

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Celeiro do 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 Celeiro do MT foi de 15,45% 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	1.870.575	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
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	6.037	6.296	6.551	3.537	3.115	3.071	3.031	2.174	2.123	2.125
3 Total das exposições contabilizados no BP	1.864.538	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
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	593.874	567.005	550.759	549.803	516.945	478.759	461.107	461.275	416.420	389.747
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(167.822)	(160.960)	(148.772)	(151.957)	(144.377)	(142.748)	(137.126)	(126.716)	(118.612)	(102.248)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	426.052	406.046	401.988	397.847	372.568	336.011	323.982	334.560	297.809	287.500
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	353.879	340.365	328.103	314.863	307.868	294.700	284.023	267.520	253.947	245.610
21 Exposição Total	2.290.591	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
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	15,45	16,11	15,76	16,78	15,70	16,55	15,40	16,91	15,40	16,55