

Detalhamento do patrimônio de referência (PR) :

| Contas | Descrição | R\$ |
|--------------------|---|-------------------------|
| 100 | Patrimônio De Referência (PR) | 1.038.623.213,92 |
| 110 | Patrimônio De Referência Nível I (PR_I) | 1.038.623.213,92 |
| 111 | Capital Principal – CP | 1.038.623.213,92 |
| 111.01 | Capital Social | 2.374.923.045 |
| 111.02 | Reservas De Capital, Reavaliação e de Lucros | 3.616.514 |
| 111.03 | Ganhos Não Realizados de Ajustes de Avaliação Patrimonial Exceto de Hedge de Fluxo de Caixa | - |
| 111.04 | Sobras ou Lucros Acumulados | - |
| 111.05 | Contas de Resultado Credoras | 3.487.089.313 |
| 111.06 | Depósito Para Suficiência de Capital | - |
| 111.07 | Ajustes Positivos ao Valor de Mercado de Derivativos | 3.994.895 |
| 111.08 | Outros Instrumentos Elegíveis ao Capital Principal | - |
| 111.90 | De Capital Principal Ajustado em Relação ao Capital Social | 7.611.409 |
| 111.90.01 | Capital Principal Ajustado I | 7.611.409 |
| 111.91 | Deduções do Capital Principal Exceto Ajustes Prudenciais | 4.822.066.926 |
| 111.91.01 | Não Realizadas – Avaliação Patrimonial e TVM | 2.792.929 |
| 111.91.02 | Ações em Tesouraria e Outros Instrumentos de Emissão Própria | - |
| 111.91.03 | Perdas ou Prejuízos Acumulados | 1.344.659.807 |
| 111.91.04 | Contas de Resultado Devedoras | 3.474.614.190 |
| 111.91.05 | Ajustes Negativos ao Valor de Mercado de Derivativos | - |
| 111.91.06 | Ações do Conglomerado Objeto de Financiamento de Entidades do Conglomerado | - |
| 111.91.07 | Ações do Conglomerado Emitidas com Expectativa de Resgate, Reembolso, Amortização, Recompra ou | - |
| 111.92 | Ajustes Prudenciais Exceto Participações Não Consolidadas e Crédito Tributário | 8.933.626 |
| 111.92.01 | Ajuste Prudencial I - Ágios Pagos | - |
| 111.92.02 | Ajuste Prudencial II - Ativos Intangíveis | - |
| 111.92.02.01 | A Partir de Outubro de 2013 | - |
| 111.92.02.02 | Antes de Outubro de 2013 | - |
| 111.92.03 | Ajuste Prudencial III - Ativos Atuariais | - |
| 111.92.04 | Ajuste Prudencial VI - Não Controladores | - |
| 111.92.05 | Ajuste Prudencial VIII - Crédito Tributário de Prejuízo Fiscal de Superveniência | - |
| 111.92.05.01 | De Crédito Tributário de Prejuízo Fiscal de Superveniência | - |
| 111.92.05.90 | Obrigações Fiscais Diferidas Compensadas com Crédito Tributário de Prejuízo Fiscal de Superveniência | - |
| 111.92.06 | Ajuste Prudencial VIII - Demais Créditos Tributários de Prejuízo Fiscal e Relacionados à CSLL | - |
| 111.92.06.01 | Valor Inferior ou Igual a 10% Nível I | - |
| 111.92.06.01.01 | Demais Créditos Tributários de Prejuízo Fiscal e Relacionados à CSLL - Após Eventual Compensação Com Obrigações Fiscais Diferidas | - |
| 111.92.06.01.01.01 | Total de Demais Créditos Tributários de Prejuízo Fiscal e Relacionados à CSLL | - |
| 111.92.06.01.01.90 | Obrigações Fiscais Diferidas Compensadas com Demais Créditos Tributários de Prejuízo Fiscal/CSLL | - |
| 111.92.06.01.02 | 10% do PR Nível I Desconsiderados os Ajustes Prudenciais | 104.755.684 |
| 111.92.06.01.02.01 | PR Nível I Desconsiderados os Ajustes Prudenciais | 1.047.556.840 |
| 111.92.06.02 | Valor que Excede a 10% do Nível I | - |
| 111.92.07 | Ajuste Prudencial IX - Ativos Diferidos | 8.933.626 |
| 111.92.08 | Ajuste Prudencial X - Investimento em Outras Entidades | - |
| 111.92.08.01 | Instrumentos de Captação Emitidos por IF | - |
| 111.92.08.02 | Instrumentos Adquiridos por Assemblhadas, Não Financeiras ou por Meio de Derivativos | - |
| 111.92.08.03 | Instrumentos Adquiridos por Meio de Fundos | - |
| 111.92.08.04 | Participação Indireta de Cooperativas em Banco Cooperativo | - |
| 111.92.08.05 | Crédito Concedido para Aumento de Capital de Intituição Financeira | - |
| 111.92.08.06 | Excesso de Dedução de Investimentos no Capital Complementar | - |
| 111.92.09 | Ajuste Prudencial XI - Participação no Exterior ou Não IF sem Acesso BC | - |
| 111.92.09.01 | Investimento | - |
| 111.92.09.02 | Determinação BC | - |
| 111.92.10 | Ajuste Prudencial XII - Diferença a Menor - Modelo Interno IRB | - |
| 111.92.11 | Ajuste Prudencial XIV – Participação de não Controladores em Subsidiárias não Autorizadas Pelo BCB | - |
| 111.92.12 | Ajuste Prudencial XV – Diferença a Menor – Ajustes da Resolução 4.277/13 | - |
| 111.93 | Prudencial IV - Investimentos Inferiores | - |
| 111.93.01 | Total de Investimentos Inferiores em Assemblhadas | 5.764 |
| 111.93.02 | Limite para Investimentos Inferiores em Assemblhadas | 103.862.321 |
| 111.93.02.01 | Capital Principal Ajustado II | 1.038.623.214 |
| 111.94 | Ajustes Prudenciais V e VII - Créditos Tributários de Diferença Temporária e Investimentos Superiores em | - |
| 111.94.01 | Ajuste Prudencial V Antes da Glosa de 15% - Investimentos Superiores | - |
| 111.94.01.01 | Total de Investimentos Superiores | - |
| 111.94.01.02 | Limite para Investimentos Superiores | 103.862.321 |
| 111.94.01.02.01 | Capital Principal Ajustado III | 1.038.623.214 |
| 111.94.02 | Ajuste Prudencial VII Antes da Glosa de 15% - Créditos Tributários de Diferença Temporária | - |
| 111.94.02.01 | Total de Créditos Tributários Decorrentes de Diferenças Temporárias Líquidos de Obrigações Fiscais | - |
| 111.94.02.01.01 | Total de Créditos Tributários Decorrentes de Diferenças Temporárias | 2.566.233 |
| 111.94.02.01.90 | Obrigações Fiscais Diferidas Passíveis de Compensação | 84.068.864 |
| 111.94.02.01.90.01 | Total de Obrigações Fiscais Diferidas | 84.068.864 |
| 111.94.02.01.90.90 | Obrigações Fiscais Diferidas Decorrentes de Ágios Pagos | - |
| 111.94.02.01.90.91 | Obrigações Fiscais Diferidas Decorrentes de Ativos Atuariais relacionados a Fundos de Pensão de Benefício Definido | - |
| 111.94.02.01.90.92 | Obrigações Fiscais Diferidas não Compensáveis por Autoridade Relevante em Cada País | - |
| 111.94.02.01.90.93 | Obrigações Fiscais Diferidas Compensadas com Créditos Tributários de Prejuízo Fiscal/CSLL | - |
| 111.94.02.02 | Limite para Créditos Tributários Decorrentes de Diferença Temporária | 103.862.321 |
| 111.94.03 | Ajustes Prudenciais V e VII decorrentes de limitação de 15% do Capital Principal | - |
| 111.94.03.01 | Investimentos Superiores a 10% em Assemblhadas não Consolidadas e Créditos Tributários Decorrentes de Diferenças Temporárias | - |
| 111.94.03.02 | Limite para Participações Superiores e de Créditos Tributários Decorrentes de Diferença Temporária | 160.611.837 |

Detalhamento do patrimônio de referência (PR) :

| Contas | Descrição | R\$ |
|--------------------|--|-----|
| 111.94.04 | Participações Superiores e Créditos Tributários de Diferença Temporária não Deduzidos | - |
| 111.94.04.01 | Participações Superiores não Deduzidas | - |
| 111.94.04.01.01 | Auxiliar – Basket Bruto | - |
| 111.94.04.01.01.01 | Auxiliar – Basket Bruto Participações Superiores | - |
| 111.94.04.01.01.02 | Auxiliar - Basket Bruto Créditos Tributários | - |
| 111.94.04.01.90 | Auxiliar - Ajuste ao Basket | - |
| 111.94.04.01.90.01 | Auxiliar - Ajuste ao Basket de Participações Superiores | - |
| 111.94.04.01.90.02 | Auxiliar - Ajuste ao Basket de Créditos Tributários | - |
| 111.94.04.02 | Créditos Tributários de Diferença Temporária não Deduzidos | - |
| 111.94.04.03 | Participações Superiores Deduzidas | - |
| 111.94.04.04 | Créditos Tributários de Diferença Temporária Deduzidos | - |
| 112 | Capital Complementar - CC | |
| 112.01 | Instrumentos elegíveis ao Capital Complementar | - |
| 112.01.01 | Autorizados em conformidade com a Resolução 4.192 | - |
| 112.01.02 | Autorizados com base em normas anteriores a resolução 4.192 | - |
| 112.90 | Ações em tesouraria a serem deduzidas do capital complementar | - |
| 112.90.01 | De instrumentos elegíveis autorizados em conformidade com a Resolução 4.192 | - |
| 112.90.02 | De instrumentos elegíveis autorizados com base em normas anteriores a Resolução 4.192 | - |
| 112.90.03 | Ações de Emissão Própria Adquiridas Indiretamente ou de Forma Sintética | - |
| 112.91 | Participações de não controladores | - |
| 112.92 | Excesso de dedução de investimento em outras entidades no Nível II | - |
| 112.93 | Investimento em Outras Entidades Deduzido do Capital Complementar | - |
| 112.93.01 | Instrumentos de Captação Emitidos por IF | - |
| 112.93.02 | Instrumentos adquiridos por assemelhadas, não financeiras ou por meio de derivativos | - |
| 112.93.03 | Instrumentos Adquiridos por Meio de Fundos | - |
| 112.93.04 | Crédito Concedido para Aumento de Capital de Intuição Financeira | - |
| 112.93.05 | Excesso de Dedução de Investimento em Outras Entidades no Capital Complementar a ser Deduzido do Capital Principal | - |
| 112.93.05.01 | Limite de Dedução de Investimentos no Capital Complementar | - |
| 120 | Patrimônio de referência Nível II | |
| 120.01 | Instrumentos Elegíveis ao Nível II | - |
| 120.01.01 | Autorizados em Conformidade com a Resolução 4.192 | - |
| 120.01.02 | Autorizados com Base em Normas Anteriores a resolução 4.192 | - |
| 120.01.02.01 | Autorizados com Base em Normas Anteriores a resolução 4.192 - Com redutor | - |
| 120.01.02.02 | Autorizados com Base em Normas Anteriores a resolução 4.192 - Com Limitador | - |
| 120.02 | Diferença Entre Valor Provisionado e Perda Esperada na Abordagem IRB Limitada a 0,6% do RWACIRB | - |
| 120.02.01 | Diferença entre Valor Provisionado e Perda Esperada na Abordagem IRB | - |
| 120.02.02 | Limitador da Parcela Correspondente a 0,6% do RWACIRB | - |
| 120.90 | Ações em Tesouraria a serem deduzidas do nível II | - |
| 120.90.01 | De Instrumentos Elegíveis Autorizados em Conformidade com a Resolução 4.192 | - |
| 120.90.02 | De Instrumentos Elegíveis Autorizados com Base em Normas Anteriores a 4.192 | - |
| 120.90.02.01 | Com redutor | - |
| 120.90.02.02 | Com Limitador | - |
| 120.90.03 | Ações de Emissão Própria Adquiridas Indiretamente ou de Forma Sintética | - |
| 120.91 | Participações de Não Controladores no Nível II | - |
| 120.92 | Investimento em Outras Entidades Deduzido do Nível II | - |
| 120.92.01 | Instrumentos de Captação Emitidos por IF | - |
| 120.92.02 | Instrumentos Adquiridos por Assemelhadas, Não Financeira ou por Meio de Derivativo | - |
| 120.92.03 | Instrumentos Adquiridos por Meio de Fundos | - |
| 120.92.04 | Crédito Concedido para Aumento de Capital de Intuição Financeira | - |
| 120.92.05 | Excesso de Dedução de Investimento em Outras Entidades no Nível II | - |
| 120.92.05.01 | Limite de Dedução de Investimentos no Nível II | - |

Detalhamento do Patrimônio de Referência Exigido (PRE) - R\$:

| Contas | Descrição | Valor da Exposição | Valor da EPR - PRE |
|--------|---|--------------------|----------------------|
| 510.01 | Valores Mantidos em Espécie | 119.356,52 | - |
| 510.02 | Banco Central - Reserva Livre em Espécie | 2.535.624,46 | - |
| 521.01 | Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais | 1.349.999.279,80 | - |
| 522.01 | Operações Compromissadas - Venda com compromisso de Recompra - Títulos Públicos Federais | 6.996.839,72 | - |
| 523.01 | Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda, conjugado com Venda com compromisso de Recompra (Broqueragem) - Títulos Públicos Federais | 249.999.313,83 | - |
| 524.01 | Operações Compromissadas - Posição Vendida - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais | - | - |
| 530.01 | Títulos Públicos Federais | 1.996.390.232,40 | - |
| 540.01 | Créditos Vinculados - Banco Central | 1.651.483,17 | - |
| | Total - Ponderação 0% | | - |
| 510.03 | Depósitos Bancários | 190.554,63 | 38.111 |
| | Total - Ponderação 20% | | 38.111 |
| | Total - Ponderação 35% | | - |
| | Total - Ponderação 50% | | - |
| 550.10 | Operações de Varejo | 1.696.923.400,88 | 1.101.978.508 |
| | Total - Ponderação 75% | | 1.101.978.508 |
| 530.06 | Outros Títulos e Valores Mobiliários | 51.078.866,40 | 43.417.036 |
| | Total - Ponderação 85% | | 43.417.036 |
| 526.01 | Depósitos Interfinanceiros | - | - |
| 527.01 | Aplicações em Moedas Estrangeiras | 124.970.874,17 | 124.970.874 |
| 530.09 | Cotas de Fundo de Investimento | - | - |
| 530.06 | Outros Títulos e Valores Mobiliários | - | - |
| 540.05 | Outros | 4.205.818,72 | 4.205.819 |
| 550.11 | Demais Operações de Crédito | 130.012.145,75 | 130.012.146 |
| 560.02 | Arrendamento Financeiro | 604.799.361,17 | 537.468.433 |
| 570.03 | Outros Adiantamentos | 2.684.902,23 | 2.684.902 |
| 570.04 | Demais Direitos | 277.118.168,54 | 110.092.007 |
| 580 | Outros Valores e Bens | 51.199.882,73 | 51.199.883 |
| 590.01 | INVESTIMENTOS - EXCETO ÁGIOS PAGOS | 18.165.951,24 | 18.165.951 |
| 590.02 | Imobilizado de Uso | 19.323.577,13 | 19.323.577 |
| 590.04 | ATIVO PERMANENTE DIFERIDO - EXCETO ÁGIOS PAGOS | 5.241.316,15 | 5.241.316 |
| 590.06 | ATIVOS INTANGÍVEIS - EXCETO ÁGIOS PAGOS | 247.544,77 | 247.545 |
| 590.07 | ÁGIOS EM INVESTIMENTOS | - | - |
| 610.02 | Adiantamentos sobre Contratos de Câmbio (ACC/ ACE) | 585.504.350,09 | 585.504.350 |
| 620.02 | Prestadas a Instituições Financeiras e Instituições Autorizadas a Funcionar p/ BCB | - | - |
| 620.04 | Prestadas a Outras Pessoas Físicas ou Jurídicas | 1.005.603.607,11 | 1.005.603.607 |
| 620.06 | Coobrigações em Cessões de Créditos | 9.127.366,35 | 9.127.366 |
| 630 | CRÉDITOS TRIBUTÁRIOS | 2.566.232,82 | 2.566.233 |
| | Total - Ponderação 100% | | 2.606.414.009 |
| 550.11 | Demais Operações de Crédito | - | - |
| | Total - Ponderação 150% | | - |
| | Total - Ponderação 300% | | - |
| 530.07 | Derivativos - Valor de Reposição | | 543.199.505 |
| 530.08 | Derivativos - Ganho Potencial Futuro | | 323.983.776 |
| 650.01 | Operações a Liquidar de Compra de Moeda Estrangeira no Mercado a Vista | | 11.803.795 |
| 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 | 8.933.626,08 | (8.933.626,08) |
| 670 | ATIVOS DEDUZIDOS DO PR A SEREM DEDUZIDOS DO PEPR | | (8.933.626) |
| 700 | Valor da EPR | | 4.621.901.114 |
| 720 | RWACPAD | | 4.621.901.114 |
| 800 | RWACAM | | 41.090.909 |
| 810 | RWAJUR1 | | 235.918.182 |
| 820 | RWAJUR2 | | 631.290.909 |
| 830 | RWAJUR3 | | 2.218.182 |
| 840 | RWAJUR4 | | - |
| 850 | PCOM | | - |
| 860 | PACS | | 60.518.182 |
| 870 | RWAOPAD | | 580.611.924 |
| 880 | Adicional BCB | | - |
| 890 | RBAN - Montante do PR apurado para cobertura do risco da taxa de juros das operações não classificadas | | 28.167.479 |
| 900 | PRE | | 6.173.549.401 |
| 100 | Patrimônio de Referência - PR | | 1.038.623.214 |
| IB | Índice de Basileia | | 16,82% |
| IB | Índice de Basileia Ampla (com RBAN) - Inclui Riscos não Abrangidos Pelas Parcelas do PR | | 16,15% |

Informações relativas às exposições a riscos de crédito:

| Descrição | R\$ |
|---|------------------|
| Operações de Varejo | 1.656.955 |
| Operações de Arrendamento | 611.518 |
| Demais operações de crédito | 920.786 |
| Valor total das exposições a risco de crédito | 3.189.259 |
| Operações de Varejo | 1.682.897 |
| Operações de Arrendamento | 573.306 |
| Demais operações de crédito | 958.318 |
| Média das exposições a risco de crédito no trimestre | 3.214.521 |

Percentual das exposições dos dez maiores clientes em relação ao total:

| Descrição | R\$/1000 | % |
|--|------------------|-------------|
| 10 maiores exposições | 696.859 | 22% |
| 100 maiores exposições | 1.266.354 | 40% |
| Total | 3.189.259 | 100% |
| Países e regiões geográficas do Brasil com exposições significativas; | | |
| Centro-Oeste | 3.363 | |
| Nordeste | 26.722 | |
| Norte | 177 | |
| Sudeste | 3.006.248 | |
| Sul | 152.749 | |
| Montante de provisões para perdas | | |
| Operações baixadas para prejuízo no trimestre | | |

Valor total das operações de crédito por setor econômico:

| Descrição | R\$/1000 |
|--------------------------|------------------|
| Setor privado: | |
| Indústria | 704.179 |
| Comércio | 177.624 |
| Instituições financeiras | 28.325 |
| Pessoas físicas | 1.856.223 |
| Habituação | |
| Outros | 240.045 |
| Serviços | 182.863 |
| Setor público | |
| Governo federal | |
| Total | 3.189.259 |

Prazo a decorrer das operações incluindo , no mínimo:

| Descrição | R\$/1000 |
|------------------------------|------------------|
| até 6 meses; | 580.651 |
| acima de 6 meses até 1 ano; | 1.398.723 |
| acima de 1 ano até 5 anos; e | 1.201.287 |
| acima de 5 anos. | 8.598 |
| Total | 3.189.259 |

Montante das operações em atraso, bruto de provisões e excluídas as operações já baixadas para prejuízo, segmentado por países e regiões geográficas do Brasil e por setor econômico com exposições significativas, segregado nas seguintes faixas:

| Descrição | R\$/1000 |
|--------------------------|---------------|
| Atraso 15 e 60 dias | 29.808 |
| Atraso 61 e 90 dias | 11.530 |
| Atraso 91 e 180 dias | 34.983 |
| Atraso 181 e 360 dias | 20.651 |
| Atraso acima de 360 dias | - |
| Total | 96.972 |

Fluxo de operações baixadas para prejuízo no trimestre, segmentado por setor econômico com exposições significativas

| Descrição | R\$/1000 |
|----------------------|---------------|
| Pessoa Física | |
| jul/14 | 14.807 |
| ago/14 | 14.036 |
| set/14 | 14.300 |
| Total | 43.143 |

Informação relativa à instrumento mitigador de risco de crédito:

| Descrição | R\$ |
|---|---------------|
| Valor Total Mitigado para Operações Compromissadas com Lastro em Títulos Públicos | 1.856.994.747 |

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 | 248.141.576 |
| Valores relativos a contratos sem garantia, nos quais não haja a atuação de câmaras de compensação como contraparte central | 4.878.595.997 |
| 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 | 7.015.393.815 |

Informações relativas às operações de venda ou transferência de ativos financeiros e às operações com títulos ou valores mobiliários oriundos de processo de securitização:

| Descrição | R\$ |
|--|-----|
| Transferência de ativos financeiros – Cessão de Crédito | |
| Crédito pessoal consignado - INSS | |
| Financiamento de veículos | |
| Exposições cedidas com transferência substancial dos riscos e benefícios | |

Transferência de ativos financeiros – Cessão de Crédito:

A Política e objetivo da execução de cessões de crédito visam: (i) atender às condições excepcionais de falta de liquidez as quais a instituição financeira se obriga entre outras ações a ceder ativos para atender seu programa de contingência de liquidez, e (ii) proporcionar alternativa de funding no mercado local. A seguir demonstramos as operações contratadas e em aberto:

I - Exposições cedidas com retenção substancial dos riscos e benefícios

O saldo da exposição cedida com retenção substancial dos riscos e benefícios, representado pelo valor presente pela taxa contratual em 30/06/2014, era:

| Banco Cacique | | | | |
|-----------------------------------|----------------|----------------|---------------------------|--|
| Modalidade | Contraparte | Data da cessão | Valor presente (R\$/1000) | |
| Crédito pessoal consignado - INSS | Banco múltiplo | 30/06/2010 | 4.660 | |
| Crédito pessoal consignado - INSS | Banco múltiplo | 17/12/2010 | 3.508 | |

| Banco Pecúnia | | | | |
|---------------------------|----------------|----------------|---------------------------|--|
| Modalidade | Contraparte | Data da cessão | Valor presente (R\$/1000) | |
| Financiamento de veículos | Banco múltiplo | 20/06/2010 | 543 | |

II - Exposições cedidas com transferência substancial dos riscos e benefícios
Banco Cacique

Não foram realizadas cessões de créditos no trimestre findo em 30/09/2014.

Banco Pecúnia

Não foram realizadas cessões de créditos no trimestre findo em 30/09/2014.

Informações relativas às exposições ao risco de taxa de juros das operações não classificadas na carteira de negociação:

Modelo utilizado: VaR histórico, 99% de confiança e horizonte de 10 dias

| Posição | Valor (R\$/1000) |
|-----------|------------------|
| VaR total | R\$ 28.167 |
| Juros pré | R\$ 18.014 |
| Demais | R\$ 11.470 |

Valor total da carteira de negociação por fator de Risco de Mercado:

| Posição | Exposição Ativa Comprada | Exposição Passiva Vendida |
|----------------------|--------------------------|---------------------------|
| Taxa de Câmbio | R\$ 2.610.382.056 | (R\$ 243.878.241) |
| Taxa de Juros | R\$ 4.375.352.422 | (R\$ 3.148.826.227) |
| Preço de Ações | R\$ 959.407.667 | (R\$ 977.502.449) |
| Preço de Mercadorias | R\$ 0 | R\$ 0 |

Valor total da carteira de negociação por fator de Risco de Mercado com e sem contraparte central:

| Com Contraparte Central | Posição | Brasil | | Exterior | |
|-------------------------|---------|-------------------|-------------------|----------|---------|
| | | Comprada | Vendida | Comprada | Vendida |
| Taxa de Câmbio | | R\$ 2.610.382.056 | (R\$ 243.878.241) | R\$ 0 | R\$ 0 |
| Taxa de Juros | | R\$ 2.755.426.021 | (R\$ 693.384.494) | R\$ 0 | R\$ 0 |
| Preço de Ações | | R\$ 740.392.699 | (R\$ 669.864.009) | R\$ 0 | R\$ 0 |
| Preço de Mercadorias | | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 |

| Sem Contraparte Central | Posição | Brasil | | Exterior | |
|-------------------------|---------|-------------------|---------------------|----------|---------|
| | | Comprada | Vendida | Comprada | Vendida |
| Taxa de Câmbio | | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 |
| Taxa de Juros | | R\$ 1.619.926.401 | (R\$ 2.455.441.733) | R\$ 0 | R\$ 0 |
| Preço de Ações | | R\$ 219.014.968 | (R\$ 307.638.440) | R\$ 0 | R\$ 0 |
| Preço de Mercadorias | | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 | R\$ 0 |

Composição do Patrimônio de Referência (PR) e informações sobre a adequação do PR

| Número da Linha | Capital Principal: instrumentos e reservas | Valor (R\$ mil) | Valor sujeito a tratamento transitório (R\$ mil) ¹ | Referência do balanço do conglomerado ² |
|-----------------|--|---------------------|---|--|
| 1 | Instrumentos Elegíveis ao Capital Principal | 2.374.923,00 | - | - |
| 2 | Reservas de lucros | (1.344.659,00) | - | - |
| 3 | Outras receitas e outras reservas | 17.292,00 | - | - |
| 4 | <i>Instrumentos autorizados a compor o Capital Principal antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013</i> | - | - | - |
| 5 | Participação de não controladores em subsidiárias integrantes do conglomerado, não dedutível do Capital Principal | - | - | - |
| 6 | Capital Principal antes dos ajustes prudenciais | 1.047.556 | - | - |
| Número da Linha | Capital Principal: ajustes prudenciais | Valor (R\$ mil) | Valor sujeito a tratamento transitório (R\$ mil) ¹ | Referência do balanço do conglomerado ² |
| 7 | Ajustes prudenciais relativos a apreçamento de instrumentos financeiros | - | - | - |
| 8 | Ágios pagos na aquisição de investimentos com fundamento em expectativa de rentabilidade futura | - | - | - |
| 9 | Ativos intangíveis | - | - | - |
| 10 | Créditos tributários decorrentes de prejuízos fiscais e de base negativa de Contribuição Social sobre o Lucro Líquido e os originados dessa contribuição relativos a períodos de apuração encerrados até 31 de dezembro de 1998 | - | - | - |
| 11 | Ajustes relativos ao valor de mercado dos instrumentos financeiros derivativos utilizados para hedge de fluxo de caixa de itens protegidos que não tenham seus ajustes de | - | - | - |
| 12 | Diferença a menor entre o valor provisionado e a perda esperada para instituições que usam IRB | - | - | - |
| 13 | Ganhos resultantes de operações de securitização | - | - | - |
| 14 | Ganhos ou perdas advindos do impacto de mudanças no risco de crédito da instituição na avaliação a valor justo de itens do passivo | - | - | - |
| 15 | Ativos atuariais relacionados a fundos de pensão de benefício definido | - | - | - |
| 16 | Ações ou outros instrumentos de emissão própria autorizados a compor o Capital Principal adquiridos diretamente, indiretamente ou de forma sintética | - | - | - |
| 17 | Investimentos cruzados em instrumentos elegíveis ao Capital Principal | - | - | - |
| 18 | Valor agregado das participações inferiores a 10% do capital social de empresas assemelhadas a instituições financeiras não consolidadas, de sociedade seguradoras, resseguradoras, de capitalização e de entidades abertas de previdência complementar, que exceda 10% do valor do Capital Principal, desconsiderando deduções específicas | - | - | - |
| 19 | Participações superiores a 10% do capital social de empresas assemelhadas a instituições financeiras não consolidadas, de sociedades seguradoras, resseguradoras, de capitalização e de entidades abertas de previdência complementar | - | - | - |
| 20 | Mortgage servicing rights | - | - | - |
| 21 | Créditos tributários decorrentes de diferenças temporárias que dependam de geração de lucros ou receitas tributáveis futuras para sua realização, acima do limite de 10% do Capital Principal, desconsiderando deduções específicas | - | - | - |
| 22 | Valor que excede a 15% do Capital Principal | - | - | - |
| 23 | do qual: oriundo de participações no capital social de empresas assemelhadas a instituições financeiras não consolidadas, de sociedade seguradoras, resseguradoras, de capitalização, e de entidades abertas de previdência complementar | - | - | - |
| 24 | do qual: oriundo de direitos por serviços de hipoteca | - | - | - |
| 25 | do qual: oriundo de créditos tributários decorrentes de diferenças temporárias que dependam de geração de lucros ou receitas tributáveis futuras para sua realização | - | - | - |
| 26 | Ajustes regulatórios nacionais | 8.933,00 | - | - |
| 26.a | Ativos permanentes diferidos | 8.933,00 | - | - |
| 26.b | Investimento em dependência, instituição financeira controlada no exterior ou entidade não financeira que componha o conglomerado, em relação às quais o Banco Central do Brasil não tenha acesso a informações, dados e documentos | - | - | - |
| 26.c | Instrumentos de captação elegíveis ao Capital Principal emitidos por instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil ou por instituição financeira no exterior, que não componha o conglomerado | - | - | - |
| 26.d | Aumento de capital social não autorizado | - | - | - |
| 26.e | Excedente ao valor ajustado de Capital Principal | - | - | - |
| 26.f | Depósito para suprir deficiência de capital | - | - | - |
| 26.g | Montante dos ativos intangíveis constituídos antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013 | - | - | - |
| 26.h | Excesso dos recursos aplicados no Ativo Permanente | - | - | - |
| 26.i | Destaque do PR | - | - | - |
| 26.j | Outras diferenças residuais relativas à metodologia de apuração do Capital Principal para fins regulatórios | - | - | - |
| 27 | Ajustes regulatórios aplicados ao Capital Principal em função de insuficiência do Capital Complementar e de Nível II para cobrir deduções | - | - | - |
| 28 | Total de deduções regulatórias ao Capital Principal | 8.933,00 | - | - |
| 29 | Capital Principal | 1.038.623,00 | - | - |

Composição do Patrimônio de Referência (PR) e informações sobre a adequação do PR

| Número da Linha | Capital Complementar: instrumentos | Valor (R\$ mil) | Valor sujeito a tratamento transitório (R\$ mil) ¹ | Referência do balanço do conglomerado ² |
|-----------------|---|-----------------|---|--|
| 30 | Instrumentos elegíveis ao Capital Complementar | - | - | - |
| 31 | dos quais: classificados como capital social conforme as regras contábeis | - | - | - |
| 32 | dos quais: classificados como passivo conforme as regras contábeis | - | - | - |
| 33 | Instrumentos autorizados a compor o Capital Complementar antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013 | - | - | - |
| 34 | Participação de não controladores em subsidiárias integrantes do conglomerado, não dedutível do Capital Complementar | - | - | - |
| 35 | dos quais: instrumentos emitidos por subsidiárias antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013 | - | - | - |
| 36 | Capital Complementar antes das deduções regulatórias | - | - | - |
| Número da Linha | Capital Complementar: deduções regulatórias | Valor (R\$ mil) | Valor sujeito a tratamento transitório (R\$ mil) ¹ | Referência do balanço do conglomerado ² |
| 37 | Ações ou outros instrumentos de emissão própria autorizados a compor o Capital Complementar, adquiridos diretamente, indiretamente ou de forma sintética | - | - | - |
| 38 | Investimentos cruzados em instrumentos elegíveis ao capital complementar | - | - | - |
| 39 | Valor agregado dos investimentos inferiores a 10% do capital social de instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil ou de instituições financeiras no exterior que não componham o conglomerado e que exceda 10% do valor do Capital Complementar | - | - | - |
| 40 | Participações superiores a 10% do capital social instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil ou por instituição financeira no exterior, que componha o conglomerado | - | - | - |
| 41 | Ajustes regulatórios nacionais | 8.933,00 | - | - |
| 41.a | Instrumentos de captação elegíveis ao Capital Complementar emitidos por instituições autorizadas a Circular nº 3.716, de 21 de agosto de 2014 Página 8 de 17 funcionar pelo Banco Central do Brasil ou por instituições financeiras no exterior que não componham o conglomerado, considerando o montante inferior a 10% do valor do Capital Complementar | - | - | - |
| 41.b | Participação de não controladores no Capital Complementar | - | - | - |
| 41.c | Outras diferenças residuais relativas à metodologia de apuração do Capital Principal para fins regulatórios | - | - | - |
| 42 | Ajustes regulatórios aplicados ao Capital Complementar em função de insuficiência do Nível II para cobrir deduções | - | - | - |
| 43 | Total de deduções regulatórias ao Capital Complementar | - | - | - |
| 44 | Capital Complementar | - | - | - |
| 45 | Nível I | 1.038.623,00 | - | - |
| Número da Linha | Nível II: instrumentos | Valor (R\$ mil) | Valor sujeito a tratamento transitório (R\$ mil) ¹ | Referência do balanço do conglomerado ² |
| 46 | Instrumentos elegíveis ao Nível II | - | - | - |
| 47 | Instrumentos autorizados a compor o Nível II antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013 | - | - | - |
| 48 | Participação de não controladores em subsidiárias integrantes do conglomerado, não dedutível do Nível II | - | - | - |
| 49 | dos quais: instrumentos emitidos por subsidiárias antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013 | - | - | - |
| 50 | Excesso de provisões em relação à perda esperada no IRB | - | - | - |
| 51 | Nível II antes das deduções regulatórias | - | - | - |
| Número da Linha | Nível II: deduções regulatórias | Valor (R\$ mil) | Valor sujeito a tratamento transitório (R\$ mil) ¹ | Referência do balanço do conglomerado ² |
| 52 | Ações ou outros instrumentos se emissão própria, autorizados a compor o Nível II, adquiridos diretamente, indiretamente ou de forma sintética | - | - | - |
| 53 | Investimentos cruzados em instrumentos elegíveis ao Nível II | - | - | - |
| 54 | Valor agregado dos investimentos inferiores a 10% do capital social de instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil ou de instituições financeiras no exterior que não componham o conglomerado, que exceda 10% do valor do Nível II | - | - | - |
| 55 | Participações superiores a 10% do capital social instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil ou por instituição financeira no exterior, que não componha o conglomerado | - | - | - |
| 56 | Ajustes regulatórios nacionais | - | - | - |
| 56.a | Instrumentos de captação elegíveis ao Nível II emitidos por instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil ou por instituições financeiras no exterior, que não componham o conglomerado | - | - | - |
| 56.b | Participação de não controladores no Nível II | - | - | - |
| 56.c | Outras diferenças residuais relativas à metodologia de apuração do Nível II para fins regulatórios | - | - | - |
| 57 | Total de deduções regulatórias ao Nível II | - | - | - |
| 58 | Nível II | - | - | - |

Composição do Patrimônio de Referência (PR) e informações sobre a adequação do PR

| | | | | | |
|------------------------|---|--|------------------------|---|--|
| 59 | Patrimônio de Referência (Nível I + Nível II) | | 1.038.623,00 | - | - |
| 60 | Total de ativos ponderados pelo risco | | 6.173.549,00 | - | - |
| Número da Linha | Índices de Basileia e Adicional de Capital Principal | | Valor (R\$ mil) | | |
| 61 | Índice de Capital Principal (ICP) | | 16,82% | - | - |
| 62 | Índice de Nível I (IN1) | | 16,82% | - | - |
| 63 | Índice de Basileia (IB) | | 16,82% | - | - |
| 64 | Requerimento mínimo de Capital Principal, incluindo os adicionais de capital (% dos RWA) | | 0,00% | - | - |
| 65 | do qual: adicional para conservação de capital | | 0,00% | - | - |
| 66 | do qual: adicional contracíclico | | 0,00% | - | - |
| 67 | do qual: adicional para instituições sistemicamente importantes em nível global (G-SIB) | | 0 | - | - |
| 68 | Montante de Capital Principal alocado para suprir os valores demandados de Adicional de Capital Principal (% dos RWA) | | 16,82% | - | - |
| Número da Linha | Mínimos Nacionais | | Valor (R\$ mil) | | |
| 69 | Índice de Capital Principal (ICP), se diferente do estabelecido em Basileia III | | 0 | - | - |
| 70 | Índice de Nível I (IN1), se diferente do estabelecido em Basileia III | | 16,82% | - | - |
| 71 | Índice de Basileia (IB), se diferente do estabelecido em Basileia III | | 16,82% | - | - |
| Número da Linha | Valores abaixo do limite para dedução (não ponderados pelo risco) | | Valor (R\$ mil) | Valor sujeito a tratamento transitório (R\$ mil)¹ | Referência do balanço do conglomerado² |
| 72 | Valor agregado das participações inferiores a 10% do capital social de empresas assemelhadas a instituições financeiras não consolidadas, de sociedade seguradoras, resseguradoras, de capitalização e de entidades abertas de previdência complementar | | - | - | - |
| 73 | Participações superiores a 10% do capital social de empresas assemelhadas a instituições financeiras não consolidadas, de sociedades seguradoras, resseguradoras, de capitalização e de entidades abertas de previdência complementar | | - | - | - |
| 74 | Mortgage servicing rights | | - | - | - |
| 75 | Créditos tributários decorrentes de diferenças temporárias, não deduzidos do Capital Principal | | - | - | - |
| Número da Linha | Limites à inclusão de provisões no Nível II | | Valor (R\$ mil) | | |
| 76 | Provisões genéricas elegíveis à inclusão no Nível II relativas a exposição sujeitas ao cálculo do requerimento de capital mediante abordagem padronizada | | - | - | - |
| 77 | Limite para a inclusão de provisões genéricas no Nível II para exposições sujeitas à abordagem padronizada | | - | - | - |
| 78 | Provisões elegíveis à inclusão no Nível II relativas a exposição sujeitas ao cálculo do requerimento de capital mediante abordagem IRB (antes da aplicação do limite) | | - | - | - |
| 79 | Limite para a inclusão de provisões genéricas no Nível II para exposições sujeitas à abordagem IRB | | - | - | - |
| Número da Linha | Instrumentos autorizados a compor o PR antes da entrada em vigor da Resolução 4.192, de 2013 (Aplicável entre 1º de outubro de 2013 e 1º de janeiro de 2022) | | Valor (R\$ mil) | Valor sujeito a tratamento transitório (R\$ mil)¹ | Referência do balanço do conglomerado² |
| 80 | Limite atual para os instrumentos autorizados a compor o Capital Principal antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013 | | - | - | - |
| 81 | Valor excluído do Capital Principal devido ao limite | | - | - | - |
| 82 | Instrumentos autorizados a compor o Capital Complementar antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013 | | - | - | - |
| 83 | Valor excluído do Capital Complementar devido ao limite | | - | - | - |
| 84 | Instrumentos autorizados a compor o Nível II antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013 | | - | - | - |
| 85 | Valor excluído do Nível II devido ao limite | | - | - | - |

¹ Coluna em que deve constar o valor dos ajustes regulatórios sujeitos ao tratamento temporário. O ajuste regulatório corresponde ao valor:

- dos instrumentos autorizados a compor o PR da instituição antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013, que, entre 1º de outubro de 2013 e 31 de dezembro de 2021, ainda
- dos ajustes prudenciais que, entre 1º de outubro de 2013 e 31 de dezembro de 2017, ainda não forem integralmente deduzidos do PR, conforme art. 11 da Resolução 4.192, de 2013 (as linhas 5,

² Deve constar nesta coluna a referência dos instrumentos reportados na tabela em relação ao balanço patrimonial da instituição ou do conglomerado, conforme inciso I e §1º do art. 3º desta Circular.

³ As linhas 4, 33, 35, 47 e 49 devem ser apagadas a partir de 1º de janeiro de 2022, data em que os instrumentos nele informados não serão mais aceitáveis para compor o PR.

O Anexo 2 não está sendo demonstrado, devido ao PR da instituição não ser composto pelos itens indicados naquele relatório