

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15

Sicredi Centro Serra RS
III 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 Centro Serra RS foi de 19,79% no III Trimestre de 2018. O modelo comum de divulgação está disposto abaixo:

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial	set/18	jun/18	mar/18	dez/17	set/17	jun/17	mar/17	dez/16	set/16	jun/16
1 Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	796.369	755.581	705.712	698.177	708.197	669.459	651.188	643.984	667.988	638.988
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	4.856	5.063	5.275	2.836	2.533	2.514	2.514	1.823	1.787	1.791
3 Total das exposições contabilizados no BP	791.512	750.517	700.436	695.341	705.664	666.945	648.673	642.160	666.201	637.197
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 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	258.030	264.581	252.722	245.579	245.271	254.968	239.877	234.023	227.956	227.345
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(85.481)	(86.841)	(74.919)	(70.851)	(75.231)	(76.255)	(63.005)	(59.415)	(60.136)	(55.621)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	172.550	177.741	177.804	174.728	170.040	178.713	176.872	174.608	167.820	171.724
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	190.802	186.592	177.286	173.095	170.801	164.977	157.363	151.903	146.840	141.294
21 Exposição Total	964.062	928.259	878.241	870.069	875.705	845.659	825.545	816.768	834.022	808.922
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	19,79	20,10	20,19	19,89	19,50	19,51	19,06	18,60	17,61	17,47