



BANCO ACTINVER, S.A., INSTITUCIÓN DE BANCA
MÚLTIPLE GRUPO FINANCIERO ACTINVER
 FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

REFERENCIA	DESCRIPCION	3T20	2T20	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)	\$ 39,977	40,562	(585)
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(348)	(345)	- 3
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	39,629	40,217	(588)
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).	\$ 42	54	- 12
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados.	15	15	-
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 nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos.	-	-	-
10	(Compensaciones realizadas al nocional 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).	57	69	- 12
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores				
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	\$ 10,703	1,794	8,909
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	-	-	-
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	-	1	- 1
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)	10,703	1,795	8,908
Otras exposiciones fuera de balance				
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	\$ 8,042	6,547	1,495
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	-	-	-
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	8,042	6,547	1,495
Capital y exposiciones totales				
20	Capital de Nivel 1	\$ 3,391	3,397	- 6
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	58,431	48,628	9,803
Coeficiente de apalancamiento				
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	5.80%	6.99%	-1.18%

II. COMPARATIVO ENTRE EL ACTIVO TOTAL Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA	DESCRIPCION	3T20	2T20	VARIACIÓN
1	Activos totales	\$ 51,278	43,221	8,057
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	(538)	(796)	258
5	Ajuste por operaciones en reporto y préstamo de valores ¹¹	(3)	-	(3)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	8,042	6,547	1,495
7	Otros ajustes	(346)	(343)	- 3
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	58,432	48,628	9,804

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

REFERENCIA	CONCEPTO	3T20	2T20	VARIACIÓN
1	Activos totales	\$ 51,278	43,221	8,057
2	Opciones en instrumentos financieros derivados	(598)	(865)	267
3	Operaciones en reporto y préstamos de valores	(10,703)	(1,794)	(8,909)
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	39,977	40,562	(585)

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

CONCEPTO/TRIMESTRE	3T20	2T20	VARIACIÓN
Capital Básico ¹⁷	\$ 3,391	\$ 3,397	(6)
Activos Alustados ²	58,431	48,628	9,803
Razón de Apalancamiento ³	5.80%	6.99%	-1.18%

^{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 30 de septiembre de 2020

Factores cuantitativos y cualitativos

Capital Básico

El decremento en el Capital Básico, respecto al trimestre anterior por \$(6), se debe principalmente, a la actuación del Banco por el periodo correspondiente donde se generó un decremento en el capital ganado por \$ 3, un decremento en el saldo de los activos intangibles que disminuye el capital neto por \$ (7) y un incremento en el saldo de la parte de PTU diferida activa que resta del capital por \$10, principalmente.

Activos Ajustados

El incremento en los Activos Ajustados, respecto al trimestre anterior por \$ 9,803, se debe principalmente:

- Al incremento en el saldo de los “Activos Totales” por un 19%, comparado contra el trimestre anterior, fue originado principalmente por el incremento del rubro de las “Inversiones en valores” y en los “Deudores por reporto”.
- Al decremento en el saldo de “Ajuste por instrumentos financieros derivados”, por un 32%, principalmente por la cancelación de nuevos contratos, respecto al mes anterior.
- Al incremento en un 23% en el “Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden”, generado principalmente por el aumento en el saldo de las líneas de crédito.