

## 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 2023.

### I. Integración de las principales fuentes de apalancamiento.

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)	47,866
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>47,866</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)	7,327
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	12,424
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)	(11,468)
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>8,283</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	14,955
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>14,955</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	9,710
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	71,104
<b>Coefficiente de apalancamiento</b>		
22	<b>Coefficiente de apalancamiento de Basilea III</b>	<b>13.66%</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	94,701
	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
2	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	-
3		
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	(23,597)
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>71,104</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	94,701
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(31,880)
3	Operaciones en reporto y préstamos de valores	(14,955)
	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento	-
4		
5	<b>Exposiciones dentro del Balance</b>	<b>47,866</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>	9,369	9,710	3.64%
Activos Ajustados <sup>2/</sup>	71,229	71,104	-0.18%
<b>Razón de Apalancamiento <sup>3/</sup></b>	<b>13.15%</b>	<b>13.66%</b>	<b>0.50%</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 primer trimestre de 2023 un capital básico con un monto de \$9,710 millones de pesos, y un Activo Ajustado por la metodología de razón de apalancamiento de \$71,104 millones de pesos. Contando con una razón de apalancamiento de 13.66% por lo que se cuenta con un capital sólido.

Durante el tercer trimestre de 2023 el Capital Básico aumentó 341 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 MXN250mm durante el segundo trimestre, los conceptos que generaron este aumento corresponden a los intereses cobrados en operaciones de reporto y al préstamo interbancario vigente durante el trimestre.

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 MXN106mm en el segundo trimestre, el ingreso se compone principalmente por los rubros de títulos para negociar, productos derivados y compra-venta de divisas. Esta variación se originó por la apreciación del peso contra otras divisas y a las tasas de intereses en el mercado.

El rubro de otros ingresos presentó un resultado positivo de MXN340mm durante el trimestre debido a operaciones con partes relacionadas sujetas a precios de transferencia.

En el rubro de gastos de administración los principales movimientos que explican los MXN230mm incurridos durante el segundo trimestre son: servicios de infraestructura a compañías del Grupo, sueldos y salarios, gastos de operación y mantenimiento del edificio, servicios de asesoría y servicios profesionales, entre otros.

Los impuestos generados en el mes de septiembre ascienden a MXN189mm.

En lo que respecta al rubro de impuestos, la variación del impuesto causado proviene principalmente de las valuaciones en productos derivados. La variación del impuesto diferido asciende a MXN62mm en el trimestre.

El movimiento a la utilidad neta del tercer trimestre fue de MXN342mm y la utilidad acumulada al cierre de junio fue de MXN808mm.

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.