

Anexo 1-O Bis: Revelación de Información
Relativa a la Razón de Apalancamiento
(Julio 2023)

Administración Integral de Riesgos

Tabla I.1 - Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos (numerador y denominador) de la razón de apalancamiento

| CONCEPTO/MES | Junio 2023 | Julio 2023 | VARIACION (%) |
|--------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| Capital Básico | 1,614 | 1,622 | 0.5% |
| Activos Ajustados | 4,949 | 4,808 | -2.8% |
| Razón de Apalancamiento | 32.62% | 33.74% | 3.4% |

Nota: cifras en millones de pesos

Tabla II.1 - Formato estandarizado para la razón de apalancamiento

| REFERENCIA | RUBRO | IMPORTE (millones de pesos) |
|---|--|-----------------------------|
| 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. | 4,846 |
| 2 | (Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) | -38 |
| 3 | Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) | 4,808 |
| 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) | - |
| 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 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) | - |
| 9 | Importe notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos | - |
| 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) | - |
| 11 | Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10) | - |
| 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) | - |

| Otras exposiciones fuera de balance | | |
|-------------------------------------|---|--------|
| 17 | Exposición fuera de balance (importe nocional bruto) | - |
| 18 | (Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) | - |
| 19 | Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) | - |
| Capital y exposiciones totales | | |
| 20 | Capital de Nivel 1 | 1,622 |
| 21 | Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) | 4,808 |
| Coeficiente de apalancamiento | | |
| 22 | Coeficiente de apalancamiento de Basilea III | 33.74% |

Tabla II.2 - Comparativo de los activos totales y los activos ajustados

| REFERENCIA | DESCRIPCION | IMPORTE (millones de pesos) |
|------------|---|--------------------------------|
| 1 | Activos totales | 4,846 |
| 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 | - |
| 5 | Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores | - |
| 6 | Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden | - |
| 7 | Otros ajustes | -38 |
| 8 | Exposición del coeficiente de apalancamiento | 4,808 |

Tabla II.3 - Conciliación entre activo total y la exposición dentro del balance

| REFERENCIA | CONCEPTO | IMPORTE (millones de pesos) |
|------------|--|--------------------------------|
| 1 | Activos totales | 4,846 |
| 2 | Operaciones en instrumentos financieros derivados | - |
| 3 | Operaciones en reporto y prestamos de valores | - |
| 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 | 4,846 |