

Artigo 4º

Contas	+/-	Descrição	R\$
110.01	+	Patrimônio Líquido	1.108.511.382,32
110.02	+	Contas de Resultado Credoras	5.588.057.738,53
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	6.005.745.378,05
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	-
110	=	Patrimônio de Referência Nível I - PR I	741.257.987,42
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	-

120	=	Patrimônio de Referência Nível II - PR II	(52.267.348,12)
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	741.257.987,42
120	+	Patrimônio de Referência Nível II - PR II	(52.267.348,12)
130	-	Deduções Do Patrimônio de Referência	-
100	=	Patrimônio de Referência - PR	688.990.639,30

Artigo 5º

Contas	Descrição	Valor da Exposição	Valor da EPR - PRE
510.01	Valores Mantidos em Espécie	12.849,77	-
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	-
	Total - Ponderação 0%	2.557.215.722,73	-
510.03	Depósitos Bancários	1.683.090,25	336.618,05
	Total - Ponderação 20%	1.683.090,25	336.618,05
		-	-
	Total - Ponderação 50%	-	-
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	52.419.028,01	39.314.271,01
	Total - Ponderação 75%	2.473.299.726,68	1.854.974.795,01
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	67.900,49	67.900,49
590.02	Imobilizado de Uso	18.219.541,22	18.219.541,22
590.04	ATIVO PERMANENTE DIFERIDO - EXCETO ÁGIOS PAGOS	16.544.245,22	16.544.245,22
590.06	ATIVOS INTANGÍVEIS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	3.447.943,98	3.447.943,98
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	496.590.957,99	496.590.957,99
630	CRÉDITOS TRIBUTÁRIOS	35.386.335,22	35.386.335,22
	Total - Ponderação 100%	1.447.090.523,75	1.178.875.794,76
550.11	Demais Operações de Crédito	-	-
	Total - Ponderação 150%	-	-
550.11	Demais Operações de Crédito	33.256.607,81	99.769.823,43
	Total - Ponderação 300%	33.256.607,81	99.769.823,43
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)
670	ATIVOS DEDUZIDOS DO PR A SEREM DEDUZIDOS DO PEPR	1.833.103,50	(1.833.103,50)
700	Valor da EPR	10.676.832.060,72	3.496.111.738,86
705	Valor da Parcela PEPR antes do Adicional de Fator F	-	384.572.291,27
710	Valor Correspondente ao Adicional de Fator F Determinado pelo Banco Central do Brasil	-	-
720	PEPR	-	384.572.291,27
800	PCAM	-	115.769.000,00
810	PJUR1	-	8.977.000,00
820	PJUR2	-	70.566.000,00
830	PJUR3	-	523.000,00
840	PJUR4	-	-
850	PCOM	-	307.000,00
860	PACS	-	56.000,00
870	POPR	-	42.250.386,95
880	Adicional BCB	-	-
900	PRE	-	623.020.678,23
100	Patrimônio de Referência - PR	-	688.990.639,30
IB	Índice de Basiléia	-	12,16%
890	RBAN - Montante do PR apurado para cobertura do risco da taxa de juros das operações não classificadas na carteira de negociação	-	8.722.217,26
IB	Índice de Basiléia Amplo (com RBAN) - Inclui Riscos não Abrangidos Pelas Parcelas do PR	-	12,00%

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&F