

Barclays Bank México, S.A. Institución de Banca Múltiple

Revelación de información relativa al Coeficiente de Fondo 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 2022.

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	8,622	-	-	-	8,622	8,622	-	-	-	8,622
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	8,622	-	-	-	8,622	8,622	-	-	-	8,622
3	Otros instrumentos de capital.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	Depósitos minoristas.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	Depósitos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	Depósitos menos estables.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7	Financiamiento mayorista.	-	1,632	-	-	-	-	1,632	-	-	-
8	Depósitos operacionales.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	Otro financiamiento mayorista.	-	1,632	-	-	-	-	1,632	-	-	-
10	Pasivos interdependientes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
11	Otros pasivos:	788	1,903	-	-	-	788	1,903	-	-	-
12	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	788	-	-	-	-	788	-	-	-	-
13	Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	-	1,903	-	-	-	-	1,903	-	-	-
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	9,409	3,534	-	-	8,622	9,409	3,534	-	-	8,622
Elementos del MONTO DE Financiamiento Estable Requerido											
15	Total de activos líquidos elegibles para el cálculo del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	108	1,634	-	3,243	294	108	1,634	-	3,291	296
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósito operacionales.	-	102	-	-	51	-	147	-	-	74
17	Prestamos al comercio y al exterior.	-	4,893	-	-	489	-	4,893	-	-	489
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	-	4,893	-	-	489	-	4,893	-	-	489
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 de 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:	273,315	45,784	321	7,361	3,301	273,315	45,784	321	7,361	3,301
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.	8,082	-	-	-	429	8,082	-	-	-	429
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial.	265,228	-	-	-	1,296	265,228	-	-	-	1,296
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.	-	45,784	321	7,361	1,572	-	45,784	321	7,361	1,572
32	Operaciones fuera de balance.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
33	Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	273,423	52,413	321	10,604	4,136	273,423	52,458	321	10,652	4,160
34	Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).	-	-	-	-	208.48	-	-	-	-	207.23

Información cualitativa

La métrica del Coeficiente de Fondo Estable Neto para Barclays Bank México se reporta al 223.7% para el cierre del 1er trimestre de 2022 (208.48% promedio de los tres meses del año en curso), con un Financiamiento Estable Disponible de \$8.68 mil millones de pesos y un Financiamiento Estable Requerido por 3.95 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 Fondo Estable Neto reportado al cierre de marzo 2022 se compara con el 338.0% reportado al cierre del cuarto trimestre de 2021. La variación trimestre contra trimestre se explica 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 Fondo Estable Neto se ubica en 219.7% al cierre de marzo (207.23% promedio de los tres meses del año en curso), debido a que el Financiamiento Estable Requerido se incrementa mientras que el Financiamiento Estable Disponible se mantiene estable.

El incremento en el Financiamiento Estable Requerido está relacionado 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.

