



Anexo II - Circular BACEN 3.748/15

Central Sicredi Norte/Nordeste
I Trimestre de 2017

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 10,01% no I Trimestre de 2017. O modelo comum de divulgação está disposto abaixo:

Itens contabilizados no Balanço Patrimonial		mar/17	dez/16	set/16	jun/16	mar/16	dez/15
1	Itens patrimoniais, exceto instrumentos financeiros derivativos, títulos e valores mobiliários recebidos por empréstimo e revenda a liquidar em operações compromissadas	1.491.797	1.195.541	1.009.071	840.564	885.146	819.471
2	Ajustes relativos aos elementos patrimoniais deduzidos na apuração do Nível I	374	318	347	451	445	324
3	Total das exposições contabilizados no BP	1.491.423	1.195.223	1.008.723	840.114	884.701	819.147
Operações com Instrumentos Financeiros Derivativos							
4	Valor de reposição em operações com derivativos	222	204	376	546	184	213
5	Ganho potencial futuro decorrente de operações com derivativos	1.386	836	2.171	2.630	7	213
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	1.608	1.040	2.547	3.177	191	427
Operações Compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários (TVM)							
12	Aplicações em operações compromissadas e de empréstimo de TVM	18	29	26	997	1.222	1.078
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)	18	29	26	997	1.222	1.078
Itens não contabilizados no Balanço Patrimonial							
17	Valor de referência das operações não contabilizadas no BP	-	-	-	-	-	-
18	Ajuste relativo à aplicação de FCC específico às operações não contabilizadas no BP	-	-	-	-	-	-
19	Total das exposições não contabilizadas no Balanço Patrimonial	-	-	-	-	-	-
Capital e Exposição Total							
20	Nível I	149.394	132.666	132.412	130.816	118.335	116.085
21	Exposição Total	1.493.049	1.196.293	1.011.297	844.288	886.114	820.653
Razão de Alavancagem							
22	Razão de Alavancagem de Basileia III	10,01	11,09	13,09	15,49	13,35	14,15