

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

Revelación de información relativa al Coeficiente de Fondo Estable Neto.
En cumplimiento al Anexo 10 de las Disposiciones de carácter general sobre los
requerimientos de liquidez para las Instituciones de Banca Múltiple al 30 de
Junio de 2022.

Tabla I.3

Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto

(Cifras en millones de pesos)		Cifras Individuales					Cifras Consolidadas				
		Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado
		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	≥ 1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	≥ 1 año	
Elementos del MONTO DE Financiamiento Estable Disponible											
1	Capital	8,797	-	-	-	8,797	8,797	-	-	-	8,797
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	8,797	-	-	-	8,797	8,797	-	-	-	8,797
3	Otros instrumentos de capital.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	Depósitos minoristas	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	Depósitos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	Depósitos menos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	Financiamiento mayorista	-	6,812	-	-	-	-	6,812	-	-	-
8	Depósitos operacionales.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	Otro financiamiento mayorista.	-	6,812	-	-	-	-	6,812	-	-	-
10	Pasivos interdependientes	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	Otros pasivos.	-	1,480	-	-	-	-	1,480	-	-	-
12	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
13	Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	-	1,480	-	-	-	-	1,480	-	-	-
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	8,797	8,293	-	-	8,797	8,797	8,293	-	-	8,797
Elementos del MONTO DE Financiamiento Estable Requerido											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	532	4,235	-	3,415	433	532	4,235	-	3,559	440
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	-	241	-	-	120	-	396	-	-	198
17	Préstamos al consumo y valores.	-	1,688	-	-	169	-	1,688	-	-	169
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	-	1,688	-	-	169	-	1,688	-	-	169
19	Financiamiento otorgado a entidades financieras garantizado con activos líquidos elegibles distintos de nivel I, y financiamiento otorgado a entidades financieras no garantizado.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
20	Financiamiento otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
21	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
22	Créditos a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
23	Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentran en situación de impago).	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
25	Activos interdependientes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	Otros Activos	287,070	33,958	342	7,244	5,856	287,070	33,958	342	7,244	5,856
27	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
28	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	5	-	-	-	4	5	-	-	-	4
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	15,645	-	-	-	4,280	15,645	-	-	-	4,280
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	271,420	-	-	-	588	271,420	-	-	-	588
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.	-	33,958	342	7,244	984	-	33,958	342	7,244	984
32	Operaciones fuera de balance.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
33	Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	287,602	40,121	342	10,658	6,578	287,602	40,276	342	10,803	6,663
34	Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%)	-	-	-	-	133.73	-	-	-	-	132.02

Información cualitativa

La métrica del Coeficiente de Fondeo Estable Neto para Barclays Bank México se reporta al 146.01% para el cierre del 2do trimestre de 2022 (133.73% promedio de los tres meses del segundo trimestre del año en curso), con un Financiamiento Estable Disponible de \$9.38 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por 6.43 mil millones.

La principal fuente del Financiamiento Estable Disponible es el Capital de la Institución mientras que la principal fuente del Financiamiento Estable Requerido proviene de los pasivos del portafolio de derivados.

El Coeficiente de Fondeo Estable Neto reportado al cierre de junio 2022 se compara con el 223.7% reportado al cierre del primer trimestre de 2022. La variación trimestre contra trimestre se explica principalmente por una mayor actividad en el portafolio de bonos a través de las operaciones fechas valor con títulos de deuda, así como un incremento en la posición pasiva del portafolio de derivados.

En términos consolidados, el Coeficiente de Fondeo Estable Neto se ubica en 143.94% al cierre de junio (132.02% promedio de los tres meses del segundo trimestre del año en curso), debido a que el Financiamiento Estable Requerido se incrementa mientras que el Financiamiento Estable Disponible se mantiene estable.

El incremento en el Financiamiento Estable Requerido está relacionado con la consolidación de los saldos de las cuentas de cheques de las subsidiarias del Grupo Financiero y al saldo de la posición propia en bonos gubernamentales de la Casa de Bolsa.

