

## RIESGO DE TITULIZACIÓN

### LÍMITES E INDICADORES DE GESTIÓN

Verificación realizada con datos al 30/06/2020

#### A- Cumplimientos de Límites por Prueba de Sensibilidad

##### A.1 - En relación al Capital

Límite	jun-20	jul-20	ago-20	sep-20	oct-20	nov-20	dic-20	Límite	Cumplimiento
Resultados Acumulados - Estrés (*)	424.217	623.919	828.781	1.033.643	1.238.505	1.443.367	1.648.229	>0	ok
Excesos Capitales Mínimos (*)	4.395.228	5.626.747	5.742.468	6.313.545	6.429.261	6.545.026	6.968.094	>0	ok

##### A.2 - En relación a la Liquidez

Coefficiente de Liquidez - Estrés (*)	1,31	1,35	1,38	1,40	1,43	1,44	1,46	>1	ok
---------------------------------------	------	------	------	------	------	------	------	----	----

##### A.3 - En relación a la capacidad de Fondeo - Efectivo Mínimo

Exceso Pesos - Estrés (*)	209.740	289.849	410.230	530.610	650.991	771.372	891.752	>0	ok
Exceso Dólares - Estrés (*)	2.484	3.473	4.461	5.450	6.439	7.427	8.416	>0	ok

(\*) Expresado en miles de pesos

#### B- Evolución de Indicadores de Gestión de Riesgo de Titulización

##### B.1 - Participaciones en Fideicomisos Financieros

	jun-20	may-20	abr-20	mar-20	feb-20	ene-20	dic-19	nov-19	oct-19
Capital Económico FF	3.068.149	2.960.583	2.863.204	2.739.707	2.621.671	2.522.846	2.463.238	2.461.934	2.436.601

##### B.1 - Participaciones en Sociedades de Garantía Recíproca

	jun-20	may-20	abr-20	mar-20
Aportes	194.117.173	164.117.174	164.117.174	164.117.174
Contingente	26.359.260	21.467.473	28.018.200	28.044.415
Desvalorización	11.695.451	7.108.246	13.206.658	13.206.658
Rendimientos a cobrar	35.275.391	28.896.792	9.003.593	9.618.771