

Detalhamento do patrimônio de referência (PR) :

Contas	+/-	Descrição	R\$
110.01	+	Patrimônio Líquido	950.283.200
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	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	-
110	=	Patrimônio de Referência Nível I - PR I	966.562.410
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	-
120	=	Patrimônio de Referência Nível II - PR II	(17.798.822)
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	966.562.410
120	+	Patrimônio de Referência Nível II - PR II	(17.798.822)
130	-	Deduções Do Patrimônio de Referência	-
100	=	Patrimônio de Referência - PR	948.763.589

Detalhamento do Patrimônio de Referência Exigido (PRE) :

Contas	Descrição	Valor da Exposição	Valor da EPR - PRE
510.01	Valores Mantidos em Espécie	103.683	-
510.02	Banco Central - Reserva Livre em Espécie	9.830.828	-
521.01	Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais	1.935.619.293	-
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	-	-
523.01	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	-
	Total - Ponderação 0%	3.227.224.173	-
510.03	Depósitos Bancários	3.375.391	675.078
	Total - Ponderação 20%	3.375.391	675.078
	Total - Ponderação 35%	-	-
	Total - Ponderação 50%	-	-
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
	Total - Ponderação 75%	2.026.877.477	1.520.158.108
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	32.822.037	32.822.037
590.02	Imobilizado de Uso	15.243.876	15.243.876
590.04	ATIVO PERMANENTE DIFERIDO - EXCETO ÁGIOS PAGOS	8.937.577	8.937.577
590.06	ATIVOS INTANGÍVEIS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	2.853.644	2.853.644
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
	Total - Ponderação 100%	1.966.641.036	1.751.416.942
550.11	Demais Operações de Crédito	56.877.598	85.316.397
	Total - Ponderação 150%	56.877.598	85.316.397
550.11	Demais Operações de Crédito	-	-
	Total - Ponderação 300%	-	-
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	11.151.022.177	3.858.324.155
705	Valor da Parcela PEPR antes do Adicional de Fator F	-	424.415.657
710	Valor Correspondente ao Adicional de Fator F Determinado pelo Banco Central do Brasil	-	-
720	PEPR	-	424.415.657
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	-	26.833.491
880	Adicional BCB	-	-
900	PRE	-	569.488.348
100	Patrimônio de Referência - PR	-	948.763.589
IB	Índice de Basileia	-	18,33%
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	-	16,60%

Informações relativas às exposições a riscos de crédito:

Descrição	R\$
Valor total das exposições a risco de crédito conforme Circular nº 3.360/07	11.149.502.566
Média das exposições a risco de crédito no trimestre	11.033.315.405
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	1.942.627.578

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	6.889.659.418
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	23.403.109.587