



INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA MÉXICO, S. A.
INSTITUCIÓN DE BANCA MÚLTIPLE

Revelación de Información relativa a la
Razón de Apalancamiento de acuerdo con las
Disposiciones de Carácter General para las
Instituciones de Crédito

30 de abril de 2020

REVELACIÓN DE INFORMACIÓN RELATIVA A LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

Millones de pesos

| TABLA I.1 FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO | | ABR 2020 |
|---|---|----------------|
| REF | 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) | 6,560 |
| 2 | (Importes de los activos deducidos para determinar el Capital Básico) | (52) |
| 3 | Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) | 6,508 |
| 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) | - |
| 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) | - |
| Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores | | |
| 12 | Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas | - |
| 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) | - |
| Otras exposiciones fuera de balance | | |
| 17 | Exposición fuera de balance (importe notional bruto) | 844 |
| 18 | (Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) | (422) |
| 19 | Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) | 422 |
| Capital y exposiciones totales | | |
| 20 | Capital Básico calculado conforme al artículo 2 bis 6 de las Disposiciones | 969 |
| 21 | Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) | 6,930 |
| Razón de apalancamiento | | |
| 22 | Razón de apalancamiento | 13.98 % |

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

ABR 2020

| REFE RENCIA | RUBRO | IMPORTE |
|----------------|---|---------|
| 1 | Activos totales | 6,560 |
| 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 del coeficiente de apalancamiento | - |
| 4 | Ajuste por instrumentos financieros derivados | - |
| 5 | Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores | - |
| 6 | Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden | 422 |
| 7 | Otros ajustes | (52) |
| 8 | Exposición de la razón de apalancamiento | 6,930 |

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

ABR 2020

| REFE RENCIA | RUBRO | IMPORTE |
|----------------|--|---------|
| 1 | Activos totales | 6,560 |
| 2 | Operaciones en instrumentos financieros derivados | - |
| 3 | Operaciones en reporto y prestamos de valores | - |
| 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 | 6,560 |

TABLA IV.1

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

| <u>CONCEPTO/ MES</u> | <u>ABR 2020</u> | <u>MAR 2020</u> | <u>VARIACION %</u> |
|-------------------------|-----------------|-----------------|--------------------|
| Capital Básico | 969 | 968 | 0.1 % |
| Activos Ajustados | 6,930 | 5,996 | 15.6 % |
| Razón de Apalancamiento | 13.98 % | 16.14 % | - 13.4 % |

El capital básico al 30 de abril de 2020 se incrementó marginalmente en \$1 respecto al mes anterior, que corresponde al resultado del mes antes del reconocimiento de impuestos diferidos.

Los activos ajustados totales se incrementaron en \$934, de los cuales \$124 corresponden a una reducción de en la exposición neta fuera de balance por disposición neta de líneas de crédito comprometidas. El incremento neto de los activos dentro del balance fue de \$1,058 generado por un incremento en la cartera de crédito de \$248 y un incremento de \$810 en las disponibilidades, generadas por un incremento en la captación a la vista por ese importe. La variación del capital básico y el incremento de activos ajustados representaron una reducción de 216 puntos base en el índice de apalancamiento.