

Anexo II - Circular BACEN 3.748/15
Sicredi Vale do Jaguarí RS
 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 Vale do Jaguarí RS foi de 28,44% 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	615.539	585.514	571.918	570.038	543.087	524.644	511.551	516.776	498.643	482.314	27.610.346
2 Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	5.023	5.287	5.368	5.252	5.505	5.761	1.922	1.526	1.516	1.522	43.336
3 Total das exposições contabilizados no BP	610.515	580.226	566.549	564.785	537.582	518.882	509.629	515.249	497.126	480.792	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	208.778	205.425	199.983	183.670	176.475	167.119	166.302	160.673	148.742	144.670	296.372
18 Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	(115.241)	(104.919)	(105.545)	(94.225)	(93.022)	(86.815)	(85.537)	(84.368)	(78.531)	(77.686)	(120.440)
19 Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	93.537	100.506	94.439	89.446	83.453	80.304	80.766	76.305	70.211	66.985	175.932
Capital e Exposição Total											
20 Nível I	200.005	193.598	188.852	184.828	179.545	170.676	169.039	166.228	159.339	150.980	1.354.341
21 Exposição Total	704.053	680.733	660.988	654.232	621.036	599.187	590.396	591.555	567.338	547.777	40.550.104
Razão de Alavancagem											
22 Razão de Alavancagem de Basileia III	28,41	28,44	28,57	28,25	28,91	28,48	28,63	28,10	28,09	27,56	3,34

