

Barclays Bank México, S.A. Institución de Banca Múltiple

Revelación de información relativa a la Razón de Apalancamiento en base a lo publicado en el ANEXO 1-O Bis cifras al 30 de Junio de 2018.

I. Integración de las principales fuentes de apalancamiento.

TABLA I.1 FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO		
REFERENCIA	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)	41,360
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	0
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	41,360
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)	2,258
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	5,826
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)	(2,167)
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)	5,917
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	2,911
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)	2,911
Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	-
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	-
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	-
Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	6,023
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	50,189
Coefficiente de apalancamiento		
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	12.00%

II. Comparativo entre el activo total y los activos ajustados.

TABLA II.1 COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS		
REFERENCIA	DESCRIPCION	IMPORTE
1	Activos totales	63,317
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	0
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	(14,860)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	1,732
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	-
7	Otros ajustes	-
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	50,189

III. Conciliación entre activo total y la exposición dentro del balance

TABLA III.1 CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE		
REFERENCIA	CONCEPTO	IMPORTE
1	Activos totales	63,317
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(20,777)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(1,179)
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	41,360

IV. Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos (numerador y denominador) de la Razón de Apalancamiento.

TABLA IV.1 PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS (NUMERADOS Y DENOMINADOR) DE LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO			
CONCEPTO/TRIMESTRE	T-1	T-2	VARIACION (%)
Capital Básico	5,984	6,023	0.66%
Activos Ajustados	42,890	50,189	17.02%
Razón de Apalancamiento	13.95%	12.00%	-1.95%

1/Reportado en la fila 20, 2/Reportado en la fila 21 y 3/ Reportado en la fila 22, de la tabla I.11

Se reportan al segundo trimestre de 2018 un capital básico con un monto de \$6,023 millones de pesos, y un Activo Ajustado por la metodología de razón de apalancamiento de \$50,189 millones de pesos. Contando con una razón de apalancamiento de 12.00% por lo que se cuenta con un capital sólido.

En el mes de junio de 2018 el Capital Básico se incrementó principalmente por terminaciones anticipadas de productos derivados (SWAPS) con clientes Corporativos e Institucionales aunado a las buenas condiciones de mercado lo cual generó ingresos netos por 90 millones de pesos durante el segundo trimestre del año en curso, por el lado de los Activos Ajustados durante este periodo y por estrategia del negocio hubo un incremento en el rubro de Inversiones en Valores por 5 mil millones, en lo que respecta al rubro de Deudores por Reporto se están presentando 6 mil millones al cierre junio de 2018, para este segundo trimestre la posición activa de los productos derivados se vio incrementada principalmente por la disminución en la actividad referenciada a las terminaciones. Las cuentas por cobrar por títulos y divisas pendientes de liquidar aumentaron 3 mil millones en comparación con el primer trimestre de 2018 derivado de las fluctuaciones en el tipo de cambio y el aumento en las tasas de interés.

La razón de apalancamiento se calcula dividiendo el capital básico por una exposición total no ponderada por riesgo, como los activos consolidados totales medios del banco (no ponderados).

El coeficiente mínimo de apalancamiento establecido por el Comité de Basilea III es del 3%.

El Activo Ajustado está compuesto por el Activo Total de Barclays Banks México, y se realizan dos ajustes importantes:

- Ajuste por exposición a instrumentos derivados: los deudores por colaterales en efectivo de los productos derivados son ajustados con el riesgo de crédito de contraparte, valor positivo Mark to Market de los derivados (costo de replazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados).
- Ajuste por exposiciones de financiamiento con valores (Reportos): Deudores por reporto (saldo deudor) ajustado con el valor neto de los colaterales vendidos o dados en garantía de reportos.