

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Sudoeste MT/PA
 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 Sudoeste MT/PA foi de 17,49% 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	1.125.578	1.103.954	1.015.794	1.026.595	962.935	906.660	806.091	701.730	640.099	607.199
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	7.467	7.759	4.207	3.710	3.664	3.622	2.593	2.043	2.046	1.585
3 Total das exposições contabilizados no BP	1.118.111	1.096.194	1.011.586	1.022.885	959.271	903.038	803.497	699.687	638.053	605.614
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	517.346	476.076	444.819	414.933	377.963	345.801	318.354	275.461	246.844	227.649
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(239.863)	(224.613)	(212.917)	(194.769)	(177.121)	(158.696)	(146.798)	(122.586)	(105.596)	(93.650)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	277.484	251.464	231.902	220.165	200.843	187.106	171.557	152.875	141.248	134.000
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	244.049	237.545	230.237	216.690	206.072	201.709	191.408	166.733	157.641	147.818
21 Exposição Total	1.395.595	1.347.658	1.243.489	1.243.050	1.160.114	1.090.145	975.054	852.563	779.302	739.614
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	17,49	17,63	18,52	17,43	17,76	18,50	19,63	19,56	20,23	19,99