

ANEXO 1-O BIS
Tercer Trimestre de 2017

REVELACIÓN DE INFORMACIÓN RELATIVA A LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

I. Integración de las principales fuentes de apalancamiento.

TABLA I.1 FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO (Cifras en millones de pesos)		
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)	4,879.33
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	-59.34
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	4,819.995
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)	0.69
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	0.00
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	No aplica
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en 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)	No aplica
9	Importe notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos	No aplica
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)	No aplica
11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)	0.69
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	
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)	0.00
Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	92.08
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	92.08
Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	611.01
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	4912.77
Coefficiente de apalancamiento		
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	12.44%

II. Comparativo entre el activo total y los Activos Ajustados.

REFERENCIA	RUBRO	IMPORTE
1	Activos totales	4,880.03
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	-9.98
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	No aplica
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	0.00
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores ⁴	0.00
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	92.08
7	7 Otros ajustes	-49.36
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	4,912.77

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

**TABLA III.1
CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE
(Cifras en millones de pesos)**

REFERENCIA	CONCEPTO	IMPORTE
1	Activos totales	4,880.03
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	-0.69
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	0.00
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento	No aplica
5	Exposiciones dentro del Balance	4,879.33

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

TABLA IV.1
PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS
(NUMERADOR Y DENOMINADOR) DE LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO
(Cifras en millones de pesos)

CONCEPTO/TRIMESTRE	T-1	T	VARIACION (%)
Capital Básico 1/	611.009	612.345	0%
Activos Ajustados 2/	4,912.769	5,343.039	-8%
Razón de Apalancamiento 3/	12.44%	11.46%	9%

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