



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

REFERENCIA	RUBRO	2T21	1T21	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)	\$ 30,686	32,078	(1,392)
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(313)	(355)	41
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	30,373	31,723	(1,350)
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).	\$ 3	5	- 2
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 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).	18	20	- 2
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores				
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	\$ 11,622	13,854	- 2,232
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)	11,622	13,854	- 2,232
Otras exposiciones fuera de balance				
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	\$ 6,836	6,511	325
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	-	-	-
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	6,836	6,511	325
Capital y exposiciones totales				
20	Capital de Nivel 1	\$ 3,678	3,463	216
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	48,849	52,108	- 3,259
Coefficiente de apalancamiento				
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	7.53%	6.64%	0.88%

II. COMPARATIVO ENTRE EL ACTIVO TOTAL Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA	DESCRIPCIÓN	2T21	1T21	VARIACIÓN
1	Activos totales	\$ 42,799	46,430	(3,631)
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	(470)	(479)	8
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores[1]	(3)	-	(3)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	6,836	6,511	325
7	Otros ajustes	(312)	(353)	41
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	48,849	52,108	(3,259)

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

REFERENCIA	CONCEPTO				
1	Activos totales	\$	42,799	46,430	(3,631)
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados		(491)	(499)	8
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores		(11,622)	(13,854)	2,232
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		30,686	32,078	(1,391)

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

CONCEPTO/TRIMESTRE	2T21	1T21	VARIACIÓN
Capital Básico ^{1/}	\$ 3,678	\$ 3,463	216
Activos Ajustados ^{2/}	48,849	52,108	(3,259)
Razón de Apalancamiento ^{3/}	7.53%	6.64%	0.88%

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 junio de 2021

Factores cuantitativos y cualitativos

Capital Básico

El incremento en el Capital Básico, respecto al trimestre anterior por \$216, se debe principalmente, a una aportación para futuros aumentos de capital de \$100, a la actuación favorable del Banco por el periodo correspondiente donde se generó un incremento en el capital ganado por \$ 75, un decremento en el saldo de los activos intangibles que aumenta el capital neto por \$25, un decremento en el saldo de la parte de PTU diferida activa que resta del capital por \$8, y una disminución del excedente en el límite en el saldo del ISR diferido activo, que resta directo del capital por \$8, principalmente.

Activos Ajustados

El decremento en los Activos Ajustados, respecto al trimestre anterior por \$3,259, se debe principalmente:

- Al decremento en el saldo de los “Activos Totales” por 8%, comparado contra el trimestre anterior, fue originado principalmente por el decremento de los rubros de: “Inversiones en valores”, “Deudores por reporte” y las “Otras cuentas por cobrar”.
- Al decremento en el saldo de “Ajuste por instrumentos financieros derivados”, por un 2%, principalmente generado por la valuación de las posiciones de los contratos de intercambio de flujos, respecto al trimestre anterior.
- Al incremento en un 5% en el “Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden”, generado principalmente por el incremento en el saldo de las líneas de crédito.