

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

(Data base: set/18)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		3T17	4T17	1T18	2T18	3T18
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 2.977.375	R\$ 2.933.371	R\$ 2.610.849	R\$ 2.669.853	R\$ 2.676.979
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 11.383	-R\$ 23.765	-R\$ 26.579	-R\$ 28.866	-R\$ 26.651
3	Total das exposições contabilizadas no BP	R\$ 2.965.992	R\$ 2.909.606	R\$ 2.584.270	R\$ 2.640.987	R\$ 2.650.328
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		3T17	4T17	1T18	2T18	3T18
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 2.369	R\$ 876	R\$ 2.642	R\$ 5.792	-
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 3.270	R\$ 464	R\$ 2.677	R\$ 3.117	R\$ 2.392
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\$ 5.639	R\$ 1.341	R\$ 5.319	R\$ 8.909	R\$ 2.392
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		3T17	4T17	1T18	2T18	3T18
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)		3T17	4T17	1T18	2T18	3T18
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		3T17	4T17	1T18	2T18	3T18
20	Nível I	R\$ 840.855	R\$ 841.234	R\$ 896.424	R\$ 911.353	R\$ 939.582
21	Exposição Total	R\$ 2.971.631	R\$ 2.910.947	R\$ 2.589.589	R\$ 2.649.896	R\$ 2.652.720
Razão de Alavancagem (RA)		3T17	4T17	1T18	2T18	3T18
22	Razão de Alavancagem de Basileia III.	28,30	28,90	34,62	34,39	35,42

* Valor (R\$ mil)