

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15

Sicredi Campos Gerais PR/SP
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 Campos Gerais PR/SP foi de 12,84% 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	2.420.478	1.881.107	1.720.577	1.976.896	1.904.213	1.301.608	1.545.251	1.667.100	1.515.487	1.216.735
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	6.523	6.689	6.936	6.730	6.057	6.292	6.528	3.475	3.035	2.980
3 Total das exposições contabilizados no BP	2.413.955	1.874.418	1.713.641	1.970.165	1.898.155	1.295.316	1.538.723	1.663.625	1.512.451	1.213.755
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	720.455	634.813	590.444	564.292	529.869	497.560	462.383	432.937	409.584	380.902
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(464.262)	(402.422)	(346.240)	(330.247)	(316.933)	(300.344)	(273.269)	(261.960)	(247.355)	(241.504)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	256.194	232.392	244.205	234.045	212.936	197.216	189.115	170.977	162.230	139.399
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	274.128	263.658	251.420	235.802	225.523	215.306	198.265	186.453	175.121	165.302
21 Exposição Total	2.670.149	2.106.810	1.957.846	2.204.211	2.111.092	1.492.532	1.727.838	1.834.603	1.674.682	1.353.154
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	10,27	12,51	12,84	10,70	10,68	14,43	11,47	10,16	10,46	12,22

