

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Central Sicredi Norte/Nordeste
 III Trimestre de 2017

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 Central Sicredi Norte/Nordeste foi de 6,97% no III Trimestre de 2017. O modelo comum de divulgação está disposto abaixo:

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial		set/17	jun/17	mar/17	dez/16	set/16	jun/16	mar/16	dez/15
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	2.154.545	1.682.540	1.491.797	1.195.541	1.009.071	840.564	885.146	819.471
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	405	336	374	318	347	451	445	324
3	Total das exposições contabilizadas no BP	2.154.140	1.682.204	1.491.423	1.195.223	1.008.724	840.113	884.701	819.147
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos									
4	Valor de reposição em operações com derivativos	150	755	222	204	376	546	184	213
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	1.855	2.275	1.386	836	2.171	2.630	7	213
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	2.005	3.030	1.608	1.040	2.547	3.176	191	426
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)									
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	8	8	18	29	26	997	1.222	1.078
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)	8	8	18	29	26	997	1.222	1.078
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial									
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	17.240	17.240	-	-	-	-	-	-
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	-	-	-	-	-	-	-	-
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	17.240	17.240	-	-	-	-	-	-
Capital e Exposição Total									
20	Nível I	151.527	149.564	149.394	132.666	132.412	130.816	118.335	116.085
21	Exposição Total	2.173.393	1.702.482	1.493.049	1.196.292	1.011.297	844.286	886.114	820.651
Razão de Alavancagem									
22	Razão de Alavancagem de Basileia III	6,97	8,79	10,01	11,09	13,09	15,49	13,35	14,15