

Revelación de información relativa a Capitalización conforme al Anexo 1-O BIS

Septiembre de 2022

(cifras expresadas en miles de pesos)

REFERENCIA	RUBRO	IMPORTE
	Exposiciones dentro de Balance	
1	Partidas dentro de Balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores - SFT por sus siglas en ingles - pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el Balance).	71,495,309
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de Nivel 1 de Basilea III)	(148,590)
3	Exposiciones dentro del Balance (Netas) excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de la línea 1 y 2).	71,346,719
	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)	N/A
5	Importe de los factores adiciones por exposición patencial fallida, asociados a todas las operaciones con instrumento financiero derivado	N/A
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 en efectivo aportado en operaciones con instrumntos financieros derivados)	N/A
8	(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso de incumplimiento de las obligaciones de la contraparte real)	N/A
9	Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de créditos suscritos	N/A
10	(Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de créditos suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de créditos suscritos)	N/A
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).	43,869,157
13	(Cuentas por pagar y por cobranza SFT compensadas)	N/A
14	Exposición riesgo de contraparte por SFT	569
15	Exposición por SFT actuando por cuenta de terceros	N/A
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	43,869,726
	Otras exposiciones fuera de balance	
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	-
18	(Ajuste por conversión a equivalentes crediticios)	N/A
19	Partidas fuera de balance (suma de la línea 17 y 18)	-
	Capital y exposiciones totales	
20	Capital de nivel 1	17,900,668
21	Exposiciones totales es (suma de las líneas 3,11,16 y 19)	115,216,445
	Coeficiente de apalancamiento	
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	15.54%

Revelación de información relativa a Capitalización conforme al Anexo 1-O BIS

Septiembre de 2022

(cifras expresadas en miles de pesos)

Tabla II.1

Resumen comparativo de los activos contables frente a la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento

Cifras en Miles de Pesos

	RUBRO	IMPORTE
1	Activos Consolidados totales en los estados financieros publicados	115,364,466
2	Ajustes por inversiones en entidades bancarias, financieras, aseguradoras y comerciales que se consolidan a efectos contables, pero quedan fuera del ámbito de consolidación reguladora	-
3	Ajustes relativos a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable operativo, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento	N/A
4	Ajustes por instrumentos financieros derivados	N/A
5	Ajustes por operaciones de financiación con valores (es decir, repos y otros préstamos garantizados análogos)	569.00
6	Ajuste por partidas fuera de balance (es decir, conversión de las partidas fuera de balance a equivalentes crediticios)	-
7	Otros ajustes	(148,590)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	115,216,445

Revelación de información relativa a Capitalización conforme al Anexo 1-O BIS
Septiembre de 2022
(cifras expresadas en miles de pesos)

Tabla III.1

Formato Estandarizado de Revelación para la Razón de Apalancamiento

Cifras en Miles de Pesos

REFERENCIA	CONCEPTO	IMPORTE
	Exposiciones dentro de Balance	
1	Activos totales	115,364,466
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	N/A
3	Operaciones de reporto y prestamo de valores	43,869,157
4	Activos reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento.	148,590
5	Exposiciones dentro de Balance	71,346,719

Revelación de información relativa a Capitalización conforme al Anexo 1-O BIS

Septiembre de 2022

(cifras expresadas en miles de pesos)

Tabla IV.1

Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos (numerador y denominador) de la razón del apalancamiento

Cifras en Miles de Pesos

CONCEPTO/TRIMESTRE	T-1	T	VARICIÓN (%)
Capital Básico	18,070,216	17,900,668	-0.9%
Activos Ajustados	116,502,886	115,216,445	-1.1%
Razón de Apalancamiento	15.51%	15.54%	0.2%