

<b>Referencia</b>	<b>Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas</b>	<b>Monto</b>
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	1,872,159
2	Resultados de ejercicios anteriores	234,367
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	66,032
6	<b>Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>	2,172,558
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	414
21	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo)	263,424
28	<b>Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1</b>	263,838
29	<b>Capital común de nivel 1 (CET1)</b>	1,908,720
50	Reservas	1,888
51	<b>Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios</b>	1,888
<b>58</b>	<b>Capital de nivel 2 (T2)</b>	1,888
<b>59</b>	<b>Capital total (TC = T1 + T2)</b>	1,910,608

<b>Conceptos de capital</b>	<b>Sin ajuste por reconocimiento de capital</b>	<b>% APSRT</b>	<b>Ajuste por reconocimiento de capital</b>	<b>Con ajuste por reconocimiento de capital</b>	<b>% APSRT</b>
Capital Básico 1	2,172,558	17.19%	263,838	1,908,720	15.10%
Capital Básico 2	-	0.00%	-	-	0.00%
Capital Básico	2,172,558	17.19%	263,838	1,908,720	15.10%
Capital Complementario	1,888	0.01%	-	1,888	0.01%
Capital Neto	2,174,446	17.21%	263,838	1,910,608	15.12%
Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT)	12,636,629	No aplica	No aplica	12,636,629	No aplica
<b>Indice capitalización</b>	<b>17.21%</b>	<b>No aplica</b>	<b>No aplica</b>	<b>15.12%</b>	<b>No aplica</b>

<b>Referencia de los rubros del balance general</b>	<b>Rubros del balance general</b>	<b>Monto presentado en el balance general</b>
BG1	Disponibilidades	773,354
BG3	Inversiones en valores	6,065,239
BG4	Deudores por reporto	1,400,786
BG6	Derivados	8,958,780
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	253,244
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	2,734,370
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	10,496
BG13	Inversiones permanentes	550,308
BG16	Otros activos	11,186
BG17	Captación tradicional	1,033,225
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	4,203,520
BG19	Acreedores por reporto	1,446,632
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	2,222,879
BG22	Derivados	7,106,801
BG25	Otras cuentas por pagar	2,507,831
BG27	Impuestos y PTU diferidos (neto)	64,317
BG29	Capital contribuido	1,872,159
BG30	Capital ganado	300,399
BG31	Avales otorgados	13,500
BG36	Bienes en custodia o en administración	35,849,325
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	4,473,360
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	2,222,879
BG41	Otras cuentas de registro	13,376,429

<b>Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto</b>	<b>Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo</b>	<b>Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto</b>	<b>Referencia(s) del rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo del Capital Neto proveniente de la referencia</b>
Otros Intangibles	9	414	BG16
Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	263,424	BG27
Reservas reconocidas como capital complementario	50	1,888	BG8
Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	1,872,159	BG29
Resultado de ejercicios anteriores	2	234,367	BG30
Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	66,032	BG30

Concepto	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	3,962,125	316,970
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	-	-
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's	4,386,138	350,891
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC	16,213	1,297
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del salario mínimo general	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	574,813	45,985
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	159,975	12,798
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupo de acciones	-	-

<b>Concepto</b>	<b>Activos ponderados por riesgo</b>	<b>Requerimiento de capital</b>
Grupo III (ponderados al 20%)	32,826	2,625
Grupo III (ponderados al 23%)	523,000	42,000
Grupo III (ponderados al 50%)	124,820	9,985
Grupo IV (ponderados al 20%)	809,126	64,730
Grupo V (ponderados al 20%)	17,640	1,410
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	1,005,908	80,473
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	220,600	17,648

<b>Activos ponderados por riesgo</b>	<b>Requerimiento de capital</b>
12,636,629	1,010,930

<b>Promedio del requerimiento por riesgo de mercado y de crédito de los últimos 36 meses</b>	<b>Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses</b>
648,100	0