

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

(Data base: jun/2020)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		2T19	3T19	4T19	1T20	2T20
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 2.998.296	R\$ 3.181.667	R\$ 3.379.011	R\$ 2.182.967	R\$ 2.143.167
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 21.133	-R\$ 18.635	-R\$ 17.023	-R\$ 16.459	-R\$ 15.054
3	Total das exposições contabilizadas no BP	R\$ 2.977.163	R\$ 3.163.032	R\$ 3.361.988	R\$ 2.166.508	R\$ 2.128.113
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		2T19	3T19	4T19	1T20	2T20
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 234	R\$ 3.865	-	R\$ 10.564	R\$ 6.013
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 3.640	R\$ 3.967	R\$ 784	R\$ 862	R\$ 952
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\$ 3.874	R\$ 7.833	R\$ 784	R\$ 11.426	R\$ 6.965
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		2T19	3T19	4T19	1T20	2T20
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)		2T19	3T19	4T19	1T20	2T20
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	-	-	-	-	R\$ 0
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	-	-	-	-	R\$ 0
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	-	-	-	-	-
Capital e Exposição Total		2T19	3T19	4T19	1T20	2T20
20	Nível I	R\$ 1.006.911	R\$ 1.023.876	R\$ 1.051.972	R\$ 1.060.666	R\$ 1.070.858
21	Exposição Total	R\$ 2.981.037	R\$ 3.170.865	R\$ 3.362.771	R\$ 2.177.933	R\$ 2.135.079
Razão de Alavancagem (RA)		2T19	3T19	4T19	1T20	2T20
22	Razão de Alavancagem de Basileia III.	33,78	32,29	31,28	48,70	50,16

* Valor (R\$ mil)