

## 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 1-0 Bis cifras al 30 de septiembre de 2022.

### 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)	49,690
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>49,690</b>
<b>Exposiciones a instrumentos financieros derivados</b>		
4	Costo actual de reemplazo asociado a <i>todas</i> las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	10,796
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	13,978
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)	(11,201)
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>13,574</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	3,155
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>3,155</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	9,114
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	66,419
<b>Coefficiente de apalancamiento</b>		
22	<b>Coefficiente de apalancamiento de Basilea III</b>	<b>13.72%</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	97,273
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	(30,854)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	-
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	-
7	Otros ajustes	-
8	<b>Exposición del coeficiente de apalancamiento</b>	<b>66,419</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	97,273
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(44,428)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(3,155)
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>49,690</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>	8,764	9,114	4.00%
Activos Ajustados <sup>2/</sup>	60,156	66,419	10.41%
<b>Razón de Apalancamiento <sup>3/</sup></b>	<b>14.57%</b>	<b>13.72%</b>	<b>-0.85%</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 2022 un capital básico con un monto de \$9,114 millones de pesos, y un Activo Ajustado por la metodología de razón de apalancamiento de \$66,419 millones de pesos. Contando con una razón de apalancamiento de 13.72% por lo que se cuenta con un capital sólido.

Durante el tercer trimestre de 2022 el Capital Básico aumentó 350 millones de pesos principalmente por resultado neto generado durante el trimestre. A continuación, se explica el detalle del resultado por rubro:

El margen financiero aumentó con respecto al trimestre anterior, presentando una utilidad de MXN179mm durante el tercer trimestre, los conceptos que generaron este ingreso corresponden a intereses devengados de la posición propia en bonos gubernamentales e intereses de operaciones de reporto. El gasto correspondiente a comisiones pagadas fue de MXN28mm durante el tercer trimestre de 2022.

En lo que respecta al resultado por intermediación, este trimestre presentó una disminución en el ingreso con respecto al trimestre anterior generando una utilidad de MXN179mm en el tercer trimestre, el ingreso se compone principalmente por los rubros de títulos para negociar, productos derivados y compra-venta de divisas. Este último, tiene su movimiento en el resultado por valuación de las posiciones vigentes de derivados, durante el trimestre hubo actividad relevante con respecto a las terminaciones de operaciones de derivados debido a las condiciones económicas presentadas en el trimestre, así como el esquema de bonos como colateral establecido en el CSA que el banco tiene con las Siefos.

El rubro de otros ingresos presentó un resultado positivo de MXN278mm durante el trimestre debido a operaciones asesoría y de Precios de Transferencia relacionadas a Central Transfer Pricing.

En el rubro de gastos de administración los principales movimientos que explican los MXN249mm incurridos durante el tercer trimestre son: servicios pagados a compañías del Grupo, salarios, gastos de operación y mantenimiento del edificio, impuestos retenidos por operaciones, servicios profesionales, Otros impuestos – IVA deducible, entre otros.

Los impuestos generados en el mes de septiembre ascienden a MXN34mm.

En lo que respecta al rubro de impuestos, la variación del impuesto causado proviene de la realización de las valuaciones en productos derivados ligadas a las terminaciones anticipadas. La variación del impuesto diferido a favor generado en el periodo se originó por las valuaciones fiscales de los derivados, la cual asciende a MXN117mm en el trimestre.

El movimiento a la utilidad neta del tercer trimestre fue de MXN350mm y la utilidad acumulada al cierre de septiembre fue de MXN770mm.

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.