Kapital

Anexo 1-O Bis

Revelación de información relativa a la razón del apalancamiento

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 prestamo de valores (SFT por sus siglas en ingles) pero incluidos los colaterales recibidos en garantia y registrados en el balance)	91,793.86
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el Capital Basico)	(779.79)
3	**Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT suma de las lineas 1 y 2)**	**91,014.08**
	Exposiciones a instrumentos financieros derivados	
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variacion en efectivo admisible)	306.14
5	Importes de los factores adicionales por exposicion potencial futura asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	267.16
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	0.00
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variacion en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	0.00
8	(Exposicion por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes en las que el socio liquidador no otorga su garantia en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)	0.00
9	Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de credito suscritos	0.00
10	(Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de credito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de credito suscritos)	0.00
11	**Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las lineas 4 a 10)**	**573.30**
	Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores	
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensacion) despues de ajustes por transacciones contables por ventas	3,072.50
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	0.00
14	Exposicion Riesgo de Contraparte por SFT	0.06
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	0.00
16	**Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las lineas 12 a 15)**	**3,072.56**
	Otras exposiciones fuera del balance	
17	Exposicion fuera de balance (importe nocional bruto)	4,120.82
18	(Ajustes por conversion a equivalentes crediticios)	0.00
19	**Partidas fuera de balance (suma de las lineas 17 y 18)**	**4,120.82**
	Capital y exposiciones totales	
20	Capital Basico calculado conforme al articulo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones	6,384.02
21	Exposiciones totales (suma de las lineas 3 11 16 y 19)	98,780.76
	Coeficiente de apalancamiento	
22	**Razon de apalancamiento**	**6.46%**

TABLA II.1

COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA	DESCRIPCIÓN	IMPORTE
1	Activos totales	95,161.08
2	Ajuste por inversiones en el capital de entidades bancarias financieras aseguradoras o comerciales que se consolidan a efectos contables pero quedan fuera del ambito de consolidacion regulatoria	0.00
3	Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable pero excluidos de la medida de la exposicion de la razon de apalancamiento	0.00
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	267.08
5	Ajuste por operaciones de reporto y prestamo de valores	11.56
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	4,120.82
7	Otros ajustes	(779.79)
8	Exposicion de la razon de apalancamiento	98,780.76

TABLA III.1

CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIA	DESCRIPCIÓN	IMPORTE
1	Activos totales	95,161.08
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(306.22)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(3,061.00)
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable pero excluidos de la medida de la exposicion de la razon de apalancamiento	0.00
5	Exposiciones dentro del Balance	91,793.86

TABLA IV.1

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

REFERENCIA	CONCEPTO/TRIMESTRE	ago-26	sep-26	VARIACION (%)
1	Capital Básico [1/]	5,671.08	6,384.02	12.57%
2	Activos Ajustados [2/]	87,088.15	98,780.76	13.43%
3	Razón de Apalancamiento [3/]	6.51%	6.46%	-0.75%

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**