

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

Revelación de información relativa al Coeficiente de Fondeo 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 Septiembre de 2022.

Tabla I.3

Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto

| 3 | | | Cifras Individuales | | | | | Cifras Consolidadas | | | | |
|--|---------|--|---|-----------|-------|-------------------|---------|---------------------|-----------|-------|--------|------------|
| Common of the Profession of Processing Control of Processing Control of Con | | | Importe sin ponderar por plazo residual | | | | Importo | | | | | to a set o |
| 1.5 Capabil furnishmental y capabil brisis for or furnishmental 8,979 | | (Cifras en millones de pesos) | | < 6 meses | | <u>></u> 1 año | | | < 6 meses | | ≥1 año | |
| Capital functionmental y capital desicn on functionmental 8,979 8,979 8,979 8,979 8,979 8,979 8,979 8,979 3 3 3 3 3 3 3 3 3 | Element | | alalalalalalalalalalala | | | | | | | | | |
| 3 | 1 | | | | - | | | | | | | |
| A December mercenesis: | 2 | Capital fundamental y capital básico no fundamental. | 8,979 | - | - | - | 8,979 | 8,979 | - | - | - | 8,979 |
| 5 Oxpocition centralistics | | | | | - | | - | - | - | | - | - |
| 6 Opcoletor morce estables 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 2,517 4,091 7,919 | | | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 7 Prising Company (1997) 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 7,919 | | | | | - | | - | | | | | - |
| 9 Dir Franciamentem provistas 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,092 7,919 2,517 4,093 7,919 2,517 4,093 7,919 2,517 7,919 7, | | | | 7,919 | 2,517 | | 4,092 | - | 7,919 | 2,517 | - | 4,092 |
| 10 Presidence interfrependentes | | | | | - | | - | - | - | | - | - |
| 13 Ores pashocks | | | | 7,919 | 2,517 | - | 4,092 | - | 7,919 | 2,517 | - | 4,092 |
| 1 | | | | 3.090 | - | | | | 3.090 | | | |
| Financiamento Estable Nedo 3,090 | | Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de | | ., | | | | _ | ., | | | |
| 13 | 12 | | | | | | - | - | | | - | |
| Total del Monto de Financiamiento Estable 8,979 11,009 2,517 13,071 8,979 11,009 2,517 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,071 13,07 | 13 | | | 3,090 | - | | - | - | 3,090 | | - | - |
| Sementers del MONTO DE Financiamiento Estable Requirido 15 Todi de activos liquidos desiglibles para electes del 20 20,000 506 107 6,062 3,196 51 16 Depósitico en ortars instituciones financiarias con propósitico operacionales. 107 6,062 3,000 111 377 18 16 Depósitico en ortars instituciones financiarias con propósitico operacionales. 3,622 362 3,622 3,622 362 3,622 3,6 | 14 | Total del Monto de Financiamiento Estable | 8,979 | 11,009 | 2,517 | | 13,071 | 8,979 | 11,009 | 2,517 | - | 13,071 |
| 15 Coefficient activos Riquidos elegibles paria efectos del 107 6,062 3,049 506 107 6,062 3,196 51 16 Coefficiente de Financiente Estable Neto. | Element | | ido | | | | | | | | | |
| Conficiente de Financiamiento Estable Neto. | | | | C 0C2 | | 2.040 | F0C | 107 | C 0C2 | | 2.400 | -42 |
| 17 Priestamos al contrents y valories 3,622 362 362 | 10 | | 107 | 6,062 | - | 3,049 | 506 | 107 | 6,062 | | 3,196 | 513 |
| Priestamos al corriemte y valories: | 16 | | - | 222 | | | 111 | - | 372 | | - | 186 |
| financieras con activos líquidos elegibles de nivel I. Financiemiento otrogado a entidades financieras garantizado con activos líquidos elegibles distintos de nivel I. y financiemiento otrogado a entidades financieras no garantizado. Enanciemiento otrogado a contrapantes distintas de antidades financieras, las cuales: Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o gual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de lespas 1 y 2), de los cuales: Toren un ponderador de riesgo crédito menor o gual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de lespas 1 y 2), de los cuales: Trenan un ponderador de riesgo crédito menor o gual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones. Tratos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (un o se encuentrien en situación de impago). Activos interdependientes. Otros Activos interdependientes. Margen inicial otrogado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérididas de contrapartes contrales al fondo de absorción de pérididas de contrapartes contrales al fondo de absorción de pérididas de contrapartes contrapartes contrales al fondo de absorción de pérididas de contrapartes contrapartes contrales al fondo de absorción de pérididas de contrapartes contrapartes contrales primas primas del Coeficiente de Financiemiento Estable Neto. Paskos por derivados para fines del Coeficiente de Financiemiento Estable Neto. Paskos por derivados para fines del Coeficiente de Financiemiento Estable Neto. 30 Ciedados anteriores. 40 Coeficiente de Balance. 40 Coeficientes de Balance. 40 Coeficientes de Balance. 40 Coeficientes de Balance. 50 Coeficientes de Balance. | 17 | | | 3,622 | - | | 362 | | 3,622 | | - | 362 |
| Financiamiento totrogado a entidades financieras garacteristado con activos figuidos elegibles distintos de nivel 1, y financiamiento otorgado a entidades financieras no garantizado. Financiamiento otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras no garantizado. Financiamiento otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales: Tenen un proderador de riesgo de crédito menor o gual a 35% de acuerdo al Metodo Estándar para riesgo de crédito de Basilea II. | 18 | | | 3,622 | | | 362 | | 3,622 | | | 362 |
| garantizado con activos líquidos elegibles distintos de ne ne de ne ne de ne ne de ne ne ne de ne | | | | | | | | | | | | |
| de nivel (, y inarcinamiento otorgado a entidades financieras no garantizado. Financiamiento otorgado a contraparies distintas de entidades financieras, las cuales: Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Métode Stafadar para riesgo de crédito de Basilea II. Créditos a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales: Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Métode Stafadar para riesgo de crédito a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales: Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones. Tiludos de deuda y acciones distintos a los Activos Liquidos Elégibles (que no se encuentren en situación de impago). Za Activos interdependientes. Activos proferivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto. Passivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiente Estable Neto. Passivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiente Estable Neto. Passivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiente Estable Neto. Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiente Estable Neto. Passivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiente Estable Neto. Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiente Estable Neto. Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiente Estable Neto. Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiente Estable Neto. Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiente | 19 | | | | | | | _ | | | | |
| Financiamiento totorgado a contrapartes distintas de entidos financieras, las cuales: Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o gual a 3% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II. Créditos a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales: Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o gual a 3% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones. Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o gual a 3% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones. Titudos de deuda y acciones distintos a los Activos Lúquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Ze Activos interdependientes. 303,001 46,721 1,139 4,331 8,549 303, | | | | | | | | | | | | |
| International production International productional productional production International productional productiona | | | | | | | | | | | | |
| 21 qual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilae II. | 20 | entidades financieras, las cuales: | | | - | | - | | - | | - | - |
| Tiespo de crédito de Basilea II. | 21 | | | | | | | | | | | |
| Tilenen un ponderador de riesgo crédito menor o guel a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones. Tillusos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elégibles (que no se encuentren en situación de imago) | 21 | | | | | | | | | | | - |
| Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o gue a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones. Titulos de deuda y acciones disintos a los Activos Lúquidos Elegibies (que no se encuentren en situación de impago). Considerades (que no se encuentren en situación de impago). Considerades (que no se encuentren en situación de impago). Considerades (commodites) Considerades (commodites) Considerades (commodites) Considerades (fisicamente, incluyendo oro. Considerades (fisicamente) Consid | 22 | | | | | | | | | | | - |
| 23 gual a 35% de acuerdo al Método Estándar estableción en las Disposiciones. | | | | | | | | | | | | |
| Titulos de deude y acciones distintos a los Activos Légibles (que no se encuentren en situación de impago). 25 Activos interdependientes. 26 Otros Activos interdependientes. 27 Materias primas básicas (commodities) comercializades fisicamente, incluyendo oro. Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidade contrapartes centrales. 28 Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto. Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 303,108 56,627 1,139 7,380 9,528 303,108 56,777 1,139 7,527 9,61 | 23 | igual a 35% de acuerdo al Método Estándar | | | - | | - | | - | | - | - |
| Liquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de imagon) | | | | | | | | | | | | |
| Situación de impago). 2 | 24 | | | | - | | _ | | | | | - |
| 27 Materias primas básicas (commodities) | | situación de impago). | | | | | | | | | | |
| Materias primas básicas (commodities) Comercializados lisicamente, inclujendo oro. | | | - | | - | | - | - | - | - | - | - |
| Comercializadas fisicamente, incluyendo oro. | | | 303,001 | 46,721 | 1,139 | 4,331 | 8,549 | 303,001 | 46,721 | 1,139 | 4,331 | 8,549 |
| 28 | 27 | comercializadas físicamente, incluyendo oro. | | | - | | - | | - | | - | - |
| Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto. 19,221 1,139 4,331 2,318 1,139 4,331 2,318 1,139 4,331 2,318 1,139 4,331 2,318 1,139 | | | | | | | | | | | | |
| Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Reto. Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto. Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorás anteriores. 23. Operaciones fuera de balance. Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido. 30. 31. 23. 31. 33. 33. 33. 33. 33. 33. 33. 33. 3 | 28 | | 5 | - | | - | 4 | 5 | - | - | - | 4 |
| Financiamiento Estable Neto. 19,221 - | | | | | | | | | | | | |
| Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de 50 50 50 50 50 50 50 5 | 29 | | 19,221 | - | | - | 5,451 | 19,221 | | | - | 5,451 |
| Dor la variación del margen inicial Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorias anteriores 1,139 1,139 1,139 1,331 2,318 1,139 1,331 2,318 1,139 1,331 2,318 1, | | | | | | | | | | | | |
| 31 Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 32 Operaciones fuera de balance. 33 Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido. 30 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 10 | 30 | | 283,775 | - | | - | 775 | 283,775 | - | | - | 775 |
| 10 categorás anteriores. 32 Operaciones fuera de balance. Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido. 33 Requerido. 34 1,139 1,331 2,310 1,331 2,310 1,331 2 | | | | | | | | | | | | |
| 33 Total de Monto de Financiamiento Estable 303,108 56,627 1,139 7,380 9,528 303,108 56,777 1,139 7,527 9,61 | | | - | 46,721 | 1,139 | 4,331 | 2,318 | - | 46,721 | 1,139 | 4,331 | 2,318 |
| 33 Requerido. 303,108 56,627 1,139 7,380 9,528 303,108 56,777 1,139 7,527 9,61 | 32 | | - | - | - | - | - | | | | - | |
| | 33 | | 303,108 | 56,627 | 1,139 | 7,380 | 9,528 | 303,108 | 56,777 | 1,139 | 7,527 | 9,610 |
| | 34 | Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%). | | | | | 137.19 | | | | | 136.02 |



Información cualitativa

La métrica del Coeficiente de Fondeo Estable Neto para Barclays Bank México se reporta al 141.36% para el cierre del tercer trimestre de 2022 (137.19% promedio de los tres meses del tercer trimestre del año en curso), con un Financiamiento Estable Disponible de \$14.1 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por 9.9 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 146.01% reportado al cierre del trimestre anterior. 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 140.26% al cierre de septiembre (136.02% promedio de los tres meses del tercer 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.