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

nov-25

(Cifras en millones de pesos)

Tabla I.1

Referencia	RUBRO	nov-25 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)	61,248
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	- 128
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las lineas 1 y 2)	61,120
	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)	3
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 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 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 lineas 4 a 10)	3
	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	-
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	-
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	27
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)	27
	Capital y exposiciones totales	
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	27
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	-
19	Partidas fuera de balance (suma de las lieas 17 y 18)	27
	Capital y exposiciones totales	
20	Capital de Nivel 1	1,079
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	61,178
	Coeficiente de apalancamiento	
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	**1.76%**

TABLA II.1

Referencia	RUBRO	IMPORTE
1	Activos totales	62,475
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 del coeficiente de apalancamiento	-
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	- 1
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	- 1,195
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	27
7	Otros ajustes	- 128
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	61,178

TABLA III.1

Referencia	RUBRO	IMPORTE
1	Activos totales	62,475.11
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	- 4.64
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	- 1,222.20
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	61,248

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/	1,069	1,079	0.9%
Activos Ajustados 2/	58,203	61,178	5.1%
Razón de Apalancamiento 3/	1.84%	1.76%	-4.04%

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