	Var Paramétrico
42.774.871/0001-02	BVaR	5,00%	N/A	-	BVar Paramétrico
26.000.010/0001-10	VaR	1,40%	N/A	-	Var Paramétrico