

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

(Data base: set/16)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		4T15	1T16	2T16	3T16
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 4.596.303	R\$ 4.130.362	R\$ 3.455.475	R\$ 3.453.561
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 5.756	-R\$ 8.151	-R\$ 6.996	-R\$ 6.050
3	Total das exposições contabilizadas no BP	R\$ 4.590.548	R\$ 4.122.211	R\$ 3.448.479	R\$ 3.447.511
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		4T15	1T16	2T16	3T16
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	-	-	-	-
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 730	R\$ 735	R\$ 679	R\$ 505
6	Ajuste relativo à garantia prestada em operações com derivativos	-	-	-	-
7	Ajuste relativo à margem de garantia diária prestada	-	-	-	-
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	-	-	-	-
9	Valor de referência ajustado em derivativos de crédito	-	-	-	-
10	Ajuste sob o valor de referência ajustado em derivativos de crédito	-	-	-	-
11	Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativos	R\$ 730	R\$ 735	R\$ 679	R\$ 505
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		4T15	1T16	2T16	3T16
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	-	-	-	-
13	Ajuste relativo a recompras a liquidar e credores por empréstimo de TVM	-	-	-	-
14	Valor relativo ao risco de crédito da contraparte	-	-	-	-
15	Valor relativo ao risco de crédito da contraparte em operações de intermediação	-	-	-	-
16	Total das exposições relativas a operações compromissadas e de empréstimo de títulos e valores mobiliários	-	-	-	R\$ 0
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		4T15	1T16	2T16	3T16
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	-	-	-	-
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	-	-	-	-
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	-	-	-	-
Capital e Exposição Total		4T15	1T16	2T16	3T16
20	Nível I	R\$ 644.922	R\$ 745.110	R\$ 764.115	R\$ 790.039
21	Exposição Total	R\$ 4.591.278	R\$ 4.122.946	R\$ 3.449.158	R\$ 3.448.015
Razão de Alavancagem (RA)		4T15	1T16	2T16	3T16
22	Razão de Alavancagem de Basileia III.	14,05	18,07	22,15	22,91

* Valor (R\$ mil)