

## 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 Septiembre 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
<b>Exposiciones dentro del balance</b>		
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)	39,390
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	0
3	<b>Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)</b>	<b>39,390</b>
<b>Exposiciones a instrumentos financieros derivados</b>		
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	2,808
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	5,979
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)	(2,088)
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	<b>Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)</b>	<b>6,699</b>
<b>Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores</b>		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	5,654
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	<b>Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)</b>	<b>5,654</b>
<b>Otras exposiciones fuera de balance</b>		
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	-
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	-
19	<b>Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)</b>	<b>-</b>
<b>Capital y exposiciones totales</b>		
20	Capital de Nivel 1	6,065
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	51,742
<b>Coefficiente de apalancamiento</b>		
22	<b>Coefficiente de apalancamiento de Basilea III</b>	<b>11.72%</b>

## 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	65,100
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	(13,546)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	189
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	-
7	Otros ajustes	-
8	<b>Exposición del coeficiente de apalancamiento</b>	<b>51,742</b>

## 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	65,100
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(20,245)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(5,465)
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento	-
5	<b>Exposiciones dentro del Balance</b>	<b>39,390</b>

## 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-2	T-3	VARIACION (%)
Capital Básico <sup>1/</sup>	6,023	6,065	0.69%
Activos Ajustados <sup>2/</sup>	50,189	51,742	3.10%
<b>Razón de Apalancamiento <sup>3/</sup></b>	<b>12.00%</b>	<b>11.72%</b>	<b>-0.28%</b>

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 tercer trimestre de 2018 un capital básico con un monto de \$6,065 millones de pesos, y un Activo Ajustado por la metodología de razón de apalancamiento de \$51,742 millones de pesos. Contando con una razón de apalancamiento de 11.72% por lo que se cuenta con un capital sólido.

En el mes de Septiembre de 2018 el Capital Básico se incrementó principalmente por los siguientes rubros:

El margen financiero presentó un movimiento positivo de MXN56m derivado principalmente de premios por operaciones de reporto e inversiones en títulos gubernamentales.

En lo que respecta al resultado por intermediación, este mes se presentó una pérdida neta de MXN17m generada principalmente por los rubros de títulos para negociar, productos derivados y compra-venta de divisas. Este último, tiene su movimiento principalmente por terminaciones anticipadas y recouponings con clientes institucionales y Barclays PLC, así como por el resultado por valuación de las posiciones vigentes de derivados, durante septiembre hubo un decremento en las actividades relacionadas con las terminaciones de operaciones derivadas por las condiciones económicas presentadas en el 3er trimestre y al nuevo esquema de bonos como colateral correspondiente al nuevo CSA que se tiene con las Siefores.

El rubro de otros ingresos tuvo un resultado positivo de MXN41m durante el mes debido a operaciones de Precios de Transferencia relacionadas a Central Transfer Pricing.

En el rubro de gastos de administración los principales movimientos que explican los MXN86m incurridos durante septiembre son: MXN68m Servicios pagados a compañías del Grupo, MXN3m salarios, gastos de operación y mantenimiento del edificio, MXN1m impuestos retenidos por operaciones, MXN2m servicios profesionales, MXN6m Otros impuestos – IVA deducible, entre otros.

En lo que respecta al rubro de impuestos, el impuesto causado proviene de la materialización de las valuaciones en productos derivados ligadas a las terminaciones anticipadas, impacta la base fiscal al cierre de septiembre eliminando el impuesto a cargo. El impuesto diferido se genera por las valuaciones fiscales de los derivados, el cual disminuye en balance al materializarse las operaciones derivadas generando un impuesto diferido a cargo.

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.