

GRUPO FINANCIERO CREDIT SUISSE MÉXICO, S. A. DE C.V.

Anexo I-0

REVELACION DE INFORMACION RELATIVA A LA CAPITALIZACION DE BANCO CREDIT
SUISSE MEXICO, S.A., INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE

30 de junio de 2013

(Cifras en miles de pesos)

31 DE MAYO DE 2013 – última información disponible confirmada por Banxico - (cifras en miles de pesos)

Tabla I.1

Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	1,872,159
2	Resultados de ejercicios anteriores	232,072
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	48,018
6	Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	2,152,249
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	560
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)	252,531
28	Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1	253,091
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	1,899,158
50	Reservas	2,429
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	2,429
58	Capital de nivel 2 (T2)	2,429
59	Capital total (TC = T1 + T2)	1,901,587

Tabla II.1

Conceptos de capital	Sin ajuste por reconocimiento de capital	% APSRT	Ajuste por reconocimiento de capital	Con ajuste por reconocimiento de capital	% APSRT
Capital Básico 1	2,152,249	19.46%	253,091	1,899,158	17.18%
Capital Básico 2	-	0.00%	-	-	0.00%
Capital Básico	2,152,249	19.46%	253,091	1,899,158	17.18%
Capital Complementario	2,429	0.02%	-	2,429	0.02%
Capital Neto	2,154,678	19.49%	253,091	1,901,587	17.20%
Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT)	11,057,143	No aplica	No aplica	12,636,629	No aplica
Indice capitalización	19.49%	No aplica	No aplica	17.20%	No aplica

Tabla III.1 (ver siguiente hoja)

Referencia de los rubros del balance general	Rubros del balance general	Monto presentado en el balance general
BG1	Disponibilidades	861,024
BG3	Inversiones en valores	10,697,806
BG4	Deudores por reporto	-
BG6	Derivados	9,450,693
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	325,373
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	9,468,304
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	11,415
BG13	Inversiones permanentes	550,058
BG16	Otros activos	12,095
BG17	Captación tradicional	1,269,726
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	3,457,060
BG19	Acreedores por reporto	9,340,864
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	245,388
BG22	Derivados	7,633,929
BG25	Otras cuentas por pagar	7,221,950
BG27	Impuestos y PTU diferidos (neto)	55,613
BG29	Capital contribuido	1,872,159
BG30	Capital ganado	280,090
BG31	Avales otorgados	13,500
BG36	Bienes en custodia o en administración	36,242,711
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	690,717
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	245,388
BG41	Otras cuentas de registro	10,572,919

Tabla III.2

Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	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 mencionada.
Otros Intangibles	9	560	BG16
Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	252,531	BG27
Reservas reconocidas como capital complementario	50	2,429	BG8
Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	1,872,159	BG29
Resultado de ejercicios anteriores	2	232,072	BG30
Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	48,018	BG30

Tabla IV.1

Concepto	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	3,416,625	273,330
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	3,288,538	263,083
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	3,900	312
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del salario mínimo general	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	578,188	46,255
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	21,150	1,692
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupo de acciones	-	-

Tabla IV.2

Concepto	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Grupo III (ponderados al 20%)	18,090	1,447
Grupo III (ponderados al 23%)	1,070,000	85,600
Grupo III (ponderados al 50%)	121,140	9,691
Grupo IV (ponderados al 20%)	490	39
Grupo V (ponderados al 20%)	17,030	1,362
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	1,043,420	83,474
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	532,120	42,570

Tabla IV.3

Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
11,057,143	884,571
Promedio del requerimiento por riesgo de mercado y de crédito de los últimos 36 meses	Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses
680,740	0

31 DE MARZO DE 2013 (cifras en miles de pesos)

Tabla I.1

Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
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	Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	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	Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1	263,838
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	1,908,720
50	Reservas	1,888
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	1,888
58	Capital de nivel 2 (T2)	1,888
59	Capital total (TC = T1 + T2)	1,910,608

Tabla II.1

Conceptos de capital	Sin ajuste por reconocimiento de capital	% APSRT	Ajuste por reconocimiento de capital	Con ajuste por reconocimiento de capital	% APSRT
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
Indice capitalización	17.21%	No aplica	No aplica	15.12%	No aplica

Tabla III.1 (Ver siguiente hoja)

Referencia de los rubros del balance general	Rubros del balance general	Monto presentado en el balance general
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

Tabla III.2

Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	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 mencionada.
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

Tabla IV.1

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	-	-

Tabla IV.2

Concepto	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
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

Tabla IV.3

Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
12,636,629	1,010,930

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