

Modelo Comum de divulgação de informações sobre a Razão de Alavancagem*
(Data base: set/2020)

| Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP) | | 3T19 | 4T19 | 1T20 | 2T20 | 3T20 |
|---|---|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 1 | Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas | R\$ 3.181.667 | R\$ 3.379.011 | R\$ 2.182.967 | R\$ 2.143.167 | R\$ 2.251.759 |
| 2 | Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I | -R\$ 18.635 | -R\$ 17.023 | -R\$ 16.459 | -R\$ 15.054 | -R\$ 13.223 |
| 3 | Total das exposições contabilizadas no BP | R\$ 3.163.032 | R\$ 3.361.988 | R\$ 2.166.508 | R\$ 2.128.113 | R\$ 2.238.535 |
| Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos | | 3T19 | 4T19 | 1T20 | 2T20 | 3T20 |
| 4 | Valor de reposição em operações com derivativos. | R\$ 3.865 | R\$ 0 | R\$ 10.564 | R\$ 6.013 | R\$ 4.913 |
| 5 | Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos | R\$ 3.967 | R\$ 784 | R\$ 862 | R\$ 952 | R\$ 1.027 |
| 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\$ 7.833 | R\$ 784 | R\$ 11.426 | R\$ 6.965 | R\$ 5.939 |
| Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM) | | 3T19 | 4T19 | 1T20 | 2T20 | 3T20 |
| 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) | | 3T19 | 3T19 | 3T19 | 3T19 | 3T19 |
| 17 | Valor de referência das operações não contabilizadas no BP | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 |
| 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\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 |
| Capital e Exposição Total | | 3T19 | 4T19 | 1T20 | 2T20 | 3T20 |
| 20 | Nível I | R\$ 1.023.876 | R\$ 1.051.972 | R\$ 1.060.666 | R\$ 1.070.858 | R\$ 1.088.327 |
| 21 | Exposição Total | R\$ 3.170.865 | R\$ 3.362.771 | R\$ 2.177.933 | R\$ 2.135.079 | R\$ 2.244.475 |
| Razão de Alavancagem (RA) | | 3T19 | 4T19 | 1T20 | 2T20 | 3T20 |
| 22 | Razão de Alavancagem de Basileia III. | 32,29 | 31,28 | 48,70 | 50,16 | 48,49 |

* Valor (R\$ mil)