

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Cerrado GO
 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 Cerrado GO foi de 14,62% 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	274.536	270.604	244.470	209.001	191.017	176.768	145.515	145.818	110.907	117.166
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	1.486	1.539	815	638	626	611	435	424	423	323
3 Total das exposições contabilizados no BP	273.050	269.065	243.654	208.362	190.390	176.157	145.079	145.393	110.483	116.842
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	135.176	123.196	116.537	92.928	86.240	79.844	68.853	64.072	42.142	37.272
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(73.342)	(68.080)	(64.802)	(48.412)	(47.669)	(44.469)	(38.439)	(36.398)	(21.536)	(17.223)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	61.834	55.116	51.736	44.517	38.572	35.375	30.415	27.674	20.607	20.049
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	48.976	45.648	42.722	35.481	32.443	31.360	27.599	23.963	21.255	20.108
21 Exposição Total	334.884	324.182	295.390	252.880	228.962	211.533	175.495	173.068	131.091	136.892
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	14,62	14,08	14,46	14,03	14,17	14,83	15,73	13,85	16,21	14,69