

Artigo 4º

| Contas | +/- | Descrição | R\$ |
|------------|----------|---|------------------------|
| 110.01 | + | Patrimônio Líquido | 792.082.013,36 |
| 110.02 | + | Contas de Resultado Credoras | 2.966.305.743,63 |
| 110.03 | + | Depósito em Conta Vinculada Para Suprir Deficiência De Capital | - |
| 110.04 | + | Instrumentos Híbridos de Capital E Dívida Habilitados A Integrar O Nível I Do PR | - |
| 110.05 | - | Contas de Resultado Devedoras | 3.037.165.599,76 |
| 110.06 | - | Reservas de Reavaliação | 254.746,98 |
| 110.07 | + | Reservas para Contingências | - |
| 110.08 | + | Reservas Especiais de Lucros Relativas a Dividendos Obrigatórios não Distribuídos | - |
| 110.11 | + | Ações Preferenciais Emitidas com Cláusula de Resgate e Ações Preferenciais com Cumulatividade de Dividendos - Não Elegíveis a Capital Nível II | - |
| 110.12 | + | Créditos Tributários Excluídos do Nível I do PR | - |
| 110.13 | - | Ativo Permanente Diferido | 2.014.821,64 |
| 110.14 | - | Ajuste ao Valor de Mercado - TVM e Instrumentos Financeiros Derivativos | (51.468.017,99) |
| 110.15 | - | Excesso de Crédito Tributário em Relação ao PR - Nível I | - |
| 110.16 | + | Adicional de Provisão ao Mínimo Estabelecido pela 2.682/99 | - |
| 110 | = | Patrimônio de Referência Nível I - PR I | 770.420.606,60 |
| 110.06 | + | Reservas de Reavaliação | 254.746,98 |
| 110.07 | + | Reservas para Contingências | - |
| 110.08 | + | Reservas Especiais de Lucros Relativas a Dividendos Obrigatórios não Distribuídos | - |
| 120.01 | + | Instrumentos Híbridos de Capital e Dívida Habilitados a Integrar o Nível II do PR | - |
| 120.02 | + | Instrumentos de Dívida Subordinada | - |
| 110.14 | + | Ajuste ao Valor de Mercado - TVM e Instrumentos Financeiros Derivativos | (51.468.017,99) |
| 120.03 | - | Excesso de Ações Preferenciais Emitidas com Cláusula de Resgate com Prazo Original de Vencimento Inferior a 10 Anos e Instrumentos de Dívida Subordinada. | - |
| 120.04 | - | Excesso de Reserva de Reavaliação em Relação ao Nível II do PR | - |
| 120.05 | - | Excesso de Capital de Nível II em Relação ao Nível I | - |
| 120 | = | Patrimônio de Referência Nível II - PR II | (51.213.271,01) |

| | | | |
|------------|----------|---|-----------------------|
| 130.01 | + | Ações Emitidas por Instituições Financeiras e Demais Instituições Autorizadas a Funcionar pelo Banco Central do Brasil | - |
| 130.02 | + | Ativos Classificados como Instrumentos Híbridos de Capital e Dívida | - |
| 130.03 | + | Ativos Classificados como Instrumentos de Dívida Subordinada | - |
| 130.04 | + | Cotas de Fundos de Investimento | - |
| 130.05 | + | Dependência ou Participação em Instituição Financeira no Exterior cujo Banco Central do Brasil não tenha Acesso Suficiente para fins da Supervisão Global Consolidada | - |
| 130.06 | + | Capital Destacado Para Operação Com O Setor Público | - |
| 130 | = | Deduções Do Patrimônio de Referência | - |
| 110 | + | Patrimônio de Referência Nível I - PR I | 770.420.606,60 |
| 120 | + | Patrimônio de Referência Nível II - PR II | (51.213.271,01) |
| 130 | - | Deduções Do Patrimônio de Referência | - |
| 100 | = | Patrimônio de Referência - PR | 719.207.335,59 |

Artigo 5º

| Contas | Descrição | Valor da Exposição | Valor da EPR - PRE |
|--------|--|-------------------------|-------------------------|
| 510.01 | Valores Mantidos em Espécie | 13.628,01 | - |
| 521.01 | Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais | 1.834.275.968,77 | - |
| 522.01 | Operações Compromissadas - Venda com compromisso de Recompra - Títulos Públicos Federais | 64.502.408,08 | - |
| 530.01 | Títulos Públicos Federais | 700.872.116,91 | - |
| 540.01 | Créditos Vinculados - Banco Central | 1.875.343,54 | - |
| | Total - Ponderação 0% | 2.601.539.465,31 | - |
| 510.03 | Depósitos Bancários | 7.672.861,14 | 1.534.572,23 |
| | Total - Ponderação 20% | 7.672.861,14 | 1.534.572,23 |
| | Total - Ponderação 50% | - | - |
| 550.10 | Operações de Varejo | 2.671.073.552,66 | 2.003.305.164,50 |
| 600.03 | Compromisso de Crédito com Característica de Varejo | - | - |
| 620.06 | Coobrigações em Cessões de Créditos | 64.957.265,24 | 48.717.948,93 |
| | Total - Ponderação 75% | 2.736.030.817,90 | 2.052.023.113,43 |
| 510.01 | Valores Mantidos em Espécie | - | - |
| 526.01 | Depósitos Interfinanceiros | 796.119,25 | 796.119,25 |
| 527.01 | Aplicações em Moedas Estrangeiras | 406.715,60 | 406.715,60 |
| 530.09 | Cotas de Fundo de Investimento | 189.148,00 | 189.148,00 |
| 540.05 | Outros | 6.595.092,82 | 6.595.092,82 |
| 550.11 | Demais Operações de Crédito | 54.038.111,86 | 54.038.111,86 |
| 560.02 | Arrendamento Financeiro | 411.776.847,80 | 411.776.847,80 |
| 570.03 | Outros Adiantamentos | 2.880.789,53 | 2.880.789,53 |
| 570.04 | Demais Direitos | 211.006.561,41 | 211.006.561,41 |
| 580 | Outros Valores e Bens | 93.084.418,50 | 93.084.418,50 |

| | | | |
|---------------|--|--------------------------|-------------------------|
| 590.01 | INVESTIMENTOS - EXCETO ÁGIOS PAGOS | 69.218,27 | 69.218,27 |
| 590.02 | Imobilizado de Uso | 19.041.958,92 | 19.041.958,92 |
| 590.04 | ATIVO PERMANENTE DIFERIDO - EXCETO ÁGIOS PAGOS | 16.343.987,16 | 16.343.987,16 |
| 590.06 | ATIVOS INTANGÍVEIS - EXCETO ÁGIOS PAGOS | 3.736.412,86 | 3.736.412,86 |
| 590.07 | ÁGIOS EM INVESTIMENTOS | 272.955.964,20 | 272.955.964,20 |
| 610.02 | Adiantamentos sobre Contratos de Câmbio (ACC/ACE) | 34.281.597,41 | 34.281.597,41 |
| 620.02 | Prestadas a Instituições Financeiras e Instituições Autorizadas a Funcionar p/ BCB | 9.115.007,00 | 9.115.007,00 |
| 620.04 | Prestadas a Outras Pessoas Físicas ou Jurídicas | 437.127.746,23 | 437.127.746,23 |
| | Total - Ponderação 100% | 1.573.445.696,82 | 1.573.445.696,82 |
| 550.11 | Demais Operações de Crédito | - | - |
| | Total - Ponderação 150% | - | - |
| 550.11 | Demais Operações de Crédito | 35.136.329,49 | 105.408.988,47 |
| 630 | CRÉDITOS TRIBUTÁRIOS | 92.360.890,76 | 106.304.939,60 |
| | Total - Ponderação 300% | 127.497.220,25 | 211.713.928,07 |
| 530.07 | Derivativos - Valor de Reposição | 272.076.000,43 | 272.076.000,43 |
| 530.08 | Derivativos - Ganho Potencial Futuro | 3.637.948.209,70 | 107.774.571,20 |
| 650.01 | Operações a Liquidar de Compra de Moeda Estrangeira no Mercado a Vista | 149.394.690,61 | 4.039.869,16 |
| 670.02 | Excesso de Crédito Tributário em Relação ao PR - Nível I a ser Deduzido do PEPR | - | - |
| 670.03 | Ativo Permanente Diferido Deduzido do PR a ser Deduzido do PEPR | 2.014.821,64 | (2.014.821,64) |
| 670 | ATIVOS DEDUZIDOS DO PR A SEREM DEDUZIDOS DO PEPR | 2.014.821,64 | (2.014.821,64) |
| 700 | Valor da EPR | 11.107.619.783,80 | 4.220.592.929,70 |
| 705 | Valor da Parcela PEPR antes do Adicional de Fator F | | 464.265.222,27 |
| 710 | Valor Correspondente ao Adicional de Fator F Determinado pelo Banco Central do Brasil | | - |
| 720 | PEPR | | 464.265.222,27 |
| 800 | PCAM | | 27.384.600,00 |
| 810 | PJUR1 | | 6.814.500,00 |
| 820 | PJUR2 | | 62.973.000,00 |
| 830 | PJUR3 | | 497.000,00 |
| 840 | PJUR4 | | - |
| 850 | PCOM | | 343.000,00 |

| | | | |
|--------|--|--------------------|--------------------|
| 860 | PACS | | 380.000,00 |
| 870 | POPR | | 42.250.386,95 |
| 880 | Adicional BCB | | - |
| 900 | PRE | | 604.907.709,22 |
| 100 | Patrimônio de Referência - PR | | 719.207.335,59 |
| IB | Índice de Basileia | | 13,08% |
| 890 | RBAN - Montante do PR apurado para cobertura do risco da taxa de juros das operações não classificadas na carteira de negociação | | 8.108.271,73 |
| IB | Índice de Basileia Amplo (com RBAN) - Inclui Riscos não Abrangidos Pelas Parcelas do PR | | 12,91 % |
| Contas | Descrição | Valor da Exposição | Valor da EPR - PRE |
| 510.01 | Valores Mantidos em Espécie | 13.628,01 | - |
| 521.01 | Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais | 1.834.275.968,77 | - |

Artigo 6º

| Descrição | R\$ |
|--|-------------------|
| Valor total das exposições a risco de crédito conforme Circular nº 3.360/07 | 11.105.604.962,16 |
| Média das exposições a risco de crédito no trimestre | 11.246.872.234,68 |
| Montante de provisões para perdas relativas às exposições a risco de crédito | 273.777.524,61 |
| Operações baixadas para prejuízo no trimestre | 72.628,00 |

Artigo 7º

| Descrição | R\$ |
|---|------------------|
| Valor Total Mitigado para Operações Compromissadas com Lastro em Títulos Públicos | 1.898.778.376,85 |

Artigo 8º

| Descrição | R\$ |
|--|-------------------|
| Valores relativos a contratos a serem liquidados em sistemas de liquidação de câmaras de compensação e de liquidação, nos quais a câmara atue como contraparte central | 15.798.320.258,91 |
| Valores relativos a contratos sem garantia, nos quais não haja a atuação de câmaras de compensação como contraparte central | 6.471.271.240,13 |

| | |
|---|-------------------|
| Valor positivo bruto dos contratos sujeitos ao risco de crédito de contraparte, incluindo derivativos, operações a liquidar, empréstimos de ativos, operações compromissadas, desconsiderados os valores positivos relativos a acordos de compensação | 22.362.675.917,54 |
|---|-------------------|

Referência

3.0.6.10.40.8 Dados do Balancete 4040 – Futuros BM&F