

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

Revelación de información relativa al Coeficiente de Financiamiento 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 31 de Diciembre 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	9,112	-	-	-	9,112	9,112	-	-	-	9,112
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	9,112	-	-	-	9,112	9,112	-	-	-	9,112
3	Otros instrumentos de capital.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	Depósitos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	Depósitos menos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	Financiamientos mayorista	-	5,866	793	1,882	5,111	-	5,866	793	1,882	5,111
7	Depósitos operacionales.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
8	Otro financiamiento mayorista	-	5,866	793	1,882	5,111	-	5,866	793	1,882	5,111
9	Pasivos interdependientes	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	Otros pasivos	-	3,001	-	-	-	-	3,001	-	-	-
11	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
12	Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	-	3,001	-	-	-	-	3,001	-	-	-
13	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	9,112	8,867	793	1,882	14,223	9,112	8,867	793	1,882	14,223
Elementos del MONTO DE Financiamiento Estable Requerido											
14	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	107	5,671	-	2,419	438	107	5,671	-	2,564	445
15	Depósitos sin cargo, instituciones financieras, contrapartes operacionales.	-	219	-	-	109	-	382	-	-	191
16	Depósitos a la orden y a plazo.	-	7,160	-	-	716	-	7,160	-	-	716
17	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	-	7,160	-	-	716	-	7,160	-	-	716
18	Financiamiento otorgado a entidades financieras garantizado con activos líquidos elegibles distintos de nivel I, y financiamiento otorgado a entidades financieras no garantizado.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	Financiamiento otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
20	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
21	Créditos a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
22	Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
23	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
24	Activos interdependientes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
25	Otros activos	303,139	27,633	122	3,502	8,843	303,139	27,633	122	3,502	8,843
26	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales.	5	-	-	-	4	5	-	-	-	4
28	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	21,387	-	-	-	7,846	21,387	-	-	-	7,846
29	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial.	281,747	-	-	-	782	281,747	-	-	-	782
30	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.	-	27,633	122	3,502	211	-	27,633	122	3,502	211
31	Operaciones fuera de balance.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
32	Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	303,246	40,683	122	5,921	10,107	303,246	40,847	122	6,066	10,196
33	Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).	-	-	-	-	140.73	-	-	-	-	139.50

Información cualitativa

La métrica del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto para Barclays Bank México es de 144.36% al cierre del cuarto trimestre de 2022, con un Financiamiento Estable Disponible de \$16 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por \$11.1 mil millones de pesos.

El Coeficiente de Financiamiento Estable Neto promedio del cuarto trimestre es de 140.73%, con un Financiamiento Estable Disponible de \$14.2 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por 10.1 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 del trimestre, comparado con el cierre del trimestre anterior, presenta una variación explicada 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 145.59% al cierre del cuarto trimestre, con un Financiamiento Estable Disponible de \$16 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por \$10.9 mil millones de pesos.

El Coeficiente de Financiamiento Estable Neto Consolidado promedio del cuarto trimestre es de 139.50%, con un Financiamiento Estable Disponible de \$14.2 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por 10.2 mil millones.

La variación en el Financiamiento Estable Requerido Individual y Consolidado está relacionada 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.