

Anexo 1-O Bis

Revelación de información relativa a la razón del apalancamiento al 30 de Abril de 2019

TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO		
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 sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	22,509
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	-1,086
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	21,423
Exposiciones a instrumentos financieros derivados		
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	8
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	0
6	Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales aportados sean dados de baja conforme al marco contable operativo	0
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	-8
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)	0
9	Importe notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos	0
10	(Compensaciones realizadas al notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)	0
11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)	0
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	4,000
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	0
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	0
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	0
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	4,000
Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	569
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	0
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	569
Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	1,897
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	25,992
Coefficiente de apalancamiento		
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	7.30%

TABLA II.1

COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA	DESCRIPCION	IMPORTE
1	Activos totales	22,509
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	0
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	0
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	0
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	4,000
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	569
7	Otros ajustes	-1,086
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	25,992

TABLA III.1

CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIA	DESCRIPCION	IMPORTE
1	Activos totales	22,509
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	0
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	0
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento	0
5	Exposiciones dentro del Balance	22,509

TABLA IV.1

PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS (NUMERADOR Y DENOMINADOR) DE LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

REFERENCIA	CONCEPTO/TRIMESTRE	mar-19	abr-19	VARIACION (%)
1	Capital Básico ^{1/}	1,896	1,897	0.05%
2	Activos Ajustados ^{2/}	27,739	25,992	-6.30%
3	Razón de Apalancamiento ^{3/}	6.84%	7.30%	6.78%

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

* Basado en el diario oficial del 22 de Junio de 2016