

Modelo Comum de divulgação de informações sobre a Razão de Alavancagem*

(Data base: set/2023)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 4.011.508	R\$ 4.289.603	R\$ 4.626.391	R\$ 4.706.287	R\$ 5.109.799
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 3.635	-R\$ 1.230	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
3	Total das exposições contabilizadas no BP	R\$ 4.007.874	R\$ 4.288.373	R\$ 4.626.391	R\$ 4.706.287	R\$ 5.109.799
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 84.398	R\$ 80.812	R\$ 61.831	R\$ 15.544	R\$ 19.844
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 46	R\$ 59	R\$ 59	R\$ 66	R\$ 0
6	Ajuste relativo à garantia prestada em operações com derivativos	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
7	Ajuste relativo à margem de garantia diária prestada	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
8	Derivativos em nome de clientes em que não há obrigatoriedade contratual de reembolso em função de falência ou inadimplemento das entidades responsáveis pelo sistema de liquidação	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
9	Valor de referência ajustado em derivativos de crédito	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
10	Ajuste sob o valor de referência ajustado em derivativos de crédito	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
11	Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativos	R\$ 84.445	R\$ 80.871	R\$ 61.890	R\$ 15.610	R\$ 19.844
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
13	Ajuste relativo a recompras a liquidar e credores por empréstimo de TVM	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
14	Valor relativo ao risco de crédito da contraparte	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
15	Valor relativo ao risco de crédito da contraparte em operações de intermediação	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
16	Total das exposições relativas a operações compromissadas e de empréstimo de títulos e valores mobiliários	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	R\$ 8.761	R\$ 13.149	R\$ 73.003	R\$ 93.467	R\$ 101.223
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	R\$ 8.761	R\$ 13.149	R\$ 73.003	R\$ 93.467	R\$ 101.223
Capital e Exposição Total		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
20	Nível I	R\$ 1.016.370	R\$ 1.041.395	R\$ 1.058.174	R\$ 1.083.394	R\$ 1.136.988
21	Exposição Total	R\$ 4.101.079	R\$ 4.382.393	R\$ 4.761.284	R\$ 4.815.364	R\$ 5.230.866
Razão de Alavancagem (RA)		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
22	Razão de Alavancagem de Basileia III.	24,78	23,76	22,22	22,50	21,74

* Valor (R\$ mil)