

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

(Data base: dez/2020)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		4T19	1T20	2T20	3T20	4T20
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 3.379.011	R\$ 2.182.967	R\$ 2.143.167	R\$ 2.251.759	R\$ 2.314.693
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 17.023	-R\$ 16.459	-R\$ 15.054	-R\$ 13.223	-R\$ 10.912
3	Total das exposições contabilizadas no BP	R\$ 3.361.988	R\$ 2.166.508	R\$ 2.128.113	R\$ 2.238.535	R\$ 2.303.781
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		4T19	1T20	2T20	3T20	4T20
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 0	R\$ 10.564	R\$ 6.013	R\$ 4.913	R\$ 3.160
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 784	R\$ 862	R\$ 952	R\$ 1.027	R\$ 49
6	Ajuste relativo à garantia prestada em operações com derivativos	R\$ 0				
7	Ajuste relativo à margem de garantia diária prestada	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				
9	Valor de referência ajustado em derivativos de crédito	R\$ 0				
10	Ajuste sob o valor de referência ajustado em derivativos de crédito	R\$ 0				
11	Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativos	R\$ 784	R\$ 11.426	R\$ 6.965	R\$ 5.939	R\$ 3.209
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		4T19	1T20	2T20	3T20	4T20
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 12.969
13	Ajuste relativo a recompras a liquidar e credores por empréstimo de TVM	R\$ 0				
14	Valor relativo ao risco de crédito da contraparte	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 12.969
15	Valor relativo ao risco de crédito da contraparte em operações de intermediação	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\$ 25.939
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		3T19	3T19	3T19	3T19	4T20
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	R\$ 0				
Capital e Exposição Total		4T19	1T20	2T20	3T20	4T20
20	Nível I	R\$ 1.051.972	R\$ 1.060.666	R\$ 1.070.858	R\$ 1.088.327	R\$ 938.551
21	Exposição Total	R\$ 3.362.771	R\$ 2.177.933	R\$ 2.135.079	R\$ 2.244.475	R\$ 2.332.929
Razão de Alavancagem (RA)		4T19	1T20	2T20	3T20	4T20
22	Razão de Alavancagem de Basileia III.	31,28	48,70	50,16	48,49	40,23

* Valor (R\$ mil)