

Anexo 1-0 Bis

Revelación de información relativa a la razón de apalancamiento

TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO		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		43,356.00
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el Capital Básico)		(300.91)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT suma de las líneas 1 y 2)		43,055.09
Exposiciones a instrumentos financieros derivados			
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación efectivo admisible)		1,708.93
5	Importes de los factores adicionales por exposición potenciales futuros asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados		730.20
6	Incremento por colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales seandados de baja del balance conforme al marco contable operativo		0.00
7	Deducción a las cuentas por cobrar por margen de variación efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados		0.00
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)		0.00
9	Impone notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos		0.00
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)		0.00
11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)		2,439.13
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación) después de ajustes por transacciones contables por ventas		7,500.00
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)		0.00
14	Exposición riesgo de Contraparte por SFT		27.28
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros		0.00
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)		7,527.28
Otras exposiciones fuera del balance			
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)		1,243.30
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)		0.00
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)		1,243.30
Capital y exposiciones totales			
20	Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones		4,173.92
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 311 a 6 y 19)		54,264.80
Coeficiente de apalancamiento			
22	Razón de apalancamiento		7.69%

TABLA II.1

COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA	DESCRIPCIÓN	IMPORTE
1	Activos totales	46,577.52
2	Ajuste por inversiones en el capital de entidades bancarias financieras aseguradoras o comerciales que se consolidan efectos contables pero quedan fuera del ámbito de consolidación regulatoria	(65.12)
3	Ajuste a la base de activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable pero excluidos de la medida de la exposición de la razón de apalancamiento	0.00
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	717.61
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	6,027.28
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	1,243.30
7	Otros ajustes	(235.79)
8	Exposición de la razón de apalancamiento	54,264.80

TABLA III.1

CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIA	DESCRIPCIÓN	IMPORTE
1	Activos totales	46,577.52
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(1,721.52)
3	Operaciones en reporto y préstamos de valores	(1,500.00)
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable pero excluidos de la medida de la exposición de la razón de apalancamiento	0.00
5	Exposiciones dentro del Balance	43,356.00

TABLA IV.1

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

REFERENCIA	CONCEPTO/TRIMESTRE	feb-22	mar-22	VARIACIÓN (%)
1	Capital Básico ^{1/}	3,992.22	4,173.92	4.59%
2	Activos Ajustados ^{2/}	48,042.82	54,264.80	12.95%
3	Razón de Apalancamiento ^{3/}	8.31%	7.69%	-7.44%

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 2018