

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

(Data base: jun/2023)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 4.011.508	R\$ 4.289.603	R\$ 4.626.391	R\$ 4.706.287	R\$ 4.923.688
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 3.635	-R\$ 1.230	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
<b>3</b>	<b>Total das exposições contabilizadas no BP</b>	<b>R\$ 4.007.874</b>	<b>R\$ 4.288.373</b>	<b>R\$ 4.626.391</b>	<b>R\$ 4.706.287</b>	<b>R\$ 4.923.688</b>
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 84.398	R\$ 80.812	R\$ 61.831	R\$ 15.544	R\$ 0
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 46	R\$ 59	R\$ 59	R\$ 66	R\$ 51
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				
<b>11</b>	<b>Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativos</b>	<b>R\$ 84.445</b>	<b>R\$ 80.871</b>	<b>R\$ 61.890</b>	<b>R\$ 15.610</b>	<b>R\$ 51</b>
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	R\$ 0				
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				
15	Valor relativo ao risco de crédito da contraparte em operações de intermediação	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>				
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	R\$ 8.761	R\$ 13.149	R\$ 73.003	R\$ 93.467	R\$ 113.207
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	R\$ 0				
<b>19</b>	<b>Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial</b>	<b>R\$ 8.761</b>	<b>R\$ 13.149</b>	<b>R\$ 73.003</b>	<b>R\$ 93.467</b>	<b>R\$ 113.207</b>
Capital e Exposição Total		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
<b>20</b>	<b>Nível I</b>	<b>R\$ 1.016.370</b>	<b>R\$ 1.041.395</b>	<b>R\$ 1.058.174</b>	<b>R\$ 1.083.394</b>	<b>R\$ 1.104.010</b>
<b>21</b>	<b>Exposição Total</b>	<b>R\$ 4.101.079</b>	<b>R\$ 4.382.393</b>	<b>R\$ 4.761.284</b>	<b>R\$ 4.815.364</b>	<b>R\$ 5.036.946</b>
Razão de Alavancagem (RA)		2T22	3T22	4T22	1T23	2T23
<b>22</b>	<b>Razão de Alavancagem de Basileia III.</b>	<b>24,78</b>	<b>23,76</b>	<b>22,22</b>	<b>22,50</b>	<b>21,92</b>

\* Valor (R\$ mil)