

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Celeiro Centro Oeste
 IV 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 Centro Oeste foi de 13,78% no IV Trimestre de 2018. O modelo comum de divulgação está disposto abaixo:

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial	dez/18	set/18	jun/18	mar/18	dez/17	set/17	jun/17	mar/17	dez/16	set/16
1 Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	944.901	897.511	727.531	713.356	666.957	645.463	561.804	537.291	466.783	452.856
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	3.517	3.235	3.364	3.495	1.888	1.671	1.652	1.629	1.171	1.129
3 Total das exposições contabilizadas no BP	941.384	894.275	724.166	709.861	665.068	643.791	560.152	535.662	465.611	451.727
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	379.993	359.869	309.129	277.893	259.777	251.309	242.381	227.124	202.187	177.070
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(164.083)	(157.967)	(126.830)	(109.806)	(106.166)	(104.878)	(100.050)	(90.790)	(75.917)	(67.235)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	215.911	201.902	182.300	168.087	153.611	146.431	142.331	136.335	126.270	109.835
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	159.422	146.616	136.774	132.223	124.923	117.612	106.355	100.854	94.114	85.345
21 Exposição Total	1.157.295	1.096.178	906.466	877.949	818.680	790.223	702.483	671.998	591.882	561.563
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	13,78	13,38	15,09	15,06	15,26	14,88	15,14	15,01	15,90	15,20