

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 junio de 2024.

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	9,730	-	-	-	9,730	9,730	-	-	-	9,730
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	9,730	-	-	-	9,730	9,730	-	-	-	9,730
3	Otros instrumentos de capital.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	Depósitos a plazo.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	Depósitos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	Depósitos menos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	Financiamiento pasivo.	-	16,326	-	-	4,960	-	16,326	-	-	4,960
8	Depósitos operacionales.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	Otro financiamiento mayorista.	-	16,326	-	-	4,960	-	16,326	-	-	4,960
10	Pasivos interdependientes.	-	34	-	-	-	-	34	-	-	-
11	Otros pasivos.	-	729	-	-	-	-	729	-	-	-
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.	-	729	-	-	-	-	729	-	-	-
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	9,730	17,089	-	-	14,690	9,730	17,089	-	-	14,690
Elementos del MONTO DE Financiamiento Estable Requerido											
15	Activos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	101	15,948	-	1,747	937	101	15,948	-	1,949	947
16	Depósitos en otras instituciones financieras por propiedades de garantía.	-	97	-	-	48	-	227	-	-	114
17	Depósitos al depositante y cedentes.	-	17,443	-	-	1,744	-	17,443	-	-	1,744
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	-	17,443	-	-	1,744	-	17,443	-	-	1,744
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.	-	34	-	-	-	-	34	-	-	-
26	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.	543,692	44,982	991	11,697	7,256	543,692	44,982	991	11,697	7,256
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	555	-	-	-	472	555	-	-	-	472
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	11,789	-	-	-	3,999	11,789	-	-	-	3,999
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	531,348	-	-	-	585	531,348	-	-	-	585
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.	-	44,982	991	11,697	2,200	-	44,982	991	11,697	2,200
32	Todos los recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
33	Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	543,793	78,504	991	13,443	9,985	543,793	78,635	991	13,646	10,061
34	Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).	-	-	-	-	147.12	-	-	-	-	146.01

Información cualitativa

La métrica del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto para Barclays Bank México es de 171.77% al cierre del segundo trimestre de 2024, con un Financiamiento Estable Disponible de \$19.12 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por \$11.12 mil millones de pesos.

El Coeficiente de Financiamiento Estable Neto promedio del trimestre es de 147.12%, con un Financiamiento Estable Disponible de \$14.7 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por \$9.98 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 valor del portafolio de derivados.

En términos consolidados, el Coeficiente de Fondeo Estable Neto se ubica en 170.56% al cierre del trimestre, con un Financiamiento Estable Disponible de \$19.12 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por \$11.21 mil millones de pesos.

El Coeficiente de Financiamiento Estable Neto Consolidado promedio del trimestre es de 146.01%, con un Financiamiento Estable Disponible de \$14.7 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por \$10.06 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 títulos gubernamentales de la Casa de Bolsa.