

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Vale do Cerrado
 IV 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 Cerrado foi de 14,6% no IV Trimestre de 2018. O modelo comum de divulgação está disposto abaixo:

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial	dez/18	set/18	jun/18	mar/18	dez/17	set/17	jun/17	mar/17	dez/16	set/16
1 Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	997.130	979.240	773.013	757.083	679.245	651.621	640.564	599.982	550.642	505.380
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	2.846	2.618	2.724	2.832	1.520	1.335	1.320	1.300	926	902
3 Total das exposições contabilizadas no BP	994.284	976.622	770.288	754.251	677.725	650.285	639.244	598.681	549.716	504.477
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	359.761	340.290	320.440	315.358	296.790	293.517	278.676	270.849	237.800	235.363
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(131.393)	(117.818)	(109.208)	(107.171)	(98.442)	(94.264)	(88.343)	(83.905)	(74.527)	(73.322)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	228.369	222.473	211.232	208.188	198.349	199.253	190.333	186.945	163.273	162.041
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	178.534	166.206	146.151	138.093	130.360	129.864	120.060	114.909	108.169	104.290
21 Exposição Total	1.222.653	1.199.096	981.520	962.439	876.074	849.538	829.577	785.627	712.990	666.519
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	14,60	13,86	14,89	14,35	14,88	15,29	14,47	14,63	15,17	15,65