

RESUMO COMPARATIVO ENTRE DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS PUBLICADAS E RAZÃO DE ALAVANCAGEM - DEZEMBRO/2021

Número da Linha	Item	Valor (R\$ mil)
1	Ativo total de acordo com as demonstrações financeiras publicadas	1.216.910
2	Ajuste decorrente de diferenças de consolidação contábil	-
3	Ajuste relativo aos ativos cedidos ou transferidos com transferência substancial dos riscos e benefícios e reconhecidos contabilmente	-
4	Ajuste relativo aos valores de referência ajustados e aos ganhos potenciais futuros em operações com instrumentos financeiros derivativos	9.753
5	Ajuste relativo a operações compromissadas e de empréstimo de títulos e valores mobiliários	-
6	Ajuste relativo a operações não contabilizadas no ativo total do conglomerado prudencial	366.847
7	Outros ajustes	-
8	Exposição Total	1.593.510

INFORMAÇÕES SOBRE A RAZÃO DE ALAVANCAGEM - DEZEMBRO/2021

Número da Linha	Item	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	1.029.754
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	210
3	Total Das Exposições Contabilizadas no BP	1.029.544
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos		
4	Valor de reposição em operações com derivativos	460.577
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	9.753
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	(49.276)
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	421.054
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	142.912
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)	142.912
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	-
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	-
19	Total Das Exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	-
Capital e Exposição Total		
20	Nível I	121.513
21	Exposição Total	1.593.510
Razão de Alavancagem (RA)		
22	Razão de Alavancagem de Basileia III	7,63%