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

	(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:	9,165	-	-	-	**9,165**	9,165	-	-	-	**9,165**
2	*Capital fundamental y capital básico no fundamental.*	9,165	-	-	-	**9,165**	9,165	-	-	-	**9,165**
3	*Otros instrumentos de capital.*	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	Depósitos minoristas:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	*Depósitos estables.*	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	*Depósitos menos estables.*	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	Financiamiento mayorista:	-	4,989	-	533	**2,783**	-	4,989	-	533	**2,783**
8	*Depósitos operacionales.*	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	*Otro financiamiento mayorista.*	-	4,989	-	533	**2,783**	-	4,989	-	533	**2,783**
10	Pasivos interdependientes:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	Otros pasivos:	-	2,409	-	-	-	-	2,409	-	-	-
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.*	-	2,409	-	-	-	-	2,409	-	-	-
14	**Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible**	9,165	7,398	-	533	**11,948**	9,165	7,398	-	533	**11,948**
Elementos del MONTO DE Financiamiento Estable Requerido											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	101	4,809	-	2,249	**353**	101	4,809	-	2,385	**360**
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	-	102	-	-	**51**	-	242	-	-	**121**
17	Préstamos al corriente y valores:	-	8,459	-	-	**846**	-	8,459	-	-	**846**
18	*Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.*	-	8,459	-	-	**846**	-	8,459	-	-	**846**
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:	296,923	39,977	801	7,898	**6,900**	296,923	39,977	801	7,898	**6,900**
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*	18,594	-	-	-	**5,484**	18,594	-	-	-	**5,484**
30	*Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial*	278,323	-	-	-	**724**	278,323	-	-	-	**724**
31	*Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.*	-	39,977	801	7,898	**688**	-	39,977	801	7,898	**688**
32	Operaciones fuera de balance:	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
33	**Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.**	297,023	53,347	801	10,147	**8,150**	297,023	53,487	801	10,283	**8,226**
34	**Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).**	-	-	-	-	**146.60**	-	-	-	-	**145.24**

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.