

Anexo 1-0 Bis

REVELACIÓN DE LA INFORMACIÓN RELATIVA A LA 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 importantes de los elementos (numerador y denominador) de la Razón de Apalancamiento.

I. Integración de las principales fuentes de apalancamiento

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

jul/2024

jul/2024

(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)	253,157
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	- 925
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	252,232
	Exposiciones a instrumentos financieros derivados	
4	Costo anual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	191
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados.	31
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 derivados 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 nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos	-
10	(Compensaciones realizadas al nocional 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 líneas 4 a 10)	222.46
	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)	
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	0
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	-
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	1,837
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	1,837
	Capital y exposiciones totales	
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	14,703
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	- 14,118
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	585
	Capital y exposiciones totales	
20	Capital de Nivel 1	8,347
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	254,876
	Coefficiente de apalancamiento	
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	3.27%

TABLA II.1

Referencia	RUBRO	IMPORTE
1	Activos totales	296,126
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	- 480
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	- 146
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	- 40,764
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	585
7	Otros ajustes	- 445
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	254,876

TABLA III.1

Referencia	RUBRO	IMPORTE
1	Activos totales	296,126
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	- 368.50
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	- 42,601.00
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	253,157

CONCEPTO/TRIMESTRE	T-1	T	VARIACION (%)
Capital Básico 1/	8,332	8,347	0.18%
Activos Ajustados 2/	251,773	254,876	1.23%
Razón de Apalancamiento 3/	3.31%	3.27%	-1.04%