

## 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

(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	
<b>Elementos del MONTO DE Financiamiento Estable Disponible</b>										
1 Capital:	8,979	-	-	-	8,979	8,979	-	-	-	8,979
2 Capital fundamental y capital básico no fundamental.	8,979	-	-	-	8,979	8,979	-	-	-	8,979
3 Otros instrumentos de capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4 Depósitos minoristas:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5 Depósitos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6 Depósitos menos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7 Financiamiento mayorista:	-	7,919	2,517	-	4,082	-	7,919	2,517	-	4,082
8 Depósitos operacionales.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9 Otro financiamiento mayorista.	-	7,919	2,517	-	4,082	-	7,919	2,517	-	4,082
10 Pasivos interdependientes	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11 Otros pasivos:	-	3,090	-	-	-	-	3,090	-	-	-
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.	-	3,090	-	-	-	-	3,090	-	-	-
14 <b>Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible</b>	8,979	11,009	2,517	-	13,071	8,979	11,009	2,517	-	13,071
<b>Elementos del MONTO DE Financiamiento Estable Requerido</b>										
15 Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	107	6,062	-	3,049	506	107	6,062	-	3,196	513
16 Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	-	222	-	-	111	-	372	-	-	186
17 Préstamos al corriente y valores:	-	3,622	-	-	362	-	3,622	-	-	362
18 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	-	3,622	-	-	362	-	3,622	-	-	362
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 encuentren en situación de impago).	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
25 Activos interdependientes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26 Otros Activos:	303,001	46,721	1,139	4,331	8,549	303,001	46,721	1,139	4,331	8,549
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.	19,221	-	-	-	5,451	19,221	-	-	-	5,451
30 Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	283,775	-	-	-	775	283,775	-	-	-	775
31 Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.	-	46,721	1,139	4,331	2,318	-	46,721	1,139	4,331	2,318
32 Operaciones fuera de balance.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
33 <b>Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.</b>	303,108	56,627	1,139	7,380	9,528	303,108	56,777	1,139	7,527	9,610
34 <b>Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).</b>	-	-	-	-	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.