

Detalhamento do patrimônio de referência (PR) :

Contas	Descrição	R\$
100	Patrimônio De Referência (PR)	1.280.669.677,93
110	Patrimônio De Referência Nível I (PR_I)	1.280.669.677,93
111	Capital Principal – CP	1.280.669.677,93
111.01	Capital Social	2.956.928.852,20
111.02	Reservas De Capital, Reavaliação e de Lucros	2.125.176,80
111.03	Ganhos Não Realizados de Ajustes de Avaliação Patrimonial Exceto de Hedge de Fluxo de Caixa	9.251.140,44
111.04	Sobras ou Lucros Acumulados	-
111.05	Contas de Resultado Credoras	-
111.06	Depósito Para Suficiência de Capital	-
111.07	Ajustes Positivos ao Valor de Mercado de Derivativos	-
111.08	Outros Instrumentos Elegíveis ao Capital Principal	-
111.90	De Capital Principal Ajustado em Relação ao Capital Social	-
111.90.01	Capital Principal Ajustado I	11.376.317,24
111.91	Deduções do Capital Principal Exceto Ajustes Prudenciais	1.687.532.869,26
111.91.01	Não Realizadas – Avaliação Patrimonial e TVM	-
111.91.02	Ações em Tesouraria e Outros Instrumentos de Emissão Própria	-
111.91.03	Perdas ou Prejuízos Acumulados	1.682.771.772,81
111.91.04	Contas de Resultado Devedoras	-
111.91.05	Ajustes Negativos ao Valor de Mercado de Derivativos	4.761.096,45
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 Cancelamento	-
111.92	Ajustes Prudenciais Exceto Participações Não Consolidadas e Crédito Tributário	102.622,25
111.92.01	Ajuste Prudencial I - Ágios Pagos	-
111.92.02	Ajuste Prudencial II - Ativos Intangíveis	102.622,25
111.92.02.01	A Partir de Outubro de 2013	102.622,25
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	128.077.230,02
111.92.06.01.02.01	PR Nível I Desconsiderados os Ajustes Prudenciais	1.280.772.300,18
111.92.06.02	Valor que Excede a 10% do Nível I	-
111.92.07	Ajuste Prudencial IX - Ativos Diferidos	-
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 Assemelhadas, 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 Intuição 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 Assemelhadas	-
111.93.02	Limite para Investimentos Inferiores em Assemelhadas	128.066.967,79
111.93.02.01	Capital Principal Ajustado II	1.280.669.677,93
111.94	Ajustes Prudenciais V e VII - Créditos Tributários de Diferença Temporária e Investimentos Superiores em Assemelhadas	-
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	128.066.967,79
111.94.01.02.01	Capital Principal Ajustado III	1.280.669.677,93
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	3.895.442,55
111.94.02.01.90	Obrigações Fiscais Diferidas Passíveis de Compensação	115.652.518,67
111.94.02.01.90.01	Total de Obrigações Fiscais Diferidas	115.652.518,67
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	128.066.967,79
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 Assemelhadas 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	192.100.451,69
111.94.05.02	Limite Para Investimentos Superiores em Instituições Financeiras	128.066.967,79

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	12.360,08	-
510.02	Banco Central - Reserva Livre em Espécie	1.305.821,20	-
520.01	Operações Compromissadas - Compra com Compromisso de Revenda	2.917.110.222,92	-
520.02	Operações Compromissadas - Venda com compromisso de Recompra	-	-
521.01	Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais	-	-
522.01	Operações Compromissadas - Venda com compromisso de Recompra - Títulos Públicos Federais	-	-
523.01	Operações Compromissadas - Compra com compromisso de Revenda, conjugado com Venda com compromisso de Recompra (Broqueragem) - Títulos Públicos Federais	-	-
524.01	Operações Compromissadas- Posição Vendida - Compra com compromisso de Revenda - Títulos Públicos Federais	-	-
530.01	Títulos Públicos Federais	-	-
530.20	Títulos e Valores Mobiliários - Diversos	1.061.758.075,58	98.542.018
540.01	Créditos Vinculados - Banco Central	-	-
650.01	Operações a Liquidar de Compra de Moeda Estrangeira no Mercado a Vista	288.316.040,97	-
	Total - Ponderação 0%	4.268.502.520,75	-
510.03	Depósitos Bancários	97.223,96	19.445
	Total - Ponderação 20%	97.224	3.889
	Total - Ponderação 35%	-	-
	Total - Ponderação 50%	-	-
550.10	Operações de Varejo	-	-
550.13	Operações de Crédito - Diversas	344.578.670,18	344.578.670
	Total - Ponderação 75%	344.578.670	258.434.003
530.06	Outros Títulos e Valores Mobiliários	-	-
620.09	Garantias Prestadas - Avais e Fianças	330.746.359,75	330.746.360
	Total - Ponderação 85%	330.746.360	281.134.406
526.01	Depósitos Interfinanceiros	-	-
527.01	Aplicações em Moedas Estrangeiras	1.111,72	1.112
530.09	Cotas de Fundo de Investimento	-	-
530.06	Outros Títulos e Valores Mobiliários	-	-
540.05	Outros	-	-
540.07	Relações Interfinanceiras	432.503,18	345.758
550.11	Demais Operações de Crédito	-	-
550.13	Operações de Crédito - Diversas	344.578.670,18	344.578.670
560.05	Arrendamento Financeiro	813.308.015,04	696.795.911
560.06	Arrendamento Operacional	9.282.405,05	9.282.405
570.03	Outros Adiantamentos	-	-
570.06	Outros direitos com características de operações de crédito	26.891.271,47	26.891.271
570.10	Demais Direitos	435.566.675,49	12.811.197
580	Outros Valores e Bens	3.887.756,52	3.887.757
590.01	INVESTIMENTOS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	-	-
590.02	Imobilizado de Uso	-	-
590.04	ATIVO PERMANENTE DIFERIDO - EXCETO ÁGIOS PAGOS	-	-
590.06	ATIVOS INTANGÍVEIS - EXCETO ÁGIOS PAGOS	-	-
590.07	ÁGIOS EM INVESTIMENTOS	-	-
590.10	Ativo Permanente	47.112.579,73	46.972.573
610.02	Adiantamentos sobre Contratos de Câmbio (ACC/ ACE)	968.269.066,29	886.241.860
620.02	Prestadas a Instituições Financeiras e Instituições Autorizadas a Funcionar p/ BCB	-	-
620.04	Prestadas a Outras Pessoas Físicas ou Jurídicas	-	-
620.06	Coobrigações em Cessões de Créditos	-	-
630.01	Créditos Tributários de Diferença Temporária	3.895.442,55	-
	Total - Ponderação 100%	2.653.225.497	-
550.11	Demais Operações de Crédito	-	-
	Total - Ponderação 150%	-	-
	Total - Ponderação 300%	-	-
530.07	Derivativos - Valor de Reposição	620.619.058,38	620.619.058
530.08	Derivativos - Ganho Potencial Futuro	8.291.078.727,17	174.837.326
650.01	Operações a Liquidar de Compra de Moeda Estrangeira no Mercado a Vista	288.316.040,97	-
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	-	-
670	ATIVOS DEDUZIDOS DO PR A SEREM DEDUZIDOS DO PEPR	-	-
700	Valor da EPR	17.461.037.876,15	3.255.064.027
720	RWACPAD	-	3.255.064.027
800	RWACAM	-	100.181.622
810	RWAJUR1	-	110.000.000
820	RWAJUR2	-	892.172.973
830	RWAJUR3	-	9.513.514
840	RWAJUR4	-	-
850	PCOM	-	-
860	PACS	-	281.081
870	RWAOPAD	-	317.799.633
880	Adicional BCB	-	-
890	RBAN - Montante do PR apurado para cobertura do risco da taxa de juros das operações não classificadas na	-	5.274.717
900	PRE	-	4.685.012.849
100	Patrimônio de Referência - PR	-	1.280.669.678
IB	Índice de Basileia	-	27,34%
IB	Índice de Basileia Amplo (com RBAN) - Inclui Riscos não Abrangidos Pelas Parcelas do PR	-	27,34%

Informações relativas às exposições a riscos de crédito:

Descrição	R\$/1000
Pessoa Física - Consignado	-
Pessoa Física - Outros	5.105
Pessoa Jurídica - Importação e Exportação	968.269
Pessoa Jurídica - Capital de giro	77.734
Pessoa Jurídica - Outros	1.163.006
Valor total das exposições a risco de crédito	2.214.114
Pessoa Física - Consignado	5.892
Pessoa Física - Outros	1.702
Pessoa Jurídica - Importação e Exportação	710.028
Pessoa Jurídica - Capital de giro	59.713
Pessoa Jurídica - Outros	1.119.405
Média das exposições a risco de crédito no trimestre	1.896.740

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

Descrição	R\$/1000	%
10 maiores exposições	1.310.580	59%
100 maiores exposições	2.157.261	97%
Total das Operações de Crédito	2.214.114	
Países e regiões geográficas do Brasil com exposições significativas;	2.214.114	
Centro-Oeste	95.577	
Nordeste	328.697	
Norte	2.445	
Sudeste	1.549.201	
Sul	238.194	
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	1.013.489
Comércio	470.190
Instituições financeiras	29.712
Pessoas físicas	275.229
Habitação	
Outros	197.659
Serviços	369.970
Setor público	
Governo federal	127.989
Total	2.484.238

Prazo a decorrer das operações incluindo , no mínimo:

Descrição	R\$/1000
até 6 meses;	590.506
acima de 6 meses até 1 ano;	887.171
acima de 1 ano até 5 anos; e	735.279
acima de 5 anos.	1.158
Total	2.214.114

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 (R\$/1000):

	Região				
	Centro-Oeste	Nordeste	Norte	Sudeste	Sul
Pessoa Física - Consignado	-	-	-	-	-
Pessoa Física - Outros	-	-	-	5.105	-
Pessoa Jurídica - Importação e Exportação	94.909	326.326	-	547.034	-
Pessoa Jurídica - Capital de giro	-	-	-	77.734	-
Pessoa Jurídica - Outros	668	2.371	2.445	919.328	238.194
Total da Exposição por região	95.577	328.697	2.445	1.549.201	238.194

Faixa de Atraso	Região				
	Centro-Oeste	Nordeste	Norte	Sudeste	Sul
Atraso 15 e 60 dias	10	-	-	1.688	232
Atraso 61 e 90 dias	-	-	-	351	104
Atraso 91 e 180 dias	-	-	-	1.465	73
Atraso 181 e 360 dias	-	290	-	6.648	131
Atraso acima de 360 dias	-	-	-	-	-
Total	10	290	-	10.152	540

Fluxo de operações baixadas para prejuízo no trimestre, segmentado por setor econômico com exposições significativas (R\$/1000)

	abr/17	mai/17	jun/17
Pessoas físicas	135	78	1
Comércio	-	768	-
Inst. financeira	-	2	-
Outros	-	-	-
Setor Público	-	-	-
Serviços	-	-	-
Total baixado para prejuízo	135	848	1

Informação relativa à instrumento mitigador de risco de crédito:

Descrição	R\$/1000
Valor Total Mitigado para Operações Compromissadas com Lastro em Títulos Públicos	-

Informações relativas ao risco de crédito de contraparte:

Descrição	R\$/1000
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	13.226.349
Valores relativos a contratos sem garantia, nos quais não haja a atuação de câmaras de compensação como contraparte central	2.493.174
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	17.461.037

Informações relativas às operações de venda ou transferência de ativos financeiros e às operações com títulos ou valores mobiliários

Descrição	R\$/1000
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 30/06/2017, era:

Banco Cacique

Não foram realizadas cessões de créditos no trimestre findo em 30/06/2017.

II - Exposições cedidas com transferência substancial dos riscos e benefícios

O valor contratual das cessões de crédito realizadas no trimestre findo em 30/06/2017 estava assim representado:

Banco Cacique

O valor contratual das cessões de crédito realizadas no trimestre findo em 30/06/2017 estava assim representado (valores em reais mil):

Modalidade	Contraparte	Data de cessão	Valor presente contábil	Valor da venda
Crédito Pessoal	Securizadora	07/06/2017	116.730	468
Crédito Pessoal	Securizadora	08/06/2017	308.335	1.809

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	5.275
Juros pré	12.941
Cupom dólar	-
Cupom euro	21.670
Demais	10.805

Valor total da carteira de negociação por fator de Risco de Mercado (R\$/1000):

Posição	Exposição Ativa Comprada	Exposição Passiva Vendida
Taxa de Câmbio	4.550.039	(774.216)
Taxa de Juros	6.418.567	(7.779.981)
Preço de Ações	173.599	(173.742)
Preço de Mercadorias	-	-

Valor total da carteira de negociação por fator de Risco de Mercado com e sem contraparte central (R\$/1000):

Com Contraparte Central	Posição	Brasil		Exterior	
		Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
	Taxa de Câmbio	4.550.039	(774.216)	-	-
	Taxa de Juros	5.705.648	(5.216.112)	-	-
	Preço de Ações	-	-	-	-
	Preço de Mercadorias	-	-	-	-

Sem Contraparte Central	Posição	Brasil		Exterior	
		Comprada	Vendida	Comprada	Vendida
	Taxa de Câmbio	-	-	-	-
	Taxa de Juros	712.920	(2.563.869)	-	-
	Preço de Ações	173.599	(173.742)	-	-
	Preço de Mercadorias	-	-	-	-

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	2.956.928	-	-
2	Reservas de lucros	(1.682.772)	-	-
3	Outras receitas e outras reservas	6.616	-	-
4	Instrumentos autorizados a compor o Capital Principal antes da entrada em vigor da Resolução nº 4.192, de 2013	-	-	-
5	Participação de não controladores em subsidiárias integrantes do conglomerado, não dedutível do Capital Principal	-	-	-
6	Capital Principal antes dos ajustes prudenciais	1.280.772	-	-
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 advinhos 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	102	-	-
26.a	Ativos permanentes diferidos	102	-	-
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	102	-	-
29	Capital Principal	1.280.670	-	-

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	-	-	-
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	1.280.670,00	-	-
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 de 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	-	-	-
59	Patrimônio de Referência (Nível I + Nível II)	1.280.670,00	-	-
60	Total de ativos ponderados pelo risco	4.685.013,00	-	-

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

Número da Linha	Índices de Basileia e Adicional de Capital Principal	Valor (R\$ mil)	-	-
61	Índice de Capital Principal (ICP)	27,34%	-	-
62	Índice de Nível I (IN1)	27,34%	-	-
63	Índice de Basileia (IB)	27,34%	-	-
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)	27,34%	-	-
Número da Linha	Mínimos Nacionais	Valor (R\$ mil)	-	-
69	Índice de Capital Principal (ICP), se diferente do estabelecido em Basileia III	-	-	-
70	Índice de Nível I (IN1), se diferente do estabelecido em Basileia III	27,34%	-	-
71	Índice de Basileia (IB), se diferente do estabelecido em Basileia III	27,34%	-	-
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 conglomerado ²
72	Valor agregado das participações inferiores 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	-	-	-
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	3.895,00	-	-
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 conglomerado ²
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 compõem o PR da instituição, conforme art. 28 da Resolução nº 4.192, de 2013 (as linhas 33, 35, 47, 48 e 49 poderão ter valores preenchidos nesta coluna até 31 de dezembro de 2021);
- 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, 8, 9, 12, 15, 18, 19, 21, 22, 23, 24, 25, 34, 48, 83 e 85 poderão ter valores preenchidos nesta coluna até 31 de dezembro de 2017).

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.