

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Vale do Taquari 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 Taquari RS foi de 17,3% 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	841.648	801.106	796.018	797.554	769.642	725.072	713.433	698.215	663.720	646.822
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	5.768	6.011	3.235	2.873	2.849	2.836	2.045	2.003	2.007	1.549
3 Total das exposições contabilizados no BP	835.880	795.094	792.782	794.680	766.793	722.236	711.388	696.212	661.712	645.273
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	327.026	312.426	308.883	312.241	278.945	220.401	212.660	206.591	205.637	201.224
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(185.564)	(176.746)	(174.578)	(178.933)	(155.138)	(109.865)	(104.723)	(99.019)	(98.158)	(94.163)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	141.463	135.681	134.306	133.309	123.808	110.536	107.938	107.573	107.480	107.062
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	169.036	160.335	159.952	153.583	146.738	146.531	141.964	134.666	127.911	124.684
21 Exposição Total	977.343	930.775	927.088	927.989	890.601	832.772	819.326	803.785	769.192	752.335
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	17,30	17,23	17,25	16,55	16,48	17,60	17,33	16,75	16,63	16,57