

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Vale do Rio Pardo RS

II Trimestre de 2018

Em outubro de 2015 entrou em vigor a Circular BACEN 3.748/15, que estabelece a metodologia de cálculo e o formato padrão para divulgação da Razão de Alavancagem, em atendimento às normas recomendadas pelo Comitê de Basileia. O índice é calculado como a razão entre o Capital de Nível I e Exposição Total. A Razão de Alavancagem para a cooperativa Sicredi Vale do Rio Pardo RS foi de 12,96% no II Trimestre de 2018. O modelo comum de divulgação está disposto abaixo:

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial	jun/18	mar/18	dez/17	set/17	jun/17	mar/17	dez/16	set/16	jun/16	mar/16
1 Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	675.180	637.335	617.380	636.977	608.042	580.178	549.639	541.158	520.588	485.882
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	5.612	5.845	3.128	2.776	2.747	2.707	1.946	1.906	1.911	1.479
3 Total das exposições contabilizados no BP	669.568	631.490	614.251	634.200	605.294	577.470	547.693	539.252	518.677	484.402
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos										
4 Valor de reposição em operações com derivativos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5 Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6 Ajuste relativo à garantia prestada em operações com derivativos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7 Ajuste relativo à margem de garantia diária prestada 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8 Valor de referência ajustado em derivativos de crédito	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9 Ajuste sob o valor de referência ajustado em derivativos de crédito	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11 Total das exposições relativas a operações com Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
12 Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
13 Ajuste relativo a recompras a liquidar e credores por empréstimo de TVM	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14 Valor relativo ao risco de crédito da contraparte	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15 Valor relativo ao risco de crédito da contraparte em operações de intermediação	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
16 Total das exposições relativas a operações compromissadas e de empréstimo de títulos e valores mobiliários (soma das linhas 12 a 15)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial										
17 Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	218.107	213.572	212.872	203.113	199.114	197.027	192.892	184.505	153.440	151.199
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(106.051)	(102.376)	(101.058)	(98.300)	(95.915)	(93.253)	(91.028)	(85.654)	(63.971)	(62.703)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	112.056	111.197	111.815	104.813	103.200	103.775	101.865	98.852	89.470	88.496
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	101.326	96.554	98.087	99.415	97.694	93.583	89.331	84.375	83.208	77.932
21 Exposição Total	781.625	742.687	726.067	739.013	708.494	681.246	649.558	638.104	608.147	572.899
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	12,96	13,00	13,51	13,45	13,79	13,74	13,75	13,22	13,68	13,60