

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Aliança PR/SP
 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 Aliança PR/SP foi de 14,81% 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	695.500	655.182	595.107	576.408	600.982	605.645	561.308	534.472	508.505	510.929
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	4.165	4.315	2.309	2.022	1.981	1.934	1.380	1.345	1.345	1.021
3 Total das exposições contabilizados no BP	691.335	650.866	592.797	574.386	599.000	603.711	559.927	533.127	507.160	509.907
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	389.151	382.641	365.741	357.309	356.787	342.947	315.490	293.690	268.211	257.386
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(166.905)	(164.579)	(163.527)	(162.681)	(166.151)	(158.904)	(138.796)	(126.825)	(108.903)	(102.920)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	222.246	218.062	202.214	194.628	190.637	184.044	176.694	166.865	159.308	154.467
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	135.310	129.056	132.811	128.781	122.601	119.169	115.108	112.490	105.894	102.205
21 Exposição Total	913.582	868.928	795.011	769.015	789.638	787.755	736.622	699.993	666.469	664.375
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	14,81	14,85	16,71	16,75	15,53	15,13	15,63	16,07	15,89	15,38