

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15

Sicredi Zona Sul 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 Zona Sul RS foi de 16,02% 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	843.580	803.705	768.516	775.256	764.498	720.408	674.353	653.569	668.973	637.408
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	5.228	5.443	5.660	3.015	2.656	2.612	2.582	1.853	1.811	1.813
3 Total das exposições contabilizados no BP	838.352	798.262	762.855	772.240	761.841	717.795	671.771	651.716	667.162	635.595
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8 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	276.087	263.363	240.945	239.578	231.854	215.729	210.236	206.487	195.979	176.856
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(135.723)	(129.220)	(117.539)	(120.206)	(118.455)	(104.423)	(98.985)	(98.454)	(92.305)	(74.534)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	140.364	134.144	123.407	119.373	113.399	111.307	111.251	108.033	103.675	102.323
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	156.770	152.663	145.922	143.974	138.469	132.157	127.840	123.529	119.101	113.201
21 Exposição Total	978.717	932.406	886.263	891.614	875.241	829.102	783.023	759.749	770.837	737.918
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	16,02	16,37	16,46	16,15	15,82	15,94	16,33	16,26	15,45	15,34