

2041

Dezembro 2010

Artigo 4º

Contas	+/-	Descrição	R\$
110.01	+	Patrimônio Líquido	1.099.182.256,37
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	-
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	2.312.695,11
110.14	-	Ajuste ao Valor de Mercado - TVM e Instrumentos Financeiros Derivativos	2.711.581,99
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	1.094.157.979,27
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	2.711.581,99
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	2.711.581,99
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	1.094.157.979,27
120	+	Patrimônio de Referência Nível II - PR II	2.711.581,99
130	-	Deduções Do Patrimônio de Referência	-
100	=	Patrimônio de Referência - PR	1.096.869.561,26

2041

Dezembro 2010

Artigo 5º

Contas	Descrição	Valor da Exposição	Valor da EPR - PRE
510.02	Banco Central - Reserva Livre em Espécie	301.445,37	-
521.01	Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais	1.220.279.667,47	-
522.01	Operações Compromissadas - Venda com compromisso de Recompra - Títulos Públicos Federais	131.810.887,24	-
530.01	Títulos Públicos Federais	1.264.896.889,49	-
540.01	Créditos Vinculados - Banco Central	416.633,27	-
	Total - Ponderação 0%	2.617.705.522,84	-
510.03	Depósitos Bancários	29.586.469,25	5.917.293,85
	Total - Ponderação 20%	29.586.469,25	5.917.293,85
	Total - Ponderação 35%	-	-
	Total - Ponderação 50%	-	-
550.10	Operações de Varejo	2.365.773.841,65	1.774.330.381,24
600.03	Compromisso de Crédito com Característica de Varejo	7.769.737,31	5.827.302,98
620.06	Coobrigações em Cessões de Créditos	336.815.402,77	252.611.552,08
	Total - Ponderação 75%	2.710.358.981,73	2.032.769.236,30
510.01	Valores Mantidos em Espécie	815.009,34	815.009,34
526.01	Depósitos Interfinanceiros	17.425.317,91	17.425.317,91
527.01	Aplicações em Moedas Estrangeiras	18.146.448,71	18.146.448,71
530.09	Cotas de Fundo de Investimento	2.354.964,35	2.354.964,35
540.05	Outros	4.945.091,17	4.945.091,17
550.11	Demais Operações de Crédito	499.757.945,51	499.757.945,51
560.02	Arrendamento Financeiro	202.832.723,14	202.832.723,14
570.03	Outros Adiantamentos	1.387.531,85	1.387.531,85
570.04	Demais Direitos	154.417.536,04	154.417.536,04
580	Outros Valores e Bens	74.846.287,47	74.846.287,47
590.01	INVESTIMENTOS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	104.715.068,62	104.715.068,62
590.02	Imobilizado de Uso	17.829.641,87	17.829.641,87
590.04	ATIVO PERMANENTE DIFERIDO - EXCETO ÁGIOS PAGOS	4.204.515,84	4.204.515,84
590.06	ATIVOS INTANGÍVEIS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	4.695.921,70	4.695.921,70
590.07	ÁGIOS EM INVESTIMENTOS	361.410.785,24	361.410.785,24
610.02	Adiantamentos sobre Contratos de Câmbio (ACC/ ACE)	136.929.375,11	136.929.375,11
620.02	Prestadas a Instituições Financeiras e Instituições Autorizadas a Funcionar p/ BCB	19.977.355,31	19.977.355,31
620.04	Prestadas a Outras Pessoas Físicas ou Jurídicas	175.643.314,49	175.643.314,49
	Total - Ponderação 100%	1.802.334.833,67	1.802.334.833,67
630	CRÉDITOS TRIBUTÁRIOS	230.561.351,62	475.361.986,02
	Total - Ponderação 300%	230.561.351,62	475.361.986,02
530.07	Derivativos - Valor de Reposição	155.426.531,29	135.967.200,03
530.08	Derivativos - Ganho Potencial Futuro	4.492.294.607,85	24.592.231,75
650.01	Operações a Liquidar de Compra de Moeda Estrangeira no Mercado a Vista	24.438.028,57	1.114.836,86
670.02	Excesso de Crédito Tributário em Relação ao PR - Nível I a ser Deduzido do PEPR	1.537.146,72	(1.537.146,72)
670.03	Ativo Permanente Diferido Deduzido do PR a ser Deduzido do PEPR	2.312.695,11	(2.312.695,11)

2041

Dezembro 2010

670	ATIVOS DEDUZIDOS DO PR A SEREM DEDUZIDOS DO PEPR	3.849.841,83	(3.849.841,83)
700	Valor da EPR	12.066.556.168,65	4.474.207.776,64
705	Valor da Parcela PEPR antes do Adicional de Fator F		492.162.855,43
710	Valor Correspondente ao Adicional de Fator F Determinado pelo Banco Central do Brasil		-
720	PEPR		492.162.855,43
800	PCAM		49.292.305,83
810	PJUR1		6.002.441,31
820	PJUR2		52.844.563,81
830	PJUR3		123.433,93
840	PJUR4		-
850	PCOM		-
860	PACS		-
870	POPR		56.289.707,13
880	Adicional BCB		-
900	PRE		656.715.307,44
100	Patrimônio de Referência - PR		1.096.869.561,26
IB	Índice de Basileia		18,37
890	RBAN - Montante do PR apurado para cobertura do risco da taxa de juros das operações não classificadas na carteira de negociação		4.145.083,16
IB	Índice de Basileia Amplo (com RBAN) - Inclui Riscos não Abrangidos Pelas Parcelas do PR		18,26%

Artigo 6º

Descrição	R\$
Valor total das exposições a risco de crédito conforme Circular nº 3.360/07	12.062.706.326,82
Média das exposições a risco de crédito no trimestre	11.842.225.415,47
Montante de provisões para perdas relativas às exposições a risco de crédito	151.976.951,25
Operações baixadas para prejuízo no trimestre	36.880.637,07

Artigo 7º

Descrição	R\$
Valor Total Mitigado para Operações Compromissadas com Lastro em Títulos Públicos	1.352.090.554,71

2041

Dezembro 2010

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	16.053.465.112,96
Valores relativos a contratos sem garantia, nos quais não haja a atuação de câmaras de compensação como contraparte central	6.260.923.308,97
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	22.564.878.023,89