

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Serrana RS

III Trimestre de 2019

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 Serrana RS foi de 11,09% no III Trimestre de 2019. O modelo comum de divulgação está disposto abaixo:

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial	set/19	jun/19	mar/19	dez/18	set/18	jun/18	mar/18	dez/17	set/17	jun/17
1 Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	2.296.188	2.150.665	2.109.940	2.050.811	1.957.904	1.829.747	1.819.865	1.795.615	1.790.540	1.630.431
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	9.960	10.315	10.764	10.641	9.359	9.757	10.149	5.460	4.653	4.568
3 Total das exposições contabilizados no BP	2.286.228	2.140.350	2.099.176	2.040.170	1.948.544	1.819.989	1.809.715	1.790.155	1.785.887	1.625.863
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9 Valor de referência ajustado em derivativos de crédito	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10 Ajuste sob o valor de referência ajustado em derivativos de crédito	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11 Total das exposições relativas a operações com instrumentos financeiros derivativos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	1.063.431	995.476	970.766	920.266	857.646	807.029	757.207	668.963	607.458	557.401
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(500.171)	(472.863)	(437.006)	(419.814)	(397.830)	(386.022)	(368.793)	(318.117)	(293.209)	(266.626)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	563.260	522.614	533.760	500.452	459.817	421.007	388.414	350.846	314.249	290.776
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	330.898	312.146	292.097	273.493	263.329	249.302	237.384	230.236	222.987	210.935
21 Exposição Total	2.849.489	2.662.964	2.632.937	2.540.623	2.408.362	2.240.997	2.198.130	2.141.001	2.100.137	1.916.639
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	11,61	11,72	11,09	10,76	10,93	11,12	10,80	10,75	10,62	11,01

