

KM1– INFORMAÇÕES QUANTITATIVAS SOBRE OS REQUERIMENTOS PRUDENCIAIS RESPONSÁVEL: DFIN

| (Em reais mil) | | 2/2023 | 1/2023 | 4/2022 | 3/2022 | 2/2022 |
|---|---|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| Capital Regulamentar - Valores | | | | | | |
| 1 | Capital Principal | 1.652.608 | 1.639.804 | 1.626.269 | 1.549.490 | 1.525.893 |
| 2 | Nível I | 1.652.608 | 1.639.804 | 1.626.269 | 1.549.490 | 1.525.893 |
| 3 | Patrimônio de Referência (PR) | 1.652.608 | 1.639.804 | 1.626.269 | 1.549.490 | 1.525.893 |
| 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 | 5.090.317 | 4.512.868 | 4.356.931 | 4.979.452 | 5.962.043 |
| Capital regulamentar como proporção do RWA | | | | | | |
| 5 | Índice de Capital Principal (ICP) | 32,46% | 36,34% | 37,33% | 31,12% | 25,59% |
| 6 | Índice de Nível 1 (%) | 32,46% | 36,34% | 37,33% | 31,12% | 25,59% |
| 7 | Índice de Basileia | 32,46% | 36,34% | 37,33% | 31,12% | 25,59% |
| Adicional de Capital Principal (ACP) como proporção do RWA | | | | | | |
| 8 | Adicional de Conservação de Capital Principal - ACP Conservação (%) | 2,50% | 2,50% | 2,50% | 2,50% | 2,50% |
| 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% | 2,50% | 2,50% | 2,50% | 2,50% |
| 12 | Margem excedente de Capital Principal (%) | 21,96% | 25,84% | 26,83% | 20,62% | 15,09% |
| Razão de Alavancagem (RA) | | | | | | |
| 13 | Exposição total | 6.968.627 | 7.034.203 | 8.041.223 | 7.764.415 | 8.147.967 |
| 14 | RA (%) | 23,71% | 23,31% | 20,22% | 19,96% | 18,73% |
| Indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR) | | | | | | |
| 15 | Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA) | 3.325.187 | 3.771.980 | 3.554.959 | 3.814.449 | 2.886.999 |
| 16 | Total de saídas líquidas de caixa | 5.368.506 | 4.732.721 | 4.358.600 | 4.071.236 | 4.397.867 |
| 17 | LCR (%) | 248,00% | 319,00% | 326,00% | 375,00% | 263,00% |
| 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% |