

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 Marzo de 2023.

Tabla I.3

Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto

Comparison Comparison Compa			Cifras Individuales					Cifras Consolidadas				
Cultis of Influence set pleases Set and Confidence			Importe sin ponderar por plazo residual					· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·				loopede
1 Capital		(Cifras en millones de pesos)		< 6 meses		eses a >1 año po			< 6 meses		≥1 año	Importe ponderado
2 Capital fundamental y capital básico no fundamental 9,165	Element		authorite de la constitution de									
3 Opposition contained	1						1		-		-	9,16
4	2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	9,165	-	-	-	9,165	9,165	-	-	-	9,16
5		Otros instrumentos de capital.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6 Opposition permon establishes			-	-	-		-	-	-		-	-
7 Franciscimento magnosista 4,999 533 2,783 4,899 533 2,783 2,783 2,783 3,884 3,895 3,885	_				1							
Society Soci	7		-	4,989		533	2,783		4,989		533	2,78
10 Crises passives y recurrous propose on includose 2,409 2,409 2,409	8		-	-	-		-	-	-		-	-
19 Passaros para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Noto 2,469			-	4,989	-	533	2,783	-	4,989	-	533	2,78
12 Passvos por derivados para fines del Coefficiente de Financiamento Estable Medio 1.7			-	2 400	-	-	-	-	2 400		-	-
1 Francamento Estable Neto			-	2,405					2,403			-
1-1	12	Financiamiento Estable Neto	-								-	
Total del Monto de Financiamiento Estable 9,165 7,398 533 11,948 9,165 7,398 533 11,948 11,948 9,165 7,398 533 11,948	13		-	2,409					2,409			
Disponible												
161 Confedence de Financieranic Estable Neto 101 4,809 2,249 353 101 4,809 2,385 3 3 3 3 3 3 3 3 3	14		9,165	7,398		533	11,948	9,165	7,398		533	11,94
Depésites en étas institucires financiamento Estable Neto 10.1	Element	os del MONTO DE Financiamiento Estable Requei	ido									
December on inhancement or particular stancers or companies of the compa	15		101	4,809	-	2,249	353	101	4,809		2,385	360
10 propóstos operacionales												
Financiamento garantizado otorgado a entidades financieras garantizado con activos fequidos elegibles de tinerio.	16		-	102	-		51	-	242		-	12:
Financieras con activos figuidos elegíbles de nivel	17		-	8,459	-	-	846	-	8,459	-	-	840
Financiamiento lotorgado a entidades financieras garantado con activos figuidos elegibles distintos de nivel I, y financiamiento otorgado a entidades financieras no garantado. Financiamiento otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras no garantado.	18		-	8,459	-	-	846	-	8,459		-	846
garantizado con activos líquidos elegibles distinios de ne ne de viete l y financiemiento lotrogado a entidades financieras no garantizado.												
de nivel I, y mancramiento otorgado a entidades financieras no granifizado. 20 Financiamiento otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras las cuales: Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o gran riesgo de crédito de Basilea II. Ciréditos a la Vivineida (en etapas 1 y 2), de los cuales: Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o gran de creditos a la Vivineida (en etapas 1 y 2), de los cuales: Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o gran de creditos a la Vivineida (en etapas 1 y 2), de los cuales: Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o gran de creditos a la Vivineida (en etapas 1 y 2), de los cuales: Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o gran de creditos de decidos que contrabe de decido en las Disposiciones. Titulos de deuda y acciones distintos a los Activos Liquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). 25 Activos interdependientes. 26 Otros Activos interdependientes. 27 Materias primas básicas (commodities) comercializadas fisicamente, incluyendo oro. Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales. 28 Activos pro derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto. 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 calegorías anteriores. 39,977 801 7,898 688 39,977 801 10,147 8,150 297,023 53,487 801 10,283 8,500 20,000	10		_				_	_				_
Financiamiento totogado a contrapartes distintas de entidades financieras las acuales:	10											
Entidades financieras, las cuales Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% 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 igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecidos 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 Titulos de deuda y acciones distintos a los Activos Liquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago)												
21	20		-	-	-			-				-
Tespo de crédito a Basiliea II. Créditos a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales. Créditos a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales. Créditos a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales. Creditos a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales. Creditos a la Sisposiciones Creditos a situación de inspisosiciones. Creditos de deude y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). Creditos Elegibl	04											
Créditos a la Vivienda (en etapas 1 y 2), de los cuales: Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o gual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones: Titulos de deuda y acciones distintos a los Activos Luquidos Elegibies (que no se encuentren en situación de impago). Activos interdependientes. 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,500 296,923 296,92	21		-	-	-			-				-
Cubasis Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o gual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones	20											
23 squal a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones	22		-								-	-
Establecido en las Disposiciones	23							_				
Titulos de deuda y acciones distintos a los Activos Lugidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago). 25 Activos interdependientes. 26 Otros Activos. 27 Materias primas básicas (commodites) comercializadas fisicamente, incluyendo oro. Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de petridias de contrapartes centrales. 28 Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto on Servicial de Monto de Imagen inicial otros sacrivos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 30 Operaciones fuera de balance. 31 Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 32 Operaciones fuera de balance. 33 Todos de de Financiamiento Estable Requerido.	20		_	-	_	-	_		-	-	-	
Situación de impago)		Titulos de deuda y acciones distintos a los Activos										
Activos interdependientes	24		-	-	-	-	-	-	-	-	-	
27 Materias primas básicas (commodifies) 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 39,977 801 7,898 6,900 296,923 29	25		_		-			_				
Comercializadas fisicamente, incluvendo oro.	26		296,923	39,977	801	7,898	6,900	296,923	39,977	801	7,898	6,90
Comercializadas Insicialmente, incluyendo orio.	27		-		-			-				
Instrumentos financieros derivados y contribuciones a la fondo de absorción de pérdidas de contrapartes 5												
a frondo e asoricon de periolas de contrajartes centrales e controles acontroles e controles e centrales e controles e control	20											
Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto. Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto. 18,594 5,484 18,594 18	28		3		-		"]				
Financiamiento Estable Neto 16,394 1												
Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de	29		18,594	-	-	-	5,484	18,594	-		-	5,48
Dor la variación del margen inicial Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorias anteriores Signatura		Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de										
1 Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 2 Operaciones fuera de bialance. 3 Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido. 3 Total de Monto de Financiamiento Estable 297,023 53,347 801 10,147 8,150 297,023 53,487 801 10,283 8,487	30		278,323	-	-	-	724	278,323	-	-	-	72
Categorias anteriores. SJ,777 SU T,050 Categorias anteriores. SJ,777												
Total de Monto de Financiamiento Estable 297,023 53,347 801 10,147 8,150 297,023 53,487 801 10,283 8,1		categorías anteriores.	-	39,977	801	7,898	688	-	39,977	801	7,898	68
33 Requerido. 297,023 53,347 801 10,147 8,150 297,023 53,487 801 10,283 8,5	32		-	-			-	-			-	
	33		297,023	53,347	801	10,147	8,150	297,023	53,487	801	10,283	8,22
	0.4											145.2



Información cualitativa

La métrica del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto para Barclays Bank México es de 145.47% al cierre del primer trimestre de 2023, con un Financiamiento Estable Disponible de \$12.5 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por \$8.6 mil millones de pesos.

El Coeficiente de Financiamiento Estable Neto promedio del trimestre es de 146.60%, con un Financiamiento Estable Disponible de \$11.9 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por 8.1 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, se mantiene estable y 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 144.52% al cierre del trimestre, con un Financiamiento Estable Disponible de \$12.5 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por \$8.6 mil millones de pesos.

El Coeficiente de Financiamiento Estable Neto Consolidado promedio del trimestre es de 145.24%, con un Financiamiento Estable Disponible de \$11.9 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por 8.2 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.