

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Sul MT

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 Sul MT foi de 15,86% 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	652.111	601.344	587.752	563.652	554.013	526.164	559.558	485.189	502.476	531.507
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	3.184	3.316	3.445	1.862	1.630	1.608	1.586	1.132	1.101	1.095
3 Total das exposições contabilizados no BP	648.927	598.028	584.307	561.790	552.383	524.556	557.971	484.057	501.375	530.412
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	249.692	239.000	227.912	228.068	227.965	221.242	214.845	216.883	201.897	188.628
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(103.045)	(98.831)	(95.877)	(97.503)	(98.622)	(94.684)	(95.416)	(98.104)	(94.916)	(87.769)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	146.648	140.169	132.036	130.566	129.343	126.558	119.430	118.780	106.982	100.860
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	126.200	121.104	119.643	115.602	112.418	109.530	106.809	101.800	94.704	99.363
21 Exposição Total	795.575	738.198	716.343	692.356	681.727	651.115	677.402	602.837	608.357	631.272
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	15,86	16,41	16,70	16,70	16,49	16,82	15,77	16,89	15,57	15,74