



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

31 de octubre de 2018

REVELACIÓN DE INFORMACIÓN RELATIVA A LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

Millones de pesos

REFE RENCIA	RUBRO	IMPORTE
TABLA I.1		
FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE		
		Oct-18
	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)	5,630
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el Capital Básico)	(39)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	5,590
	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 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	-
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 nocional bruto)	629
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(314)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	314
	Capital y exposiciones totales	
20	Capital Básico calculado conforme al artículo 2 bis 6 de las Disposiciones	1,362
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	5,905
	Razón de apalancamiento	
22	Razón de apalancamiento	23.07 %

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

REFE RENCIA	RUBRO	IMPORTE
1	Activos totales	5,630
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	314
7	Otros ajustes	(39)
8	Exposición de la razón de apalancamiento	5,905

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

REFE RENCIA	RUBRO	IMPORTE
1	Activos totales	5,630
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	5,630

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>SEP 2018</u>	<u>OCT 2018</u>	<u>VARIACION %</u>
Capital Básico	1,338	1,362	1.8 %
Activos Ajustados	5,659	5,905	4.3 %
Razón de Apalancamiento	23.65 %	23.07 %	-2.5 %

El capital básico se incrementó en \$24, integrado por la utilidad del mes por \$23 y por una reducción marginal en los impuestos diferidos a favor por pérdidas fiscales pendientes de amortizar y participación de los trabajadores en la utilidad diferidos que deben reducirse del capital básico. La utilidad del mes se generó por la ganancia por fluctuación cambiaria debido a la depreciación del peso frente al dólar durante el mes.

El incremento en los activos ajustados por \$245 se integra principalmente por un incremento en disponibilidades de \$131, un incremento de \$139 por inversiones en valores adquiridos al final de mes y pendientes de liquidar y una reducción de la cartera de crédito de \$22 por amortizaciones cobradas de los créditos vigentes. Estos factores representaron una reducción de 57 puntos base en la razón de apalancamiento.