

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

(Data base: jun/2024)

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		2T23	3T23	4T23	1T24	2T24
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 4.923.688	R\$ 5.109.799	R\$ 5.311.195	R\$ 5.287.950	R\$ 5.470.826
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	R\$ 0				
3	Total das exposições contabilizadas no BP	R\$ 4.923.688	R\$ 5.109.799	R\$ 5.311.195	R\$ 5.287.950	R\$ 5.470.826
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		2T23	3T23	4T23	1T24	2T24
4	Valor de reposição em operações com derivativos.	R\$ 0	R\$ 19.844	R\$ 0	R\$ 15.279	R\$ 214.399
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ 51	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0	R\$ 0
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				
11	Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativos	R\$ 51	R\$ 19.844	R\$ 0	R\$ 15.279	R\$ 214.399
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		2T23	3T23	4T23	1T24	2T24
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				
16	Total das exposições relativas a operações compromissadas e de empréstimo de títulos e valores mobiliários	R\$ 0				
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		2T23	3T23	4T23	1T24	2T24
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	R\$ 113.207	R\$ 101.223	R\$ 113.239	R\$ 139.968	R\$ 156.022
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	R\$ 0				
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	R\$ 113.207	R\$ 101.223	R\$ 113.239	R\$ 139.968	R\$ 156.022
Capital e Exposição Total		2T23	3T23	4T23	1T24	2T24
20	Nível I	R\$ 1.104.010	R\$ 1.136.988	R\$ 1.159.326	R\$ 1.181.181	R\$ 1.212.798
21	Exposição Total	R\$ 5.036.946	R\$ 5.230.866	R\$ 5.424.433	R\$ 5.443.197	R\$ 5.841.247
Razão de Alavancagem (RA)		2T23	3T23	4T23	1T24	2T24
22	Razão de Alavancagem de Basileia III.	21,92	21,74	21,37	21,70	20,76