

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Centro-Sul MS
 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 Centro-Sul MS foi de 20,6% 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	1.530.575	1.571.160	1.396.270	1.366.648	1.296.730	1.306.322	1.211.798	1.155.481	1.045.378	1.099.752
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	8.753	9.104	4.934	4.357	4.316	4.252	3.045	2.975	2.979	2.305
3 Total das exposições contabilizados no BP	1.521.822	1.562.056	1.391.336	1.362.290	1.292.413	1.302.070	1.208.753	1.152.505	1.042.399	1.097.447
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	530.030	485.051	470.522	459.526	408.433	372.796	331.113	276.260	239.909	227.429
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(304.019)	(276.213)	(265.318)	(260.671)	(228.686)	(211.791)	(183.378)	(147.680)	(128.497)	(118.955)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	226.011	208.839	205.204	198.856	179.748	161.006	147.736	128.581	111.412	108.474
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	360.126	349.596	327.882	306.123	288.291	271.386	270.550	254.096	240.326	225.182
21 Exposição Total	1.747.834	1.770.895	1.596.541	1.561.146	1.472.161	1.463.076	1.356.489	1.281.086	1.153.811	1.205.921
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	20,60	19,74	20,54	19,61	19,58	18,55	19,94	19,83	20,83	18,67