

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15

Sicredi Araxingu
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 Araxingu foi de 15,78% 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	1.283.541	1.174.176	1.156.007	1.022.936	968.887	1.021.930	1.016.779	812.773	734.131	722.477
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	4.883	5.088	5.301	2.873	2.566	2.558	2.557	1.851	1.815	1.820
3 Total das exposições contabilizados no BP	1.278.658	1.169.087	1.150.706	1.020.063	966.320	1.019.372	1.014.222	810.921	732.315	720.657
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	349.440	338.329	319.639	316.975	301.090	290.340	285.046	261.612	241.216	229.803
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(93.636)	(90.672)	(78.432)	(77.761)	(72.212)	(69.745)	(62.265)	(53.131)	(46.401)	(43.692)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	255.804	247.657	241.208	239.214	228.878	220.595	222.781	208.481	194.815	186.111
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	242.199	232.469	220.189	211.793	205.368	192.997	186.622	176.517	168.640	169.814
21 Exposição Total	1.534.463	1.416.745	1.391.914	1.259.277	1.195.199	1.239.967	1.237.004	1.019.403	927.131	906.769
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	15,78	16,41	15,82	16,82	17,18	15,56	15,09	17,32	18,19	18,73