

Anexo 1-0 Bis

REVELACIÓN DE LA INFORMACIÓN RELATIVA ALA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

I.- Integración de las principales fuentes de apalancamiento

II.- comparativo entre el activo total y los Activos Ajustados

III. - Conciliación entre el activo total y la exposición dentro del balance

IV. Análisis de las variaciones mas impotantes de los elementos (numerador y denominador) de la Razón de Apalancamiento.

I. Integracion de las principales fuentes de apalancamiento

Las instituciones deberan revelar la integracion de las principales fuentes de apalancamiento, conforme a la Tabla I.1

oct/2024

oct-24

(Cifras en millones de pesos)

Tabla I.1

Referencia	RUBRO	IMPORTE
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y prestamos de valores -SFT por su siglas en ingles- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	242,143
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	- 948
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las lineas 1 y 2)	241,195
	Exposiciones a instrumentos financieros derivados	
4	Costo anual de reemplazo asociado a todas las operaciones con intrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	204
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados.	41
6	Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo	-
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	-
8	(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivdos por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)	-
9	Importe nominal efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos	-
10	(Compensaciones realizadas al nominal efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)	-
11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las lineas 4 a 10)	245
	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las lineas 4 a 10)	
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	1,827
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	-
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	1,877
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las lineas 12 a 15)	3,704
	Capital y exposiciones totales	
17	Exposición fuera de balance (importe nominal bruto)	14,053
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	- 13,431
19	Partidas fuera de balance (suma de las lieas 17 y 18)	622
	Capital y exposiciones totales	
20	Capital de Nivel 1	8,748
21	Exposiciones totales (suma de las lineas 3, 11, 16 y 19)	245,766
	Coefficiente de apalancamiento	
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	<b>3.56%</b>

TABLA II.1

Referencia	RUBRO	IMPORTE
1	Activos totales	279,327
2	Ajuste por inversiones en el capital de entidades bancarias, financieras, aseguradoras o comerciales que se consolidan a efectos contables, pero quedan fuera del ámbito de consolidación regulatoria	- 492
3	Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento	-
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	14
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	- 33,249
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	622
7	Otros ajustes	- 455
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	245,766

TABLA III.1

Referencia	RUBRO	IMPORTE
1	Activos totales	279,327.42
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	- 231.86
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	- 36,953.00
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento	-
5	Exposiciones dentro del Balance	242,143

CONCEPTO/TRIMESTRE	T-1	T	VARIACION (%)
Capital Básico 1/	8,541	8,748	2.4%
Activos Ajustados 2/	252,039	245,766	-2.5%
Razón de Apalancamiento 3/	3.39%	3.56%	5.05%