

**Artigo 4º**

<b>Contas</b>	<b>+/-</b>	<b>Descrição</b>	<b>R\$</b>
110.01	+	Patrimônio Líquido	690.823.728,76
110.02	+	Contas de Resultado Credoras	-
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	-
110.06	-	Reservas de Reavaliação	249.921,90
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	1.833.103,50
110.14	-	Ajuste ao Valor de Mercado - TVM e Instrumentos Financeiros Derivativos	(52.517.270,02)
110.15	-	Excesso de Crédito Tributário em Relação ao PR - Nível I	-
110.16	+	Adicional de Provisão ao Mínimo Estabelecido pela 2.682/99	-
<b>110</b>	<b>=</b>	<b>Patrimônio de Referência Nível I - PR I</b>	<b>741.257.973,38</b>
110.06	+	Reservas de Reavaliação	249.921,90
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	(52.517.270,02)
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	-
<b>120</b>	<b>=</b>	<b>Patrimônio de Referência Nível II - PR II</b>	<b>(52.267.348,12)</b>
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	-
<b>130</b>	<b>=</b>	<b>Deduções Do Patrimônio de Referência</b>	<b>-</b>
110	+	Patrimônio de Referência Nível I - PR I	741.257.973,38
120	+	Patrimônio de Referência Nível II - PR II	(52.267.348,12)
130	-	Deduções Do Patrimônio de Referência	-
<b>100</b>	<b>=</b>	<b>Patrimônio de Referência - PR</b>	<b>688.990.625,26</b>

### Artigo 5º

Contas	Descrição	Valor da Exposição	Valor da EPR - PRE
510.01	Valores Mantidos em Espécie	129.647,93	-
510.02	Banco Central - Reserva Livre em Espécie	2.976.854,33	-
521.01	Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais	1.669.045.476,77	-
522.01	Operações Compromissadas - Venda com compromisso de Recompra - Títulos Públicos Federais	1.002.477,82	-
530.01	Títulos Públicos Federais	885.288.177,62	-
540.01	Créditos Vinculados - Banco Central	1.866.740,75	-
	<b>Total - Ponderação 0%</b>	<b>2.560.309.375,22</b>	<b>-</b>
510.03	Depósitos Bancários	9.286.133,64	1.857.226,73
	<b>Total - Ponderação 20%</b>	<b>9.286.133,64</b>	<b>1.857.226,73</b>
	<b>Total - Ponderação 35%</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
	<b>Total - Ponderação 50%</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

550.10	Operações de Varejo	2.420.880.698,67	1.815.660.524,00
600.03	Compromisso de Crédito com Característica de Varejo	-	-
620.06	Coobrigações em Cessões de Créditos	52.662.567,66	39.496.925,75
	<b>Total - Ponderação 75%</b>	<b>2.473.543.266,33</b>	<b>1.855.157.449,75</b>
510.01	Valores Mantidos em Espécie	-	-
526.01	Depósitos Interfinanceiros	504.902,38	504.902,38
527.01	Aplicações em Moedas Estrangeiras	409.202,61	409.202,61
530.09	Cotas de Fundo de Investimento	-	-
540.05	Outros	5.433.074,18	5.433.074,18
550.11	Demais Operações de Crédito	61.749.121,26	61.749.121,26
560.02	Arrendamento Financeiro	473.219.515,24	357.194.191,77
570.03	Outros Adiantamentos	1.281.264,49	1.281.264,49
570.04	Demais Direitos	220.924.314,96	68.734.909,44
580	Outros Valores e Bens	81.270.889,33	81.270.889,33
590.01	INVESTIMENTOS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	47.984.540,97	47.984.540,97
590.02	Imobilizado de Uso	15.797.121,11	15.797.121,11
590.04	ATIVO PERMANENTE DIFERIDO - EXCETO ÁGIOS PAGOS	8.565.590,78	8.565.590,78
590.06	ATIVOS INTANGÍVEIS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	3.430.074,22	3.430.074,22
590.07	ÁGIOS EM INVESTIMENTOS	-	-
610.02	Adiantamentos sobre Contratos de Câmbio (ACC/ ACE)	32.041.315,18	32.041.315,18
620.02	Prestadas a Instituições Financeiras e Instituições Autorizadas a Funcionar p/ BCB	-	-
620.04	Prestadas a Outras Pessoas Físicas ou Jurídicas	497.830.792,75	497.830.792,75
630	CRÉDITOS TRIBUTÁRIOS	35.386.335,22	35.386.335,22
	<b>Total - Ponderação 100%</b>	<b>1.485.828.054,68</b>	<b>1.217.613.325,69</b>
550.11	Demais Operações de Crédito	-	-
	<b>Total - Ponderação 150%</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
550.11	Demais Operações de Crédito	33.256.607,81	99.769.823,43
	<b>Total - Ponderação 300%</b>	<b>33.256.607,81</b>	<b>99.769.823,43</b>
530.07	Derivativos - Valor de Reposição	233.372.617,28	233.372.617,28
530.08	Derivativos - Ganho Potencial Futuro	3.877.643.393,67	128.397.925,96
650.01	Operações a Liquidar de Compra de Moeda Estrangeira no Mercado a Vista	51.437.275,05	2.217.267,88

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	1.833.103,50	(1.833.103,50)
<b>670</b>	<b>ATIVOS DEDUZIDOS DO PR A SEREM DEDUZIDOS DO PEPR</b>	<b>1.833.103,50</b>	<b>(1.833.103,50)</b>
<b>700</b>	<b>Valor da EPR</b>	<b>10.726.509.827,18</b>	<b>3.536.552.533,21</b>
<b>705</b>	<b>Valor da Parcela PEPR antes do Adicional de Fator F</b>	-	<b>389.020.778,65</b>
<b>710</b>	<b>Valor Correspondente ao Adicional de Fator F Determinado pelo Banco Central do Brasil</b>	-	-
<b>720</b>	<b>PEPR</b>	-	<b>389.020.778,65</b>
<b>800</b>	<b>PCAM</b>	-	<b>115.769.000,00</b>
<b>810</b>	<b>PJUR1</b>	-	<b>8.977.000,00</b>
<b>820</b>	<b>PJUR2</b>	-	<b>70.566.000,00</b>
<b>830</b>	<b>PJUR3</b>	-	<b>523.000,00</b>
<b>840</b>	<b>PJUR4</b>	-	-
<b>850</b>	<b>PCOM</b>	-	<b>307.000,00</b>
<b>860</b>	<b>PACS</b>	-	<b>56.000,00</b>
<b>870</b>	<b>POPR</b>	-	<b>39.610.508,59</b>
<b>880</b>	<b>Adicional BCB</b>	-	-
<b>900</b>	<b>PRE</b>	-	<b>624.829.287,24</b>
<b>100</b>	<b>Patrimônio de Referência - PR</b>	-	<b>688.990.625,26</b>
<b>IB</b>	<b>Índice de Basileia</b>	-	<b>12,13%</b>
<b>890</b>	<b>RBAN - Montante do PR apurado para cobertura do risco da taxa de juros das operações não classificadas na carteira de negociação</b>	-	<b>8.722.217,26</b>
<b>IB</b>	<b>Índice de Basileia Amplo (com RBAN) - Inclui Riscos não Abrangidos Pelas Parcelas do PR</b>	-	<b>11,96%</b>

### Artigo 6º

Descrição	R\$
Valor total das exposições a risco de crédito conforme Circular nº 3.360/07	10.674.998.957,22
Média das exposições a risco de crédito no trimestre	10.824.400.579,96
Montante de provisões para perdas relativas às exposições a risco de crédito	279.789.750,41
Operações baixadas para prejuízo no trimestre	59.916.000,00

**Artigo 7º**

Descrição	R\$
Valor Total Mitigado para Operações Compromissadas com Lastro em Títulos Públicos	1.670.047.954,59

**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	10.241.641.031,87
Valores relativos a contratos sem garantia, nos quais não haja a atuação de câmaras de compensação como contraparte central	6.182.688.701,67
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	16.505.600.622,87

**Referência**

3.0.6.10.40.8

Dados do Balancete 4040 - Futuros BM&amp;F