

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Sudoeste MT/PA
 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 Sudoeste MT/PA foi de 17,17% 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	1.750.092	1.489.616	1.434.760	1.340.845	1.275.467	1.125.578	1.103.954	1.015.794	1.026.595	962.935
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	8.189	7.614	7.924	7.776	7.170	7.467	7.759	4.207	3.710	3.664
3 Total das exposições contabilizados no BP	1.741.902	1.482.001	1.426.836	1.333.069	1.268.296	1.118.111	1.096.194	1.011.586	1.022.885	959.271
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	693.154	600.952	583.817	555.562	542.982	517.346	476.076	444.819	414.933	377.963
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(331.113)	(298.726)	(265.744)	(248.249)	(249.875)	(239.863)	(224.613)	(212.917)	(194.769)	(177.121)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	362.042	302.226	318.074	307.313	293.108	277.484	251.464	231.902	220.165	200.843
Capital e Exposição Total										
20 Nível I	344.001	307.468	299.619	279.012	263.383	244.049	237.545	230.237	216.690	206.072
21 Exposição Total	2.103.945	1.784.228	1.744.910	1.640.383	1.561.405	1.395.595	1.347.658	1.243.489	1.243.050	1.160.114
Razão de Alavancagem										
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	16,35	17,23	17,17	17,01	16,87	17,49	17,63	18,52	17,43	17,76

