

KM1– INFORMAÇÕES QUANTITATIVAS SOBRE OS REQUERIMENTOS PRUDENCIAIS RESPONSÁVEL: DFIN

| | | 1/2020 |
|---|---|--------------|
| Capital Regulamentar - Valores | | |
| 1 | Capital Principal | 1.460.824,00 |
| 2 | Nível I | 1.460.824,00 |
| 3 | Patrimônio de Referência (PR) | 1.460.824,00 |
| 3b | Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente | 0,00 |
| 3c | Destaque do PR | 0,00 |
| Ativos ponderados pelo risco (RWA) - valores | | |
| 4 | RWA total | 4.685.457,00 |
| Capital regulamentar como proporção do RWA | | |
| 5 | Índice de Capital Principal (ICP) | 31,18% |
| 6 | Índice de Nível 1 (%) | 31,18% |
| 7 | Índice de Basileia | 31,18% |
| Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA | | |
| 8 | Adicional de Conservação de Capital Principal - ACP Conservação (%) | 2,50% |
| 9 | Adicional de Contracíclico de Capital Principal - ACP Contracíclico (%) | 0,00% |
| 10 | Adicional de Importância Sistêmica de Capital Principal - ACP Sistêmico (%) | 0,00% |
| 11 | ACP total (%) | 2,50% |
| 12 | Margem excedente de Capital Principal (%) | 20,68% |
| Razão de Alavancagem (RA) | | |
| 13 | Exposição total | 8.957.413,00 |
| 14 | RA (%) | 16,31% |
| Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR) | | |
| 15 | Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA) | 3.637.457,00 |
| 16 | Total de saídas líquidas de caixa | 6.382.169,00 |
| 17 | LCR (%) | 228,00% |
| Indicador de Liquidez de Longo Prazo (NSFR) | | |
| 18 | Recursos estáveis disponíveis (ASF) | 0,00 |
| 19 | Recursos estáveis requeridos (RSF) | 0,00 |
| 20 | NSFR (%) | 0,00% |