

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Ouro Verde MT
 II 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 Ouro Verde MT foi de 18,6% no II Trimestre de 2019. O modelo comum de divulgação está disposto abaixo:

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial	jun/19	mar/19	dez/18	set/18	jun/18	mar/18	dez/17	set/17	jun/17	mar/17	dez/16
1 Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	2.621.070	2.735.409	2.321.077	2.341.887	2.161.151	2.294.944	2.081.601	2.059.912	1.993.489	1.797.719	27.610.346
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	10.272	10.714	10.592	9.812	10.235	10.658	5.797	5.155	5.118	5.105	43.336
3 Total das exposições contabilizados no BP	2.610.798	2.724.694	2.310.485	2.332.074	2.150.916	2.284.285	2.075.804	2.054.757	1.988.371	1.792.614	27.567.010
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos											
4 Valor de reposição em operações com derivativos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	648
5 Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	276
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)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	924
12 Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12.726.245
13 Ajuste relativo a recompras a liquidar e credores por empréstimo de TVM	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
14 Valor relativo ao risco de crédito da contraparte	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	79.991
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)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12.806.236
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial											
17 Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	852.544	851.534	840.599	784.757	757.603	718.209	687.315	625.904	605.919	617.244	296.372
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(335.376)	(302.667)	(297.823)	(291.976)	(282.821)	(268.304)	(256.395)	(241.483)	(227.376)	(207.747)	(120.440)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	517.168	548.867	542.777	492.781	474.783	449.905	430.921	384.422	378.544	409.498	175.932
Capital e Exposição Total											
20 Nível I	614.369	608.725	578.596	572.757	549.891	523.047	506.560	483.469	467.283	447.595	1.354.341
21 Exposição Total	3.127.966	3.273.562	2.853.262	2.824.855	2.625.699	2.734.191	2.506.725	2.439.180	2.366.915	2.202.112	40.550.104
Razão de Alavancagem											
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	19,64	18,60	20,28	20,28	20,94	19,13	20,21	19,82	19,74	20,33	3,34

