

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

(Data base: set/2022)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		3T21	4T21	1T22	2T22	3T22
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 2.938.563	R\$ 3.319.632	R\$ 3.521.366	R\$ 4.011.508	R\$ 4.289.603
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 8.694	-R\$ 8.134	-R\$ 5.008	-R\$ 3.635	-R\$ 1.230
<b>3</b>	<b>Total das exposições contabilizadas no BP</b>	<b>R\$ 2.929.868</b>	<b>R\$ 3.311.498</b>	<b>R\$ 3.516.358</b>	<b>R\$ 4.007.874</b>	<b>R\$ 4.288.373</b>
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		3T21	4T21	1T22	2T22	3T22
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 77.559	R\$ 103.408	R\$ 119	R\$ 84.398	R\$ 80.812
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 12	R\$ 51	R\$ 66	R\$ 46	R\$ 59
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\$ 77.571</b>	<b>R\$ 103.458</b>	<b>R\$ 185</b>	<b>R\$ 84.445</b>	<b>R\$ 80.871</b>
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		3T21	4T21	1T22	2T22	3T22
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
<b>16</b>	<b>Total das exposições relativas a operações compromissadas e de empréstimo de títulos e valores mobiliários</b>	<b>R\$ 0</b>	<b>R\$ 0</b>	<b>R\$ 0</b>	<b>R\$ 0</b>	<b>R\$ 0</b>
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		3T21	4T21	1T22	2T22	3T22
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	R\$ 4.839	R\$ 5.752	R\$ 5.091	R\$ 8.761	R\$ 13.149
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	-R\$ 3.871	-R\$ 4.602	-R\$ 4.073	R\$ 0	R\$ 0
<b>19</b>	<b>Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial</b>	<b>R\$ 968</b>	<b>R\$ 1.150</b>	<b>R\$ 1.018</b>	<b>R\$ 8.761</b>	<b>R\$ 13.149</b>
Capital e Exposição Total		3T21	4T21	1T22	2T22	3T22
<b>20</b>	<b>Nível I</b>	<b>R\$ 983.908</b>	<b>R\$ 986.975</b>	<b>R\$ 994.975</b>	<b>R\$ 1.016.370</b>	<b>R\$ 1.041.395</b>
<b>21</b>	<b>Exposição Total</b>	<b>R\$ 3.008.407</b>	<b>R\$ 3.416.107</b>	<b>R\$ 3.517.562</b>	<b>R\$ 4.101.079</b>	<b>R\$ 4.382.393</b>
Razão de Alavancagem (RA)		3T21	4T21	1T22	2T22	3T22
<b>22</b>	<b>Razão de Alavancagem de Basileia III.</b>	<b>32,71</b>	<b>28,89</b>	<b>28,29</b>	<b>24,78</b>	<b>23,76</b>

\* Valor (R\$ mil)