

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 30 de Septiembre 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	9,584	-	-	-	9,584	9,584	-	-	-	9,584
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental	9,584	-	-	-	9,584	9,584	-	-	-	9,584
3	Otros instrumentos de capital	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	Depósitos minoristas	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	Depósitos estables	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	Depósitos menos estables	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	Financiamiento mayorista	-	11,065	234	287	5,821	-	11,065	234	287	5,821
8	Depósitos operacionales	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	Otro financiamiento mayorista	-	11,065	234	287	5,821	-	11,065	234	287	5,821
10	Pasivos interdependientes	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	Otros pasivos	-	4,937	-	-	-	-	4,937	-	-	-
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	-	4,937	-	-	-	-	4,937	-	-	-
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	9,584	16,002	234	287	15,405	9,584	16,002	234	287	15,405
Elementos del MONTO DE Financiamiento Estable Requerido											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	101	11,178	-	519	637	101	11,178	-	655	643
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales	-	129	-	-	64	-	292	-	-	146
17	Préstamos al corriente y valores	-	14,178	-	-	1,418	-	14,178	-	-	1,418
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I	-	14,178	-	-	1,418	-	14,178	-	-	1,418
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	Titulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
25	Activos interdependientes	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
26	Otros Activos	290,265	44,277	498	10,580	9,355	290,265	44,277	498	10,580	9,355
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	16,417	-	-	-	7,029	16,417	-	-	-	7,029
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	273,842	-	-	-	663	273,842	-	-	-	663
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores	-	44,277	498	10,580	1,659	-	44,277	498	10,580	1,659
32	Operaciones fuera de balance	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
33	Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido	290,366	69,762	498	11,098	11,474	290,366	69,926	498	11,234	11,563
34	Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%)	-	-	-	-	134.26	-	-	-	-	133.23

Información cualitativa

La métrica del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto para Barclays Bank México es de 128.74% al cierre del segundo trimestre de 2023, con un Financiamiento Estable Disponible de \$13.9 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por \$10.8 mil millones de pesos.

El Coeficiente de Financiamiento Estable Neto promedio del trimestre es de 134.26%, con un Financiamiento Estable Disponible de \$15.4 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por 11.5 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 y reportos con títulos de deuda, así como los movimientos de mercado reflejados en el valore del portafolio de derivados.

En términos consolidados, el Coeficiente de Fondeo Estable Neto se ubica en 127.81% al cierre del trimestre, con un Financiamiento Estable Disponible de \$13.9 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 trimestre es de 133.23%, con un Financiamiento Estable Disponible de \$15.4 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por 11.6 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.