

ANEXO

Informações sobre o indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)			
		Valor Médio ¹ (R\$ mil)	Valor Ponderado Médio ² (R\$ mil)
Número da linha	Ativos de Alta Liquidez (HQLA)		
1	Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA)		
Número da linha	Saídas de Caixa		
2	Captações de varejo, das quais:		
3	<i>Captações estáveis</i>		
4	<i>Captações menos estáveis</i>		
5	Captações de atacado não colateralizadas, das quais:		
6	<i>Depósitos operacionais (todas as contrapartes) e depósitos de cooperativas filiadas</i>		
7	<i>Depósitos não-operacionais (todas as contrapartes)</i>		
8	<i>Demais captações de atacado não colateralizadas</i>		
9	Captações de atacado colateralizadas		
10	Requerimentos adicionais, dos quais:		
11	<i>Relacionados a exposição a derivativos e a outras exigências de colateral</i>		
12	<i>Relacionados a perda de captação por meio de emissão de instrumentos de dívida</i>		
13	<i>Relacionados a linhas de crédito e de liquidez</i>		
14	Outras obrigações contratuais		
15	Outras obrigações contingentes		
16	Total de saídas de caixa		
Número da linha	Entradas de Caixa		
17	Empréstimos colateralizados		
18	Operações concedidas em aberto, integralmente adimplentes		
19	Outras entradas de caixa		
20	Total de entradas de caixa		
			Valor Total Ajustado ³ (R\$ mil)
21	Total HQLA		
22	Total de saídas líquidas de caixa		
23	LCR (%)		

¹ Corresponde ao saldo total referente ao item de entradas ou saídas de caixa.

² Corresponde ao valor após aplicação dos fatores de ponderação.

³ Corresponde ao valor calculado após a aplicação dos fatores de ponderação e dos limites (Nível 2 e 2B e entradas de caixa)

Instrução de preenchimento da Tabela “Informações sobre o indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR)”

Número da linha	Instrução de Preenchimento
1	Soma dos HQLA, antes da aplicação de qualquer limite, excluindo ativos que não se enquadram nos requerimentos operacionais, conforme arts. 4º a 9º
2	Soma das linhas 3 e 4
3	Conforme art. 13, incisos I e II, e arts. 11 e 12
4	Conforme art. 13, inciso III, e arts. 11 e 12
5	Soma das linhas 6, 7 e 8
6	Conforme arts. 15 a 17
7	Conforme incisos I, II e III do art. 18 e art. 19
8	Conforme inciso I do art. 22
9	Conforme art. 20 e 21
10	Soma das linhas 11, 12 e 13
11	Conforme arts. 23 e 25
12	Requerimentos de caixa adicionais, relacionados a perda de captação por meio de emissão de instrumentos financeiros, conforme incisos II e III do art. 22
13	Conforme art. 26
14	Conforme arts. 23 e 28
15	Conforme art. 27
16	Soma das linhas 2, 5, 9, 10, 14 e 15
17	Conforme art. 31
18	Conforme arts. 32, 33 e alínea “a” do inciso III do art. 38
19	Conforme arts. 34 a 38, exceto alínea “a” do inciso III do art. 38
20	Soma das linhas 17, 18 e 19
21	Total do HQLA após a aplicação de limites aplicáveis no HQLA de Nível 2 e de Nível 2B, conforme o art. 7º
22	Linha 16 subtraída da linha 20, após a aplicação de limite nas entradas de caixa, conforme parágrafo único do art. 2º
23	Valor do indicador Liquidez de Curto Prazo (LCR), após a aplicação de limites no HQLA de Nível 2 e de Nível 2B e nas entradas de caixa