

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

(Data base: set/17)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		3T16	4T16	1T17	2T17	3T17
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 3.453.561	R\$ 3.487.921	R\$ 3.236.878	R\$ 3.107.281	R\$ 2.977.375
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 6.050	-R\$ 7.657	-R\$ 10.396	-R\$ 11.040	-R\$ 11.383
3	Total das exposições contabilizadas no BP	R\$ 3.447.511	R\$ 3.480.264	R\$ 3.226.481	R\$ 3.096.241	R\$ 2.965.992
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		3T16	4T16	1T17	2T17	3T17
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	-	-	-	R\$ 113	R\$ 2.369
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 505	R\$ 534	R\$ 597	R\$ 3.451	R\$ 3.270
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\$ 505	R\$ 534	R\$ 597	R\$ 3.564	R\$ 5.639
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		3T16	4T16	1T17	2T17	3T17
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	-	-	-	-	-
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		3T16	4T16	1T17	2T17	3T17
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		3T16	4T16	1T17	2T17	3T17
20	Nível I	R\$ 790.039	R\$ 767.305	R\$ 813.996	R\$ 840.097	R\$ 840.855
21	Exposição Total	R\$ 3.448.015	R\$ 3.480.798	R\$ 3.227.078	R\$ 3.099.805	R\$ 2.971.631
Razão de Alavancagem (RA)		3T16	4T16	1T17	2T17	3T17
22	Razão de Alavancagem de Basileia III.	22,91	22,04	25,22	27,10	28,30

* Valor (R\$ mil)