

ANEXO 1-O Bis

REVELACIÓN DE INFORMACIÓN RELATIVA A LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

Información al 30 de septiembre de 2024



TABLA I.1 FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

REFERENCIA	RUBRO	IMPORTE
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.	155,645.74
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el Capital Básico)	(1,745.72)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	153,900.02
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)	
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	
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)	

ANEXO 1-O Bis

REVELACIÓN DE INFORMACIÓN RELATIVA A LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

Información al 30 de septiembre de 2024



TABLA I.1 FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

REFERENCIA	RUBRO	IMPORTE
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)	-
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	5,500.87
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)	5,500.87
Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	7.68
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	0.00
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	7.68
Capital y exposiciones totales		
20	Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones	17,651.83
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	159,408.57
Razón de apalancamiento		
22	Razón de apalancamiento	0.1107

ANEXO 1-O Bis

REVELACIÓN DE INFORMACIÓN RELATIVA A LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

Información al 30 de septiembre de 2024



TABLA II.1 COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA	DESCRIPCION	IMPORTE
1	Activos totales	1,022.19
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	
3	Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición de la razón de apalancamiento	
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores4	
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	7.68
7	Otros ajustes	(1,745.72)
8	Exposición de la razón de apalancamiento	(715.85)

*Cifras en millones de pesos, en proceso de validación por Banxico.

ANEXO 1-O Bis

REVELACIÓN DE INFORMACIÓN RELATIVA A LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

Información al 30 de septiembre de 2024



TABLA III.1 CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIA	CONCEPTO	IMPORTE
1	Activos totales	1,022.19
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(5,500.86)
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición de la razón de apalancamiento	
5	Exposiciones dentro del Balance	(4,478.67)

*Cifras en millones de pesos, en proceso de validación por Banxico.

ANEXO 1-O Bis

REVELACIÓN DE INFORMACIÓN RELATIVA A LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

Información al 30 de septiembre de 2024



TABLA IV.1 PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS (NUMERADOR Y DENOMINADOR) DE LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

CONCEPTO/TRIMESTRE	T-1	T	VARIACION (%)
Capital Básico 1/	15,744.71	17,651.83	12.11%
Activos Ajustados 2/	156,426.70	159,408.57	1.91%
Razón de Apalancamiento 3/	10.07%	11.07%	10.02%

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