

KM1– INFORMAÇÕES QUANTITATIVAS SOBRE OS REQUERIMENTOS PRUDENCIAIS RESPONSÁVEL: DFIN

		3/2021	2/2021	1/2021	4/2020	3/2020
Capital Regulamentar - Valores						
1	Capital Principal	1.567.943,00	1.569.153,00	1.518.122,00	1.527.794,00	1.524.752,00
2	Nível I	1.567.943,00	1.569.153,00	1.518.122,00	1.527.794,00	1.524.752,00
3	Patrimônio de Referência (PR)	1.567.943,00	1.569.153,00	1.518.122,00	1.527.794,00	1.524.752,00
3b	Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
3c	Destaque do PR	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Ativos ponderados pelo risco (RWA) - valores						
4	RWA total	4.166.265,00	4.186.639,00	4.314.987,00	4.297.288,00	4.753.423,00
Capital regulamentar como proporção do RWA						
5	Índice de Capital Principal (ICP)	37,63%	37,48%	35,18%	35,55%	32,08%
6	Índice de Nível 1 (%)	37,63%	37,48%	35,18%	35,55%	32,08%
7	Índice de Basileia	37,63%	37,48%	35,18%	35,55%	32,08%
Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA						
8	Adicional de Conservação de Capital Principal - ACP Conservação (%)	1,62%	1,62%	1,25%	1,25%	1,25%
9	Adicional de Contracíclico de Capital Principal - ACP Contracíclico (%)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
10	Adicional de Importância Sistêmica de Capital Principal - ACP Sistêmico (%)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
11	ACP total (%)	1,62%	1,62%	1,25%	1,25%	1,25%
12	Margem excedente de Capital Principal (%)	28,01%	27,86%	25,93%	27,55%	22,83%
Razão de Alavancagem (RA)						
13	Exposição total	8.622.308,00	7.781.687,00	9.414.244,00	10.174.719,00	10.219.654,00
14	RA (%)	18,18%	20,16%	16,13%	15,02%	14,92%
Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)						
15	Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA)	3.783.525,00	2.678.140,00	3.829.263,00	4.375.923,00	4.323.762,00
16	Total de saídas líquidas de caixa	4.803.027,00	4.045.239,00	4.969.781,00	5.633.305,00	7.456.452,00
17	LCR (%)	315,00%	265,00%	308,00%	311,00%	232,00%
Indicador de Liquidez de Longo Prazo (NSFR)						
18	Recursos estáveis disponíveis (ASF)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
19	Recursos estáveis requeridos (RSF)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
20	NSFR (%)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%