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 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

ago-26

(Cifras en millones de pesos)

Tabla I.1 ago-26

REFERENCIA	RUBRO	IMPORTE
	Exposiciones dentro del balance	
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por su siglas en ingles- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	69,596
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el Capital Básico)	- 108
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	69,488
	Exposiciones a instrumentos financieros derivados	
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con intrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	-
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados.	-
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)	-
	Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores	
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	-
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	-
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	0
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)	0
	Otras exposiciones fuera de balance	
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	-
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	-
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	-
	Capital y exposiciones totales	
20	Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones	1,145
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	69,488
	Razón de apalancamiento	
22	Razón de apalancamiento	**1.65%**

TABLA II.1

REFERENCIA	DESCRIPCION	IMPORTE
1	Activos totales	70,654
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	-
3	Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición de la razón de apalancamiento	-
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	- 0
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	- 1,057
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	-
7	Otros ajustes	- 108
8	Exposición de la razón de apalancamiento	69,488

TABLA III.1

REFERENCIA	CONCEPTO	IMPORTE
1	Activos totales	70,653.62
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	- 0.35
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	- 1,057.10
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición de la razón de apalancamiento	-
5	Exposiciones dentro del Balance	69,596

TABLA IV.1

PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS

(NUMERADOR Y DENOMINADOR) DE LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

CONCEPTO/TRIMESTRE	T-1	T	VARIACION (%)
Capital Básico 1/	1,136	1,145	0.8%
Activos Ajustados 2/	70,855	69,488	-1.9%
Razón de Apalancamiento 3/	1.60%	1.65%	2.81%

1/ Reportado en la fila 20, 2/ Reportado en la fila 21 y 3/ Reportado en la fila 22, de la Tabla I.1