

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

(Data base: set/2021)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		3T20	4T20	1T21	2T21	3T21
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 2.251.759	R\$ 2.314.693	R\$ 2.433.724	R\$ 2.709.835	R\$ 2.938.563
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 13.223	-R\$ 10.912	-R\$ 9.518	-R\$ 9.935	-R\$ 8.694
3	Total das exposições contabilizadas no BP	R\$ 2.238.535	R\$ 2.303.781	R\$ 2.424.205	R\$ 2.699.900	R\$ 2.929.868
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		3T20	4T20	1T21	2T21	3T21
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 4.913	R\$ 3.160	R\$ 50.064	R\$ 9.629	R\$ 77.559
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 1.027	R\$ 49	R\$ 16	R\$ 7	R\$ 12
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 obrigação 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\$ 5.939	R\$ 3.209	R\$ 50.080	R\$ 9.636	R\$ 77.571
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		3T20	4T20	1T21	2T21	3T21
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	R\$ 0	R\$ 12.969	R\$ 6.051	R\$ 6.098	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\$ 12.969	R\$ 6.051	R\$ 6.098	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\$ 25.939	R\$ 12.102	R\$ 12.195	R\$ 0
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		3T19	4T20	1T21	2T21	3T21
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 4.839
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 3.871
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 968
Capital e Exposição Total		3T20	4T20	1T21	2T21	3T21
20	Nível I	R\$ 1.088.327	R\$ 938.551	R\$ 951.974	R\$ 967.580	R\$ 983.908
21	Exposição Total	R\$ 2.244.475	R\$ 2.332.929	R\$ 2.486.387	R\$ 2.721.731	R\$ 3.008.407
Razão de Alavancagem (RA)		3T20	4T20	1T21	2T21	3T21
22	Razão de Alavancagem de Basileia III.	48,49	40,23	38,29	35,55	32,71

* Valor (R\$ mil)