

Relatório da Razão de Alavancagem, conforme disposto na Circular nº 3.748 de 27 de Fevereiro de 2015 do Banco Central do Brasil.

| Número da Linha | Item | mar/20 | jun/20 | set/20 | dez/20 |
|--|---|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | | Valor (R\$ mil) | Valor (R\$ mil) | Valor (R\$ mil) | Valor (R\$ mil) |
| Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP) | | | | | |
| 1 | Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas | 3.203.797 | 3.309.268 | 3.520.808 | 4.188.821 |
| 2 | Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I | - 68.102 | - 36.793 | - 86.464 | - 100.900 |
| 3 | Total das exposições contabilizadas no BP | 3.135.695 | 3.272.475 | 3.434.344 | 4.087.920 |
| Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos | | | | | |
| 4 | Valor de reposição em operações com derivativos. | - | - | - | - |
| 5 | Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos | - | - | - | - |
| 6 | Ajuste relativo à garantia prestada em operações com derivativos | - | - | - | - |
| 7 | Ajuste relativo à margem de garantia diária prestada | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - |
| 9 | Valor de referência ajustado em derivativos de crédito | - | - | - | - |
| 10 | Ajuste sob o valor de referência ajustado em derivativos de crédito | - | - | - | - |
| 11 | Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativos | - | - | - | - |
| Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores | | | | | |
| 12 | Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM | 965.305 | 1.144.878 | 1.261.646 | 727.609 |
| 13 | Ajuste relativo a recompras a liquidar e credores por empréstimo de TVM | - | - | - | - |
| 14 | Valor relativo ao risco de crédito da contraparte | - | - | - | - |
| 15 | Valor relativo ao risco de crédito da contraparte em operações de intermediação | - | - | - | - |
| 16 | Total das exposições relativas a operações compromissadas e de empréstimo de títulos e valores mobiliários (soma das linhas 12 a 15) | 965.305 | 1.144.878 | 1.261.646 | 727.609 |
| Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP) | | | | | |
| 17 | Valor de referência das operações não contabilizadas no BP | 733.932 | 684.797 | 781.074 | 892.935 |
| 18 | Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP | - 1.049 | - 932 | - 3.970 | - 3.392 |
| 19 | Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial | 732.882 | 683.865 | 777.104 | 889.543 |
| Capital e Exposição Total | | | | | |
| 20 | Nível I | 320.628 | 350.502 | 327.176 | 312.043 |
| 21 | Exposição Total | 4.833.883 | 5.101.218 | 5.473.094 | 5.705.130 |
| Razão de Alavancagem (RA) | | | | | |
| 22 | Razão de Alavancagem de Basileia III | 6,63% | 6,87% | 5,98% | 5,47% |