

REFERENCIA	RUBRO	4T23	3T23	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)	\$ 48,870	\$ 52,894	(4,024)
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(482)	(495)	13
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	48,388	52,399	(4,011)
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).	\$ 410	\$ 228	182
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados.	110	145	(35)
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).	520	372	148
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores				
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	\$ 8,261	\$ 10,907	(2,646)
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)	8,261	10,907	(2,646)
Otras exposiciones fuera de balance				
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	\$ 7,500	\$ 8,988	(1,488)
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)		-	-
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	7,500	8,988	(1,488)
Capital y exposiciones totales				
20	Capital de Nivel 1	\$ 5,450	\$ 4,666	784
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	64,668	72,666	(7,998)
Coefficiente de apalancamiento				
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	8.43%	6.42%	2.01%

II. COMPARATIVO ENTRE EL ACTIVO TOTAL Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA	DESCRIPCIÓN	4T23	3T23	VARIACIÓN
1	Activos totales	\$ 62,438	\$ 68,949	(6,511)
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	(4,537)	(4,757)	220
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores[1]	(250)	(19)	(231)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	7,500	8,988	(1,488)
7	Otros ajustes	(480)	(493)	13
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	64,668	72,666	(7,998)

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

REFERENCIA	CONCEPTO			
1	Activos totales	\$ 62,438	\$ 68,949	(6,511)
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(5,307)	(5,148)	(159)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(8,261)	(10,907)	2,646
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	48,870	52,894	(4,024)

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

CONCEPTO/TRIMESTRE	4T23	3T23	VARIACIÓN
Capital Básico ^{1/}	\$ 5,450	\$ 4,666	784
Activos Ajustados ^{2/}	64,668	72,666	(7,998)
Razón de Apalancamiento ^{3/}	8.43%	6.42%	2.01%

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 diciembre de 2023 y al 30 de septiembre de 2023

Factores cuantitativos y cualitativos

Capital Básico

El incremento en el Capital Básico, respecto al trimestre anterior por \$784, se debe principalmente a una aportación para futuros aumentos de capital por \$600 y a la actuación favorable del Banco por el periodo correspondiente donde se generó un incremento en el capital ganado por \$171, un decremento en el saldo de los activos intangibles que favorece el capital neto por \$19, y un incremento en el saldo de los impuestos diferidos que disminuye al capital por \$(6), principalmente.

Activos Ajustados

El decremento en los Activos Ajustados, respecto al año anterior por \$7,998, se debe principalmente:

- Al decremento en el saldo de los “Activos Totales” por un 9%, comparado contra el trimestre anterior y fue originado por el decremento en los rubros de “Otras cuentas por cobrar”, “Deudores por reporte” e “Instrumentos financieros derivados”, principalmente.
- Al incremento en el monto de las “Ajuste por operaciones de reporte y préstamo de valores” en \$231, se debe principalmente al decremento en las operaciones celebradas en reporte, respecto al trimestre anterior.
- Al decremento en el saldo de “Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden” en \$1,488 respecto del mismo saldo del trimestre anterior, principalmente originado por la disminución en el saldo de la cuenta Compromisos crediticios, que se tenían en el trimestre anterior.