

CONCEPTO/TRIMESTRE	oct-20
Capital Básico	110
Activos Ajustados	113
Razón de Apalancamiento	97.74%

Cifras en millones de pesos

I. Integración de las principales fuentes de apalancamiento

Cifras en millones de pesos

TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

REFERENCIA	RUBRO	oct-20
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)	6
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	0
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	6
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)	0
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 sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo	N.A.
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	0
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)	N.A.
9	Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos	N.A.
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)	N.A.
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	107
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)	107
Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	0
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	0
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	0
Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	110
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	113
Coefficiente de apalancamiento		
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	97.74%

II. Comparativo entre el activo total y los activos ajustados

Cifras en millones de pesos

TABLA II.1

COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA	DESCRIPCION	
1	Activos totales	113

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	N.A.
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	0
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores[1]	0
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	0
7	Otros ajustes	0
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	113

III. Conciliación entre activo total y la exposición dentro del balance

Cifras en millones de pesos

TABLA III.1

CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIA	CONCEPTO	
1	Activos totales	113
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	0
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	-107
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento	N.A.
5	Exposiciones dentro del Balance	6

IV. Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos (numerador y denominador) de la Razón de Apalancamiento.

Cifras en millones de pesos

TABLA IV.1

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

CONCEPTO/TRIMESTRE	
Capital Básico 1/	110
Activos Ajustados 2/	113
Razón de Apalancamiento 3/	97.74%