

KM1– INFORMAÇÕES QUANTITATIVAS SOBRE OS REQUERIMENTOS PRUDENCIAIS RESPONSÁVEL: DFIN

(Em reais mil)		2/2022	1/2022	4/2021	3/2021	2/2021
Capital Regulamentar - Valores						
1	Capital Principal	1.525.893	1.555.342	1.515.518	1.567.943	1.569.153
2	Nível I	1.525.893	1.555.342	1.515.518	1.567.943	1.569.153
3	Patrimônio de Referência (PR)	1.525.893	1.555.342	1.515.518	1.567.943	1.569.153
3b	Excesso dos recursos aplicados no ativo permanente	0	0	0	0	0
3c	Destaque do PR	0	0	0	0	0
Ativos ponderados pelo risco (RWA) - valores						
4	RWA total	5.962.043	4.389.911	4.158.133	4.166.265	4.186.639
Capital regulamentar como proporção do RWA						
5	Índice de Capital Principal (ICP)	25,59%	35,43%	36,45%	37,63%	37,48%
6	Índice de Nível 1 (%)	25,59%	35,43%	36,45%	37,63%	37,48%
7	Índice de Basileia	25,59%	35,43%	36,45%	37,63%	37,48%
Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA						
8	Adicional de Conservação de Capital Principal - ACP Conservação (%)	2,50%	2,00%	2,00%	1,62%	1,62%
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 Sistemico (%)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
11	ACP total (%)	2,50%	2,00%	2,00%	1,62%	1,62%
12	Margem excedente de Capital Principal (%)	15,09%	25,43%	26,45%	28,01%	27,86%
Razão de Alavancagem (RA)						
13	Exposição total	8.147.967	8.608.008	8.184.330	8.622.308	7.781.687
14	RA (%)	18,73%	18,07%	18,52%	18,18%	20,16%
Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)						
15	Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA)	2.886.999	3.096.784	3.333.969	3.783.525	2.678.140
16	Total de saídas líquidas de caixa	4.397.867	4.957.854	4.337.604	4.803.027	4.045.239
17	LCR (%)	263,00%	250,00%	307,00%	315,00%	265,00%
Indicador de Liquidez de Longo Prazo (NSFR)						
18	Recursos estáveis disponíveis (ASF)	0	0	0	0	0
19	Recursos estáveis requeridos (RSF)	0	0	0	0	0
20	NSFR (%)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%