

KM1– INFORMAÇÕES QUANTITATIVAS SOBRE OS REQUERIMENTOS PRUDENCIAIS RESPONSÁVEL: DFIN

		3/2020	2/2020	1/2020
Capital Regulamentar - Valores				
1	Capital Principal	1.524.752,00	1.463.021,00	1.460.824,00
2	Nível I	1.524.752,00	1.463.021,00	1.460.824,00
3	Patrimônio de Referência (PR)	1.524.752,00	1.463.021,00	1.460.824,00
3b	Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente	0,00	0,00	0,00
3c	Destaque do PR	0,00	0,00	0,00
Ativos ponderados pelo risco (RWA) - valores				
4	RWA total	4.753.423,00	5.524.064,00	4.685.457,00
Capital regulamentar como proporção do RWA				
5	Índice de Capital Principal (ICP)	32,08%	26,48%	31,18%
6	Índice de Nível 1 (%)	32,08%	26,48%	31,18%
7	Índice de Basileia	32,08%	26,48%	31,18%
Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA				
8	Adicional de Conservação de Capital Principal - ACP Conservação (%)	1,25%	1,25%	2,50%
9	Adicional de Contracíclico de Capital Principal - ACP Contracíclico (%)	0,00%	0,00%	0,00%
10	Adicional de Importância Sistêmica de Capital Principal - ACP Sistêmico (%)	0,00%	0,00%	0,00%
11	ACP total (%)	1,25%	1,25%	2,50%
12	Margem excedente de Capital Principal (%)	22,83%	15,98%	20,68%
Razão de Alavancagem (RA)				
13	Exposição total	10.219.654,00	9.896.927,00	8.957.413,00
14	RA (%)	14,92%	14,78%	16,31%
Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)				
15	Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA)	4.323.762,00	3.923.155,00	3.637.457,00
16	Total de saídas líquidas de caixa	7.456.452,00	5.200.897,00	6.382.169,00
17	LCR (%)	232,00%	302,00%	228,00%
Indicador de Liquidez de Longo Prazo (NSFR)				
18	Recursos estáveis disponíveis (ASF)	0,00	0,00	0,00
19	Recursos estáveis requeridos (RSF)	0,00	0,00	0,00
20	NSFR (%)	0,00%	0,00%	0,00%