

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15

Sicredi Univales MT/RO
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 Univales MT/RO foi de 26,18% 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	755.040	707.817	700.295	673.114	651.738	643.949	620.082	604.932	618.075	588.666
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	7.886	8.245	8.598	4.721	4.224	4.219	4.241	3.070	3.009	3.017
3 Total das exposições contabilizados no BP	747.153	699.572	691.696	668.393	647.513	639.729	615.841	601.861	615.065	585.648
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8 obrigatoriedade contratual de reembolso em função de falência ou inadimplemento das entidades responsáveis pelo sistema de liquidação	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9 Valor de referência ajustado em derivativos de crédito	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10 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	445.227	411.655	374.242	350.950	337.617	314.404	280.855	260.551	227.854	199.662
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(199.130)	(185.004)	(171.387)	(165.222)	(160.814)	(155.607)	(140.001)	(128.862)	(117.893)	(101.276)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	246.098	226.651	202.855	185.729	176.804	158.798	140.854	131.690	109.962	98.386
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	260.044	251.079	253.928	253.511	248.099	239.249	232.010	224.375	216.927	206.794
21 Exposição Total	993.252	926.224	894.552	854.122	824.318	798.527	756.696	733.552	725.028	684.035
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	26,18	27,11	28,39	29,68	30,10	29,96	30,66	30,59	29,92	30,23