

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15

Sicredi Cerrado GO
III Trimestre de 2019

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 12,32% no III Trimestre de 2019. O modelo comum de divulgação está disposto abaixo:

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial	set/19	jun/19	mar/19	dez/18	set/18	jun/18	mar/18	dez/17	set/17	jun/17
1 Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	497.218	460.723	422.871	381.589	336.897	274.536	270.604	244.470	209.001	191.017
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	1.570	1.603	1.657	1.601	1.434	1.486	1.539	815	638	626
3 Total das exposições contabilizados no BP	495.648	459.120	421.213	379.988	335.462	273.050	269.065	243.654	208.362	190.390
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 instrumentos financeiros derivativos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	0	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	229.364	217.082	210.084	201.252	173.046	135.176	123.196	116.537	92.928	86.240
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(135.735)	(131.077)	(122.458)	(116.253)	(97.424)	(73.342)	(68.080)	(64.802)	(48.412)	(47.669)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	93.629	86.006	87.626	84.999	75.622	61.834	55.116	51.736	44.517	38.572
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	75.862	68.446	62.699	57.362	52.829	48.976	45.648	42.722	35.481	32.443
21 Exposição Total	589.277	545.126	508.840	464.988	411.085	334.884	324.182	295.390	252.880	228.962
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	12,87	12,56	12,32	12,34	12,85	14,62	14,08	14,46	14,03	14,17

