

REFERENCIA	RUBRO	1T23	4T22	VARIACIÓN
I. INTEGRACIÓN DE LAS PRINCIPALES FUENTES DE APALANCAMIENTO				
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)	\$ 52,833	\$ 46,161	6,672
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(452)	(383)	- 69
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	52,381	45,778	6,603
Exposiciones a instrumentos financieros derivados				
4	Costo actual de reemplazo asociado a <i>todas</i> las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible).	\$ 227	89	138
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados.	95	58	37
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).	322	147	175
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores				
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	\$ 5,304	6,256	- 952
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)	5,304	6,256	- 952
Otras exposiciones fuera de balance				
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	\$ 7,843	8,252	- 409
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)		-	-
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	7,843	8,252	- 409
Capital y exposiciones totales				
20	Capital de Nivel 1	\$ 4,380	4,160	220
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	65,849	60,433	5,416
Coefficiente de apalancamiento				
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	6.65%	6.88%	-0.23%

II. COMPARATIVO ENTRE EL ACTIVO TOTAL Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA	DESCRIPCIÓN	1T23	4T22	VARIACIÓN
1	Activos totales	\$ 59,394	55,259	4,135
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	(1)	(1)	-
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	(835)	(2,650)	1,815
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores[1]	(101)	(45)	(56)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	7,843	8,252	(409)
7	Otros ajustes	(451)	(381)	- 70
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	65,849	60,433	5,416

III. CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIA	CONCEPTO				
1	Activos totales	\$	59,394	55,259	4,135
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados		(1,258)	(2,843)	1,585
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores		(5,304)	(6,256)	952
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		52,833	46,161	6,672

IV. PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS

CONCEPTO/TRIMESTRE	1T23	4T22	VARIACIÓN
Capital Básico ^{1/}	\$ 4,380	\$ 4,160	219
Activos Ajustados ^{2/}	65,849	60,433	5,416
Razón de Apalancamiento ^{3/}	6.65%	6.88%	-0.23%

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

Banco Actinver, SA
Variación porcentual de la Razón de Apalancamiento
Al 31 de marzo de 2023 y al 31 de diciembre de 2022

Factores cuantitativos y cualitativos

Capital Básico

El incremento en el Capital Básico, respecto al ejercicio anterior por \$219, se debe principalmente a la actuación favorable del Banco por el periodo correspondiente donde se generó un incremento en el capital ganado por \$289, un incremento en el saldo de los activos intangibles que disminuye el capital neto por \$30 y un incremento en el saldo de la parte de PTU diferida activa que disminuye al capital por \$40, principalmente.

Activos Ajustados

El decremento en los Activos Ajustados, respecto al año anterior por \$5,416, se debe principalmente:

- Al incremento en el saldo de los “Activos Totales” por un 7%, comparado contra el ejercicio anterior, fue originado por el incremento en los rubros de “Otras cuentas por cobrar”, “Bienes adjudicados” y “Pagos anticipados y otros activos”, principalmente.
- Al decremento en el saldo de “Ajuste por instrumentos financieros derivados” en \$1,815 respecto del mismo saldo del año anterior, principalmente originado por la valuación de las posiciones en swaps mantenidas con los contratos de los clientes y a la disminución en la posición de contratos adelantados con clientes, que se tenían en el ejercicio anterior.
- Al decremento en el monto de las “Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores” en \$56, se debe principalmente al decremento en las operaciones celebradas en reporte, respecto al ejercicio anterior.