

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Celeiro do 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 Celeiro do MT foi de 16,11% 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 | 1.712.715 | 1.686.486 | 1.482.253 | 1.592.067 | 1.447.641 | 1.523.472 | 1.249.861 | 1.353.427 | 1.198.368 | 1.255.611 |
| 2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I | 6.296 | 6.551 | 3.537 | 3.115 | 3.071 | 3.031 | 2.174 | 2.123 | 2.125 | 2.285 |
| 3 Total das exposições contabilizados no BP | 1.706.419 | 1.679.934 | 1.478.716 | 1.588.951 | 1.444.569 | 1.520.440 | 1.247.687 | 1.351.303 | 1.196.243 | 1.253.326 |
| 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 | 567.005 | 550.759 | 549.803 | 516.945 | 478.759 | 461.107 | 461.275 | 416.420 | 389.747 | 379.488 |
| 18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP | (160.960) | (148.772) | (151.957) | (144.377) | (142.748) | (137.126) | (126.716) | (118.612) | (102.248) | (99.052) |
| 19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial | 406.046 | 401.988 | 397.847 | 372.568 | 336.011 | 323.982 | 334.560 | 297.809 | 287.500 | 280.437 |
| Capital e Exposição Total | | | | | | | | | | |
| 20 Nível I | 340.365 | 328.103 | 314.863 | 307.868 | 294.700 | 284.023 | 267.520 | 253.947 | 245.610 | 226.831 |
| 21 Exposição Total | 2.112.465 | 2.081.922 | 1.876.563 | 1.961.519 | 1.780.581 | 1.844.422 | 1.582.247 | 1.649.113 | 1.483.743 | 1.533.763 |
| Razão de Alavancagem | | | | | | | | | | |
| 22 Razão de Alavancagem de Basileia III | 16,11 | 15,76 | 16,78 | 15,70 | 16,55 | 15,40 | 16,91 | 15,40 | 16,55 | 14,79 |