

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

(Data base: dez/2022)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		4T21	1T22	2T22	3T22	4T22
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 3.319.632	R\$ 3.521.366	R\$ 4.011.508	R\$ 4.289.603	R\$ 4.626.391
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 8.134	-R\$ 5.008	-R\$ 3.635	-R\$ 1.230	R\$ 0
3	Total das exposições contabilizadas no BP	R\$ 3.311.498	R\$ 3.516.358	R\$ 4.007.874	R\$ 4.288.373	R\$ 4.626.391
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		4T21	1T22	2T22	3T22	4T22
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 103.408	R\$ 119	R\$ 84.398	R\$ 80.812	R\$ 61.831
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 51	R\$ 66	R\$ 46	R\$ 59	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
11	Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativos	R\$ 103.458	R\$ 185	R\$ 84.445	R\$ 80.871	R\$ 61.890
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		4T21	1T22	2T22	3T22	4T22
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)		4T21	1T22	2T22	3T22	4T22
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	R\$ 5.752	R\$ 5.091	R\$ 8.761	R\$ 13.149	R\$ 73.003
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	-R\$ 4.602	-R\$ 4.073	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	R\$ 1.150	R\$ 1.018	R\$ 8.761	R\$ 13.149	R\$ 73.003
Capital e Exposição Total		4T21	1T22	2T22	3T22	4T22
20	Nível I	R\$ 986.975	R\$ 994.975	R\$ 1.016.370	R\$ 1.041.395	R\$ 1.058.174
21	Exposição Total	R\$ 3.416.107	R\$ 3.517.562	R\$ 4.101.079	R\$ 4.382.393	R\$ 4.761.284
Razão de Alavancagem (RA)		4T21	1T22	2T22	3T22	4T22
22	Razão de Alavancagem de Basileia III.	28,89	28,29	24,78	23,76	22,22

* Valor (R\$ mil)