



BANCO CENTRAL DO BRASIL

Tabela LIQ1: Indicador de Liquidez de Curto Prazo (LCR)

Objetivo: Informar as entradas e saídas de caixa, bem como o estoque de Ativos de Alta Liquidez (HQLA) da instituição, conforme definições e metodologia de cálculo estabelecidas na Circular nº 3.749, de 2015.

Conteúdo: Médias dos valores diários relativos ao trimestre de referência.

Frequência: Trimestral.

Formato: Fixo.

Comentários: Deve ser divulgada a quantidade de observações utilizadas no cálculo das médias do trimestre de referência.

Devem ainda ser prestadas informações suficientes para facilitar o entendimento do cálculo do LCR, podendo abranger:

- variações do LCR ao longo do tempo e dos seus principais determinantes;
- a composição do estoque de HQLA;
- informações sobre o grau de concentração das fontes de captação de recursos; e
- outras entradas e saídas de caixa, quando relevantes.

		a	b
		Valores não ponderados (R\$ mil)	Valores ponderados (R\$ mil)
Ativos de Alta Liquidez (HQLA)			
1	Total de Ativos de Alta Liquidez (HQLA)		
Saídas de caixa			
2	Captações de varejo, das quais:		
3	Captações estáveis		
4	Captações menos estáveis		
5	Captações de atacado não colateralizadas, das quais:		
6	Depósitos operacionais (todas as contrapartes) e depósitos de cooperativas filiadas		
7	Depósitos não-operacionais (todas as contrapartes)		
8	Obrigações não colateralizadas		
9	Captações de atacado colateralizadas		
10	Requerimentos adicionais, dos quais:		
11	Relacionados a exposição a derivativos e a outras exigências de colateral		
12	Relacionados a perda de captação por meio de emissão de instrumentos de dívida		
13	Relacionados a linhas de crédito e de liquidez		
14	Outras obrigações contratuais		



BANCO CENTRAL DO BRASIL

15	Outras obrigações contingentes		
16	Total de saídas de caixa		
Entradas de caixa			
17	Empréstimos colateralizados		
18	Operações em aberto, integralmente adimplentes		
19	Outras entradas de caixa		
20	Total de entradas de caixa		
			Valor Total Ajustado (R\$ mil)
21	Total HQLA		
22	Total de saídas líquidas de caixa		
23	LCR (%)		

Definições

Colunas

Valores não ponderados: Corresponde à média trimestral dos valores diários calculados antes da aplicação dos fatores de ponderação e dos limites, conforme a Circular nº 3.749, de 2015.

Valores ponderados: Corresponde à média trimestral dos valores diários calculados após a aplicação dos fatores de ponderação.

Valor Total Ajustado: Corresponde à média trimestral dos valores diários calculados após a aplicação dos fatores de ponderação e dos limites (Nível 2 e 2B e entradas de caixa).

Nº da linha	Instruções de preenchimento
1	Soma dos Ativos de Alta Liquidez (HQLA), antes da aplicação de qualquer limite, excluindo ativos que não se enquadram nos requerimentos operacionais, conforme os arts. 4º a 9º da Circular nº 3.749, de 2015.
2	Soma das linhas 3 e 4.
3	Conforme o art. 13, inciso II, e os arts. 11 e 12 da Circular nº 3.749, de 2015.
4	Conforme o art. 13, inciso III, e os arts. 11 e 12 da Circular nº 3.749, de 2015.
5	Soma das linhas 6, 7 e 8.
6	Conforme os arts. 15 a 17 da Circular nº 3.749, de 2015.
7	Conforme o art. 18, incisos I, II e III, da Circular nº 3.749, de 2015, exceto as emissões de que tratam o art. 18, § 1º, e o art. 19 da mesma Circular.
8	Conforme o art. 18, inciso III, da Circular nº 3.749, de 2015, exceto os montantes já considerados na linha 7.
9	Conforme os arts. 20 e 21 da Circular nº 3.749, de 2015.
10	Soma das linhas 11, 12 e 13.



BANCO CENTRAL DO BRASIL

11	Conforme os arts. 24 e 25 da Circular nº 3.749, de 2015.
12	Conforme o art. 22 da Circular nº 3.749, de 2015.
13	Conforme o art. 26 da Circular nº 3.749, de 2015.
14	Conforme os arts. 23 e 28 da Circular nº 3.749, de 2015.
15	Conforme o art. 27 da Circular nº 3.749, de 2015.
16	Soma das linhas 2, 5, 9, 10, 14 e 15.
17	Conforme o art. 31 da Circular nº 3.749, de 2015.
18	Conforme os arts. 32, 33 e art. 38, inciso III, alínea "a", da Circular nº 3.749, de 2015.
19	Conforme os arts. 34 a 38 da Circular nº 3.749, de 2015, exceto a alínea "a" do inciso III do art. 38 da mesma Circular.
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 da Circular nº 3.749, de 2015.
22	Linha 16 subtraída da linha 20, após a aplicação de limites nas entradas de caixa, conforme o art. 2º, parágrafo único, da Circular nº 3.749, de 2015.
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.