

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Central Sicredi Norte/Nordeste

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 Central Sicredi Norte/Nordeste foi de 6,78% 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	2.677.284	2.670.299	2.787.029	2.781.451	2.585.298	1.076.815	1.159.637	995.071	2.154.545	1.682.540
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	17	22	342	409	469	540	598	541	405	336
3 Total das exposições contabilizados no BP	2.677.266	2.670.276	2.786.686	2.781.041	2.584.829	1.076.275	1.159.039	994.530	2.154.140	1.682.204
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos										
4 Valor de reposição em operações com derivativos	-	-	-	-	38	39	53	41	150	755
5 Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	-	-	-	-	97	14	102	552	1.855	2.275
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	-	-	-	-	135	53	155	593	2.005	3.030
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)										
12 Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	-	-	-	-	-	-	-	9	8	8
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)	-	-	-	-	-	-	-	9	8	8
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial										
17 Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	-	2.189	2.189	2.189	7.298	7.298	13.890	17.240	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	-	2.189	2.189	2.189	7.298	7.298	13.890	17.240	17.240	17.240
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	181.641	176.584	166.734	164.977	157.754	158.068	167.673	152.548	151.527	149.564
21 Exposição Total	2.677.266	2.672.465	2.788.876	2.783.231	2.592.262	1.083.626	1.173.084	1.012.372	2.173.393	1.072.482
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	6,78	6,61	5,98	5,93	6,09	14,59	14,29	15,07	6,97	13,95

