

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Celeiro RS/SC
 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 Celeiro RS/SC foi de 17,38% 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	527.806	513.886	514.793	503.687	450.945	451.291	440.283	430.381	369.228	388.374
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	4.954	4.604	2.513	2.239	2.217	2.073	1.491	1.459	1.462	1.127
3 Total das exposições contabilizados no BP	522.851	509.282	512.280	501.447	448.727	449.218	438.791	428.922	367.766	387.246
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	225.674	219.579	204.160	196.719	185.780	186.570	176.408	165.179	134.190	137.114
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(126.671)	(125.670)	(119.147)	(111.549)	(106.346)	(105.589)	(99.363)	(88.804)	(67.085)	(68.376)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	99.004	93.909	85.014	85.171	79.435	80.982	77.045	76.375	67.105	68.738
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	108.094	104.471	101.452	99.169	93.647	89.179	84.374	80.597	75.602	73.416
21 Exposição Total	621.855	603.192	597.294	586.618	528.163	530.200	515.837	505.297	434.872	455.985
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	17,38	17,32	16,99	16,91	17,73	16,82	16,36	15,95	17,39	16,10