

**Modelo Comum de divulgação de informações sobre a Razão de Alavancagem\***
**(Data base: dez/2021)**

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		4T20	1T21	2T21	3T21	4T21
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 2.314.693	R\$ 2.433.724	R\$ 2.709.835	R\$ 2.938.563	R\$ 3.319.632
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 10.912	-R\$ 9.518	-R\$ 9.935	-R\$ 8.694	-R\$ 8.134
<b>3</b>	<b>Total das exposições contabilizadas no BP</b>	<b>R\$ 2.303.781</b>	<b>R\$ 2.424.205</b>	<b>R\$ 2.699.900</b>	<b>R\$ 2.929.868</b>	<b>R\$ 3.311.498</b>
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		4T20	1T21	2T21	3T21	4T21
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 3.160	R\$ 50.064	R\$ 9.629	R\$ 77.559	R\$ 103.408
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 49	R\$ 16	R\$ 7	R\$ 12	R\$ 51
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
<b>11</b>	<b>Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativos</b>	<b>R\$ 3.209</b>	<b>R\$ 50.080</b>	<b>R\$ 9.636</b>	<b>R\$ 77.571</b>	<b>R\$ 103.458</b>
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		4T20	1T21	2T21	3T21	4T21
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	R\$ 12.969	R\$ 6.051	R\$ 6.098	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\$ 12.969	R\$ 6.051	R\$ 6.098	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
<b>16</b>	<b>Total das exposições relativas a operações compromissadas e de empréstimo de títulos e valores mobiliários</b>	<b>R\$ 25.939</b>	<b>R\$ 12.102</b>	<b>R\$ 12.195</b>	<b>R\$ 0</b>	<b>R\$ 0</b>
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		4T20	1T21	2T21	3T21	4T21
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 4.839	R\$ 5.752
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	-R\$ 3.871	-R\$ 4.602
<b>19</b>	<b>Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial</b>	<b>R\$ 0</b>	<b>R\$ 0</b>	<b>R\$ 0</b>	<b>R\$ 968</b>	<b>R\$ 1.150</b>
Capital e Exposição Total		4T20	1T21	2T21	3T21	4T21
<b>20</b>	<b>Nível I</b>	<b>R\$ 938.551</b>	<b>R\$ 951.974</b>	<b>R\$ 967.580</b>	<b>R\$ 983.908</b>	<b>R\$ 986.975</b>
<b>21</b>	<b>Exposição Total</b>	<b>R\$ 2.332.929</b>	<b>R\$ 2.486.387</b>	<b>R\$ 2.721.731</b>	<b>R\$ 3.008.407</b>	<b>R\$ 3.416.107</b>
Razão de Alavancagem (RA)		4T20	1T21	2T21	3T21	4T21
<b>22</b>	<b>Razão de Alavancagem de Basileia III.</b>	<b>40,23</b>	<b>38,29</b>	<b>35,55</b>	<b>32,71</b>	<b>28,89</b>

\* Valor (R\$ mil)