

Artigo 4º

Contas	+/-	Descrição	R\$
110.01	+	Patrimônio Líquido	942.677.059,50
110.02	+	Contas de Resultado Credoras	3.449.677.159,72
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	3.500.803.349,94
110.06	-	Reservas de Reavaliação	-
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	1.564.675,00
110.14	-	Ajuste ao Valor de Mercado - TVM e Instrumentos Financeiros Derivativos	34.057.900,55
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	855.928.293,73
110.06	+	Reservas de Reavaliação	-
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	34.057.900,55
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	34.057.900,55
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	855.928.293,73
120	+	Patrimônio de Referência Nível II - PR II	34.057.900,55
130	-	Deduções Do Patrimônio de Referência	-
100	=	Patrimônio de Referência - PR	889.986.194,28

Artigo 5º

Contas	Descrição	Valor da Exposição	Valor da EPR - PRE
510.01	Valores Mantidos em Espécie	198.005,70	-
510.02	Banco Central - Reserva Livre em Espécie	1.565.825,91	-
521.01	Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais	236.526.205,87	-
522.01	Operações Compromissadas - Venda com compromisso de Recompra - Títulos Públicos Federais	4.003.921,96	-
530.01	Títulos Públicos Federais	1.381.260.639,94	-
540.01	Créditos Vinculados - Banco Central	2.063.202,49	-
	Total - Ponderação 0%	1.625.617.801,87	-
510.03	Depósitos Bancários	161.510,69	32.302,14
	Total - Ponderação 20%	161.510,69	32.302,14
	Total - Ponderação 35%	-	-
	Total - Ponderação 50%	-	-
550.10	Operações de Varejo	2.884.797.291,12	2.163.597.968,34
600.03	Compromisso de Crédito com Característica de Varejo	453.951,72	340.463,79
620.06	Coobrigações em Cessões de Créditos	97.258.287,25	72.943.715,44
	Total - Ponderação 75%	2.982.509.530,09	2.236.882.147,57
510.01	Valores Mantidos em Espécie	-	-
526.01	Depósitos Interfinanceiros	2.763.399,68	2.763.399,68
527.01	Aplicações em Moedas Estrangeiras	123.620.906,33	123.620.906,33
530.09	Cotas de Fundo de Investimento	741.375,55	741.375,55
540.05	Outros	9.229.684,90	9.229.684,90

550.11	Demais Operações de Crédito	69.242.991,75	69.242.991,75
560.02	Arrendamento Financeiro	304.575.839,85	304.575.839,85
570.03	Outros Adiantamentos	2.226.927,37	2.226.927,37
570.04	Demais Direitos	190.318.282,20	190.318.282,20
580	Outros Valores e Bens	112.311.030,97	112.311.030,97
590.01	INVESTIMENTOS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	67.120.451,24	67.120.451,24
590.02	Imobilizado de Uso	19.242.934,41	19.242.934,41
590.04	ATIVO PERMANENTE DIFERIDO - EXCETO ÁGIOS PAGOS	6.992.686,39	6.992.686,39
590.06	ATIVOS INTANGÍVEIS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	2.022.412,59	2.022.412,59
590.07	ÁGIOS EM INVESTIMENTOS	298.753.507,82	298.753.507,82
610.02	Adiantamentos sobre Contratos de Câmbio (ACC/ ACE)	56.225.771,72	56.225.771,72
620.02	Prestadas a Instituições Financeiras e Instituições Autorizadas a Funcionar p/ BCB	9.115.007,00	9.115.007,00
620.04	Prestadas a Outras Pessoas Físicas ou Jurídicas	401.671.482,69	401.671.482,69
	Total - Ponderação 100%	1.676.174.692,46	1.676.174.692,46
550.11	Demais Operações de Crédito	-	-
	Total - Ponderação 150%	-	-
550.11	Demais Operações de Crédito	44.727.890,73	134.183.672,19
630	CRÉDITOS TRIBUTÁRIOS	86.236.943,23	111.158.590,57
	Total - Ponderação 300%	130.964.833,96	245.342.262,76
530.07	Derivativos - Valor de Reposição	54.719.809,95	54.719.809,95
530.08	Derivativos - Ganho Potencial Futuro	3.156.626.605,71	85.613.364,19
650.01	Operações a Liquidar de Compra de Moeda Estrangeira no Mercado a Vista	131.422.356,16	3.887.725,06
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	1.564.675,00	(1.564.675,00)
670	ATIVOS DEDUZIDOS DO PR A SEREM DEDUZIDOS DO PEPR	1.564.675,00	(1.564.675,00)
700	Valor da EPR	9.759.761.815,88	4.301.087.629,12
705	Valor da Parcela PEPR antes do Adicional de Fator F		473.119.639,20
710	Valor Correspondente ao Adicional de Fator F Determinado pelo Banco Central do Brasil		-
720	PEPR		473.119.639,20
800	PCAM		29.878.200,00
810	PJUR1		5.009.750,00
820	PJUR2		47.494.417,89
830	PJUR3		526.000,00
840	PJUR4		-
850	PCOM		291.000,00
860	PACS		-
870	POPR		32.616.252,78
880	Adicional BCB		-
900	PRE		588.935.259,87
100	Patrimônio de Referência - PR		889.986.194,28
IB	Índice de Basileia		16,62%
890	RBAN - Montante do PR apurado para cobertura do risco da taxa de juros das operações não classificadas na carteira de negociação		1.592.664,81
IB	Índice de Basileia Amplo (com RBAN) - Inclui Riscos não Abrangidos Pelas Parcelas do PR		16,58%

Descrição	R\$
Valor total das exposições a risco de crédito conforme Circular nº 3.360/07	8.082.022.448,42
Média das exposições a risco de crédito no trimestre	9.000.754.575,64
Montante de provisões para perdas relativas às exposições a risco de crédito	230.447.095,51
Operações baixadas para prejuízo no trimestre	56.032,69

Artigo 7º

Descrição	R\$
Valor Total Mitigado para Operações Compromissadas com Lastro em Títulos Públicos	240.530.127,83

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	15.373.692.329,50
Valores relativos a contratos sem garantia, nos quais não haja a atuação de câmaras de compensação como contraparte central	4.069.333.092,02
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	19.555.336.452,49

Referência

3.0.6.10.40.8 Dados do Balancete 4040 – Futuros BM&F