

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Ouro Verde MT
 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 Ouro Verde MT foi de 20,94% 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	2.161.151	2.294.944	2.081.601	2.059.912	1.993.489	1.797.719	1.632.481	1.533.730	1.565.770	1.860.086
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	10.235	10.658	5.797	5.155	5.118	5.105	3.684	3.609	3.618	2.802
3 Total das exposições contabilizados no BP	2.150.916	2.284.285	2.075.804	2.054.757	1.988.371	1.792.614	1.628.797	1.530.121	1.562.151	1.857.284
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	757.603	718.209	687.315	625.904	605.919	617.244	580.204	528.008	525.685	538.333
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(282.821)	(268.304)	(256.395)	(241.483)	(227.376)	(207.747)	(180.526)	(166.468)	(149.235)	(147.960)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	474.783	449.905	430.921	384.422	378.544	409.498	399.678	361.541	376.450	390.374
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	549.891	523.047	506.560	483.469	467.283	447.595	430.947	397.064	386.296	373.181
21 Exposição Total	2.625.699	2.734.191	2.506.725	2.439.180	2.366.915	2.202.112	2.028.476	1.891.662	1.938.602	2.247.658
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	20,94	19,13	20,21	19,82	19,74	20,33	21,24	20,99	19,93	16,60