

Circular 3.748/2015 - Banco Central do Brasil - Anexo 2

Em milhares de Reais

Modelo Comum de divulgação de informações sobre a Razão de Alavancagem		set/19	dez/19
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	5.643.947	5.546.224
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	- 17.974	- 16.049
3	Total das exposições contabilizadas no BP	5.625.973	5.530.175
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 decorrência 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 Mobiliários (TVM)			
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	504.935	589.203
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)	504.935	589.203
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)			
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	3.837	3.842
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	-	-
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	3.837	3.842
Capital e Exposição Total			
20	Nível I	5.555.763	5.749.655
21	Exposição Total	6.134.745	6.123.220
Razão de Alavancagem (RA)			
22	Razão de Alavancagem de Basileia III	90,56%	93,90%