

Detalhamento do patrimônio de referência (PR) :

| Contas     | +/- | Descrição   | R\$                 |
|------------|-----|---|---------------------|
| 110.01     | +   | Patrimônio Líquido  | 1.025.838.527       |
| 110.02     | +   | Contas de Resultado Credoras  | 6.300.722.125       |
| 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   | 6.376.277.426       |
| 110.06     | -   | Reservas de Reavaliação   | 239.200             |
| 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   | 1.519.611           |
| 110.14     | -   | Ajuste ao Valor de Mercado - TVM e Instrumentos Financeiros Derivativos   | (18.038.021)        |
| 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>= Patrimônio de Referência Nível I - PR I</b>  | <b>966.562.436</b>  |
| 110.06     | +   | Reservas de Reavaliação   | 239.200             |
| 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   | (18.038.021)        |
| 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>= Patrimônio de Referência Nível II - PR II</b>  | <b>(17.798.822)</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>= Deduções Do Patrimônio de Referência</b>   | <b>-</b>            |
| 110        | +   | Patrimônio de Referência Nível I - PR I   | 966.562.436         |
| 120        | +   | Patrimônio de Referência Nível II - PR II   | (17.798.822)        |
| 130        | -   | Deduções Do Patrimônio de Referência  | -                   |
| <b>100</b> |     | <b>= Patrimônio de Referência - PR</b>  | <b>948.763.614</b>  |

**Detalhamento do Patrimônio de Referência Exigido (PRE) :**

| Contas | Descrição   | Valor da Exposição   | Valor da EPR - PRE   |
|--------|---|----------------------|----------------------|
| 510.01 | Valores Mantidos em Espécie   | 12.765               | -                    |
| 521.01 | Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais  | 2.105.121.983        | -                    |
| 522.01 | Operações Compromissadas - Venda com compromisso de Recompra - Títulos Públicos Federais  | 7.008.285            | -                    |
| 523.01 | Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda, conjugado com Venda com compromisso de Recompra (Broqueragem) - Títulos Públicos Federais | -                    | -                    |
| 523.02 | Operações Compromissadas- Posição Vendida - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais   | 169.502.690          | -                    |
| 530.01 | Títulos Públicos Federais   | 1.103.309.327        | -                    |
| 540.01 | Créditos Vinculados - Banco Central   | 1.850.068            | -                    |
|        | <b>Total - Ponderação 0%</b>  | <b>3.386.805.118</b> | <b>-</b>             |
| 510.03 | Depósitos Bancários   | 3.356.452            | 671.290              |
|        | <b>Total - Ponderação 20%</b>   | <b>3.356.452</b>     | <b>671.290</b>       |
|        | <b>Total - Ponderação 50%</b>   | <b>-</b>             | <b>-</b>             |
| 550.10 | Operações de Varejo   | 1.991.979.056        | 1.493.984.292        |
| 600.03 | Compromisso de Crédito com Característica de Varejo   | 215.400              | 161.550              |
| 620.06 | Coobrigações em Cessões de Créditos   | 34.683.020           | 26.012.265           |
|        | <b>Total - Ponderação 75%</b>   | <b>2.026.877.477</b> | <b>1.520.158.108</b> |
| 510.01 | Valores Mantidos em Espécie   | -                    | -                    |
| 526.01 | Depósitos Interfinanceiros  | -                    | -                    |
| 527.01 | Aplicações em Moedas Estrangeiras   | 290.166.612          | 290.166.612          |
| 530.09 | Cotas de Fundo de Investimento  | -                    | -                    |
| 540.05 | Outros  | 3.793.603            | 3.793.603            |
| 550.11 | Demais Operações de Crédito   | 40.296.684           | 40.296.684           |
| 560.02 | Arrendamento Financeiro   | 508.821.391          | 410.019.255          |
| 570.03 | Outros Adiantamentos  | 2.907.094            | 2.907.094            |
| 570.04 | Demais Direitos   | 256.333.803          | 139.911.845          |
| 580    | Outros Valores e Bens   | 64.309.980           | 64.309.980           |
| 590.01 | INVESTIMENTOS - EXCETO ÁGIOS PAGOS  | 67.336               | 67.336               |
| 590.02 | Imobilizado de Uso  | 17.300.359           | 17.300.359           |
| 590.04 | ATIVO PERMANENTE DIFERIDO - EXCETO ÁGIOS PAGOS  | 27.332.433           | 27.332.433           |
| 590.06 | ATIVOS INTANGÍVEIS - EXCETO ÁGIOS PAGOS   | 2.871.514            | 2.871.514            |
| 590.07 | ÁGIOS EM INVESTIMENTOS  | -                    | -                    |
| 610.02 | Adiantamentos sobre Contratos de Câmbio (ACC/ ACE)  | 121.488.648          | 121.488.648          |
| 620.02 | Prestadas a Instituições Financeiras e Instituições Autorizadas a Funcionar p/ BCB  | -                    | -                    |
| 620.04 | Prestadas a Outras Pessoas Físicas ou Jurídicas   | 606.229.791          | 606.229.791          |
| 630    | CRÉDITOS TRIBUTÁRIOS  | 12.436.295           | 12.436.295           |
|        | <b>Total - Ponderação 100%</b>  | <b>1.954.355.545</b> | <b>1.739.131.450</b> |
| 550.11 | Demais Operações de Crédito   | 56.877.598           | 85.316.397           |
|        | <b>Total - Ponderação 150%</b>  | <b>56.877.598</b>    | <b>85.316.397</b>    |
| 550.11 | Demais Operações de Crédito   | -                    | -                    |
|        | <b>Total - Ponderação 300%</b>  | <b>-</b>             | <b>-</b>             |
| 530.07 | Derivativos - Valor de Reposição  | 367.753.585          | 367.753.585          |
| 530.08 | Derivativos - Ganho Potencial Futuro  | 3.438.377.466        | 129.138.507          |
| 650.01 | Operações a Liquidar de Compra de Moeda Estrangeira no Mercado a Vista  | 62.375.838           | 5.385.149            |
| 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   | 1.519.611            | (1.519.611)          |
| 670    | ATIVOS DEDUZIDOS DO PR A SEREM DEDUZIDOS DO PEPR  | 1.519.611            | (1.519.611)          |
| 700    | Valor da EPR  | 11.298.298.691       | 3.846.034.876        |
| 705    | Valor da Parcela PEPR antes do Adicional de Fator F   | -                    | 423.063.836          |
| 710    | Valor Correspondente ao Adicional de Fator F Determinado pelo Banco Central do Brasil   | -                    | -                    |
| 720    | PEPR  | -                    | 423.063.836          |
| 800    | PCAM  | -                    | 17.603.200           |
| 810    | PJUR1   | -                    | 33.067.000           |
| 820    | PJUR2   | -                    | 65.741.000           |
| 830    | PJUR3   | -                    | 394.000              |
| 840    | PJUR4   | -                    | -                    |
| 850    | PCOM  | -                    | 134.000              |
| 860    | PACS  | -                    | 1.300.000            |
| 870    | POPR  | -                    | 27.115.681           |
| 880    | Adicional BCB   | -                    | -                    |
| 900    | PRE   | -                    | 568.418.718          |
| 100    | Patrimônio de Referência - PR   | -                    | 948.763.614          |
| IB     | Índice de Basileia  | -                    | 18,36%               |
| 890    | RBAN - Montante do PR apurado para cobertura do risco da taxa de juros das operações não classificadas na carteira de negociação                        | -                    | 59.334.151           |
| IB     | Índice de Basileia Amplo (com RBAN) - Inclui Riscos não Abrangidos Pelas Parcelas do PR   | -                    | 16,63%               |

## Informações relativas às exposições a riscos de crédito:

| Descrição  | R\$            |
|--|----------------|
| Valor total das exposições a risco de crédito conforme Circular nº 3.360/07  | 11.296.779.079 |
| Média das exposições a risco de crédito no trimestre                         | 11.072.720.664 |
| Montante de provisões para perdas relativas às exposições a risco de crédito | 284.352.200    |
| Operações baixadas para prejuízo no trimestre                                | 70.979.914     |

## Informação relativa à instrumento mitigador de risco de crédito:

| Descrição   | R\$           |
|---|---------------|
| Valor Total Mitigado para Operações Compromissadas com Lastro em Títulos Públicos | 2.274.624.674 |

## Informações relativas ao risco de crédito de contraparte:

| 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  | 16.392.262.591 |
| Valores relativos a contratos sem garantia, nos quais não haja a atuação de câmaras de compensação como contraparte central   | 7.049.325.106  |
| 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 | 23.562.775.274 |