



Nº da Linha	Item	Valor (R\$ mil)
Itens contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		
1	Itens Patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários, recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	R\$ 6.320.735
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	-R\$ 23.647
3	Total das exposições contabilizadas no BF	R\$ 6.297.088
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativo:		
4	Valor de reposição em operações com derivativos	R\$ 28.362
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	R\$ -
6	Ajuste relativo à garantia prestada em operações com derivativos	R\$ -
7	Ajuste relativo à margem de garantia diária prestada	R\$ -
8	Derivativos em nome de clientes em que não há obrigatoriedade contratual de reembolso em função de falência ou inadimplemento das entidades responsáveis pelo sistema de liquidação	R\$ -
9	Valor de referência ajustado em derivativos de crédito	R\$ -
10	Ajuste sob o valor de referência ajustado em derivativos de crédito	R\$ -
11	Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativo	R\$ 28.362
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)		
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	R\$ 81.866
13	Ajuste relativo a recompras a liquidar e credores por empréstimo de TVM	R\$ -
14	Valor relativo ao risco de crédito da contraparte	R\$ -
15	Valor relativo ao risco de crédito da contraparte em operações de intermediação	R\$ -
16	Total das exposições relativas a operações compromissadas e de empréstimo de títulos e valores mobiliários (soma das linhas 12 a 15)	R\$ 81.866
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial (BP)		
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	R\$ 464.712
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	-R\$ 347.528
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	R\$ 117.184
Capital e Exposição Total		R\$ 6.524.500
20	Nível I	R\$ 1.033.841
21	Exposição Total	R\$ 6.524.500
Razão de Alavancagem (RA)		
22	Razão de Alavancagem de Basileia II	R\$ 15,85