

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

### I Integración del Capital Neto

TABLA I.1 Integración del capital sin considerar la transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios

| Referencia  | Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas  | Monto               |
|---|---|---------------------|
| 1   | Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente  | 3,909,218.49        |
| 2   | Resultados de ejercicios anteriores   | 3,998,340.47        |
| 3   | Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)  | 1,176,104.77        |
| 4   | Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1 (solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones)  | No aplica           |
| 5   | Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital común de nivel 1)  | No aplica           |
| 6   | <b>Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>   | 9,083,663.72        |
| <b>Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios</b> |   |                     |
| 7   | Ajustes por valuación prudencial  | No aplica           |
| 8   | Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)  | -                   |
| 9   | Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)   | 315,807.19          |
| 10<br>(conservador)                                   | Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) | <b>501,688.74</b>   |
| 11  | Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo  | 252,207.54          |
| 12  | Reservas pendientes de constituir   | -                   |
| 13  | Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización   | -                   |
| 14  | Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable  | No aplica           |
| 15  | Plan de pensiones por beneficios definidos  |                     |
| 16<br>(conservador)                                   | Inversiones en acciones propias   |                     |
| 17<br>(conservador)                                   | Inversiones recíprocas en el capital ordinario  | <b>1,288,744.52</b> |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

|                     |   |              |
|---------------------|---|--------------|
| 18<br>(conservador) | Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)                      |              |
| 19<br>(conservador) | Inversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) |              |
| 20<br>(conservador) | Derechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%)  |              |
| 21                  | Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo)  |              |
| 22                  | Monto que excede el umbral del 15%  | No aplica    |
| 23                  | del cual: Inversiones significativas donde la institución posee mas del 10% en acciones comunes de instituciones financieras  | No aplica    |
| 24                  | del cual: Derechos por servicios hipotecarios   | No aplica    |
| 25                  | del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales   | No aplica    |
| 26                  | Ajustes regulatorios nacionales   | 195,957.11   |
| A                   | del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)  |              |
| B                   | del cual: Inversiones en deuda subordinada  |              |
| C                   | del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)   |              |
| D                   | del cual: Inversiones en organismos multilaterales  |              |
| E                   | del cual: Inversiones en empresas relacionadas  |              |
| F                   | del cual: Inversiones en capital de riesgo  |              |
| G                   | del cual: Inversiones en sociedades de inversión  |              |
| H                   | del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propias  |              |
| I                   | del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones  |              |
| J                   | del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados  | 195,957.11   |
| K                   | del cual: Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas   |              |
| L                   | del cual: Participación de los Trabajadores en las Utilidades Diferidas   |              |
| M                   | del cual: Personas Relacionadas Relevantes  |              |
| N                   | del cual: Plan de pensiones por beneficios definidos  |              |
| O                   | del cual: Ajuste por reconocimiento de capital  |              |
| 27                  | Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a la insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones   |              |
| 28                  | <b>Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1</b>   | 2,554,405.10 |
| 29                  | <b>Capital común de nivel 1 (CET1)</b>  | 6,529,258.63 |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2023



Miles MXN

### Capital adicional de nivel 1: instrumentos

|    |  |           |
|----|--|-----------|
| 30 | Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima   |           |
| 31 | de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables   |           |
| 32 | de los cuales: Clasificados como pasivo bajo los criterios contables aplicables  | No aplica |
| 33 | Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1   |           |
| 34 | Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el renglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1) | No aplica |
| 35 | del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual   | No aplica |
| 36 | <b>Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>  | -         |

### Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios

|                     |  |              |
|---------------------|--|--------------|
| 37<br>(conservador) | Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1  | No aplica    |
| 38<br>(conservador) | Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1   | No aplica    |
| 39<br>(conservador) | Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) | No aplica    |
| 40<br>(conservador) | Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido                             | No aplica    |
| 41                  | Ajustes regulatorios nacionales  | 0.00%        |
| 42                  | Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones  | No aplica    |
| 43                  | <b>Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1</b>  | 0.00%        |
| 44                  | <b>Capital adicional de nivel 1 (AT1)</b>  | -            |
| 45                  | <b>Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)</b>  | 6,529,258.63 |

### Capital de nivel 2: instrumentos y reservas

|    |  |           |
|----|--|-----------|
| 46 | Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima   |           |
| 47 | Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2   | -         |
| 48 | Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2) | No aplica |
| 49 | de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual  | No aplica |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2023



Miles MXN

|   |  |               |
|---|--|---------------|
| 50  | Reservas   | -             |
| 51  | <b>Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios</b>  | -             |
| <b>Capital de nivel 2: ajustes regulatorios</b> |  |               |
| 52<br>(conservador)                             | Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2  | No aplica     |
| 53<br>(conservador)                             | Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2   | No aplica     |
| 54<br>(conservador)                             | Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) | No aplica     |
| 55<br>(conservador)                             | Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido                                 | No aplica     |
| 56  | Ajustes regulatorios nacionales  | 0.00%         |
| 57  | <b>Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2</b>  | <b>0.00%</b>  |
| 58  | <b>Capital de nivel 2 (T2)</b>   | -             |
| 59  | <b>Capital total (TC = T1 + T2)</b>  | 6,529,258.63  |
| 60  | <b>Activos ponderados por riesgo totales</b>   | 43,763,606.09 |
| <b>Razones de capital y suplementos</b>         |  |               |
| 61  | Capital Común de Nivel 1<br>(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)   | 14.92%        |
| 62  | Capital de Nivel 1<br>(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)   | 14.92%        |
| 63  | Capital Total<br>(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)  | 14.92%        |
| 64  | Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón G-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) | 17%           |
| 65  | del cual: Suplemento de conservación de capital  | 2.50%         |
| 66  | del cual: Suplemento contracíclico bancario específico   | No aplica     |
| 67  | del cual: Suplemento de bancos globales sistémicamente importantes (G-SIB)   | No aplica     |
| 68  | Capital Común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)   | 7.92%         |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2023



Miles MXN

### Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)

|    |  |           |
|----|--|-----------|
| 69 | Razón mínima nacional de CET1<br>(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) | No aplica |
| 70 | Razón mínima nacional de T1<br>(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)   | No aplica |
| 71 | Razón mínima nacional de TC<br>(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)   | No aplica |

### Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)

|    |  |           |
|----|--|-----------|
| 72 | Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras   | No aplica |
| 73 | Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras  | No aplica |
| 74 | Derechos por servicios hipotecarios (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)   | No aplica |
| 75 | Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) | -         |

### Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2

|    |   |   |
|----|---|---|
| 76 | Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación del límite)              |   |
| 77 | Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada  | - |
| 78 | Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación del límite) |   |
| 79 | Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas  |   |

### Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)

|    |  |           |
|----|--|-----------|
| 80 | Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual                                    | No aplica |
| 81 | Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) | No aplica |
| 82 | Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual  |           |
| 83 | Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)  | -         |
| 84 | Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual   | -         |
| 85 | Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)   | -         |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

### II Ajuste por reconocimiento de capital

TABLA II.1 Impacto en el capital neto por el procedimiento contemplado en el Artículo 2 Bis de las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito

| Conceptos de capital                                | Sin ajuste por reconocimiento de capital | % APSRT          | Ajuste por reconocimiento de capital | Con ajuste por reconocimiento de capital | % APSRT          |
|---|--|------------------|--------------------------------------|--|------------------|
| Capital Básico 1                                    | 6,529,258.63                             | 14.92%           | 0.00%                                | 6,529,258.63                             | 14.92%           |
| Capital Básico 2                                    | -  | 0.00%            | 0.00%                                | -  | 0.00%            |
| Capital Básico                                      | 6,529,258.63                             | 14.92%           | 0.00%                                | 6,529,258.63                             | 14.92%           |
| Capital Complementario                              | -  | 0.00%            | 0.00%                                | -  | 0.00%            |
| Capital Neto  | 6,529,258.63                             | 14.92%           | 0.00%                                | 6,529,258.63                             | 14.92%           |
| Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) | 43,763,606.09                            | No aplica        | No aplica                            | 43,763,606.09                            | No aplica        |
| <b>Indice capitalización</b>                        | <b>14.92%</b>                            | <b>No aplica</b> | <b>No aplica</b>                     | <b>14.92%</b>                            | <b>No aplica</b> |

# ANEXO 1 - 0

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

### III Relación del Capital neto con el Balance General

TABLA III.1 Relación del Capital neto con el Balance General

| Referencia de los rubros del balance general | Rubros del balance general                                | Monto presentado en el balance general |
|--|---|--|
|  | <b>Activo</b>   |  |
| BG1  | Disponibilidades  | 2,891,956.00                           |
| BG2  | Cuentas de margen   | -                                      |
| BG3  | Inversiones en valores                                    | 25,130,524.00                          |
| BG4  | Deudores por reporto                                      | 6,403,964.00                           |
| BG5  | Préstamo de valores                                       | -                                      |
| BG6  | Derivados   | 7,032,963.00                           |
| BG7  | Ajustes de valuación por cobertura de activos financieros | - 796.00                               |
| BG8  | Total de cartera de crédito (neto)                        | 52,991,850.00                          |
| BG9  | Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización  | -                                      |
| BG10   | Otras cuentas por cobrar (neto)                           | 2,203,122.00                           |
| BG11   | Bienes adjudicados (neto)                                 | 716,565.00                             |
| BG12   | Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)                     | 15,407.00                              |
| BG13   | Inversiones permanentes                                   | 1,292,197.00                           |
| BG14   | Activos de larga duración disponibles para la venta       | 82,726.00                              |
| BG15   | Impuestos y PTU diferidos (neto)                          | 997,019.00                             |
| BG16   | Otros activos   | 865,117.00                             |
|  | <b>Pasivo</b>   |  |
| BG17   | Captación tradicional                                     | 54,508,665.00                          |
| BG18   | Préstamos interbancarios y de otros organismos            | 4,315,061.00                           |
| BG19   | Acreedores por reporto                                    | 16,221,962.00                          |
| BG20   | Préstamo de valores                                       | -                                      |

# ANEXO 1 - 0

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

|      |  |                |
|------|--|----------------|
| BG21 | Colaterales vendidos o dados en garantía                                 | 6,403,983.00   |
| BG22 | Derivados  | 6,626,624.00   |
| BG23 | Ajustes de valuación por cobertura de pasivos financieros                | -              |
| BG24 | Obligaciones en operaciones de bursatilización                           | -              |
| BG25 | Otras cuentas por pagar  | 3,290,114.00   |
| BG26 | Obligaciones subordinadas en circulación                                 | -              |
| BG27 | Impuestos y PTU diferidos (neto)   | 80,715.00      |
| BG28 | Créditos diferidos y cobros anticipados                                  | 207,892.00     |
|      | <b>Capital contable</b>  |                |
| BG29 | Capital contribuido  | 3,909,218.00   |
| BG30 | Capital ganado   | 4,817,809.00   |
|      | <b>Cuentas de orden</b>  |                |
| BG31 | Avales otorgados   | -              |
| BG32 | Activos y pasivos contingentes   | -              |
| BG33 | Compromisos crediticios  | 12,306,105.00  |
| BG34 | Bienes en fideicomiso o mandato  | 119,198,222.00 |
| BG35 | Agente financiero del gobierno federal                                   | -              |
| BG36 | Bienes en custodia o en administración                                   | 8,587.00       |
| BG37 | Colaterales recibidos por la entidad                                     | 6,410,868.00   |
| BG38 | Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad | 6,410,868.00   |
| BG39 | Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)          | -              |
| BG40 | Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida | 132,993.00     |
| BG41 | Otras cuentas de registro  | 249,899,290.00 |



# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA III.2 Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del capital neto

| Identificador | Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto  | Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo | Monto de conformidad con las notas a la tabla<br>Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto | Referencia(s) del rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo del Capital Neto proveniente de la referencia mencionada |
|---------------|--|---|--|--|
|               | <b>Activo</b>  |   |  |  |
| 1             | Crédito mercantil  | 8   | -  |  |
| 2             | Otros Intangibles  | 9   | 315,807.19   | BG16 865,117   |
| 3             | Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales  | 10  | -  |  |
| 4             | Beneficios sobre el remanente en operaciones de burzatilización  | 13  | -  |  |
| 5             | Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado                                      | 15  | -  |  |
| 6             | Inversiones en acciones de la propia institución   | 16  | -  |  |
| 7             | Inversiones recíprocas en el capital ordinario   | 17  | 1,288,744.52   | BG17 54,508,665  |
| 8             | Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido   | 18  | -  |  |
| 9             | Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido | 18  | -  |  |
| 10            | Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido      | 19  | -  |  |
| 11            | Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido    | 19  | -  |  |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2023



Miles MXN

TABLA III.2 Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del capital neto

|    |   |        |            |  |
|----|---|--------|------------|--|
| 12 | Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales | 21     | -          |  |
| 13 | Reservas reconocidas como capital complementario                                | 50     | -          | 0.6% activos ponderados por Rgo de Crédito |
| 14 | Inversiones en deuda subordinada  | 26 - B | -          |  |
| 15 | Inversiones en organismos multilaterales  | 26 - D | -          |  |
| 16 | Inversiones en empresas relacionadas  | 26 - E | -          |  |
| 17 | Inversiones en capital de riesgo  | 26 - F | -          |  |
| 18 | Inversiones en sociedades de inversión  | 26 - G | -          |  |
| 19 | Financiamiento para la adquisición de acciones propias                          | 26 - H | -          |  |
| 20 | Cargos diferidos y pagos anticipados  | 26 - J | 195,957.11 | BG16 865,117                               |
| 21 | Participación de los trabajadores en las utilidades diferida (neta)             | 26 - L | -          |  |
| 22 | Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos                      | 26 - N | -          |  |
| 23 | Inversiones en cámaras de compensación  | 26 - P |            |  |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA III.2 Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del capital neto

|           | Pasivo   |        |   |        |
|-----------|--|--------|---|--------|
| <b>24</b> | Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil                          | 8      | - |        |
| <b>25</b> | Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles                           | 9      |   |        |
| <b>26</b> | Pasivos del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado          | 15     |   |        |
| <b>27</b> | Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por beneficios definidos | 15     |   |        |
| <b>28</b> | Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los anteriores            | 21     |   |        |
| <b>29</b> | Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R  | 31     | - |        |
| <b>30</b> | Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital básico 2              | 33     | - |        |
| <b>31</b> | Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S  | 46     | - |        |
| <b>32</b> | Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario        | 47     | - | BG26 0 |
| <b>33</b> | Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados        | 26 - J |   |        |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

| <b>Capital contable</b>   |   |                |            |  |
|---|---|----------------|------------|--|
| 34  | Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q   | 1              | -          |  |
| 35  | Resultado de ejercicios anteriores  | 2              | -          | 0.6% activos ponderados por Rgo de Crédito |
| 36  | Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable         | 3              | -          |  |
| 37  | Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores   | 3              | -          |  |
| 38  | Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R   | 31             | -          |  |
| 39  | Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S   | 46             | -          |  |
| 40  | Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable      | 3, 11          | -          |  |
| 41  | Efecto acumulado por conversión   | 3, 26 - A      | -          |  |
| 42  | Resultado por tenencia de activos no monetarios   | 3, 26 - A      | 195,957.11 | BG16 865,117                               |
| <b>Cuentas de orden</b>   |   |                |            |  |
| 43  | Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas   | 26 - K         | -          |  |
| <b>Conceptos regulatorios no considerados en el balance general</b> |   |                |            |  |
| 44  | Reservas pendientes de constituir   | 12             | -          |  |
| 45  | Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras) | 26 - C         | -          |  |
| 46  | Operaciones que contravengan las disposiciones  | 26 - I         | -          |  |
| 47  | Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes  | 26 - M         | -          |  |
| 48  | Ajuste por reconocimiento de capital  | 26 - O, 41, 56 | -          |  |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA IV.1 Activos en Riesgos de Mercado

| Concepto  | Importe de posiciones equivalentes | Requerimiento de capital |
|---|------------------------------------|--------------------------|
| Operaciones en moneda nacional con tasa nominal   | 6,654,591                          | 532,367                  |
| Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable                    | 473,769                            | 37,902                   |
| Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's                                       | 9,037                              | 723                      |
| Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General | 8,301                              | 664                      |
| Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC  | 306                                | 24.48                    |
| Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del salario mínimo general  | 1,640                              | 131                      |
| Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal   | 88,593                             | 7,087                    |
| Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio  | 428,117                            | 34,249                   |
| Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupo de acciones             | 288,190                            | 23,055                   |
| Posiciones en Mercancías  | 1,407                              | 113                      |

# ANEXO 1 - O

Miles MXN

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024

TABLA IV.2 Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo

| Concepto                         | Activos ponderados por riesgo | Requerimiento de capital |
|----------------------------------|-------------------------------|--------------------------|
| Grupo I (ponderados al 0%)       | -                             | -                        |
| Grupo I (ponderados al 10%)      | -                             | -                        |
| Grupo I (ponderados al 20%)      | -                             | -                        |
| Grupo II (ponderados al 0%)      | -                             | -                        |
| Grupo II (ponderados al 10%)     | -                             | -                        |
| Grupo II (ponderados al 20%)     | -                             | -                        |
| Grupo II (ponderados al 50%)     | -                             | -                        |
| Grupo II (ponderados al 100%)    | -                             | -                        |
| Grupo II (ponderados al 120%)    | -                             | -                        |
| Grupo II (ponderados al 150%)    | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 2.5%)   | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 10%)    | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 11.5%)  | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 20%)    | 748,375.00                    | 59,870.00                |
| Grupo III (ponderados al 23%)    | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 50%)    | 18,125.00                     | 1,450.00                 |
| Grupo III (ponderados al 57.5%)  | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 115%)   | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 120%)   | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 138%)   | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 150%)   | -                             | -                        |
| Grupo III (ponderados al 172.5%) | -                             | -                        |
| Grupo IV (ponderados al 0%)      | -                             | -                        |
| Grupo IV (ponderados al 20%)     | 447,750.00                    | 35,820.00                |
| Grupo V (ponderados al 10%)      | -                             | -                        |
| Grupo V (ponderados al 20%)      | -                             | -                        |
| Grupo V (ponderados al 50%)      | -                             | -                        |
| Grupo V (ponderados al 115%)     | -                             | -                        |
| Grupo V (ponderados al 150%)     | -                             | -                        |
| Grupo VI (ponderados al 20%)     | 653,931.33                    | 52,314.51                |
| Grupo VI (ponderados al 50%)     | 2,729,296.75                  | 218,343.74               |
| Grupo VI (ponderados al 75%)     | 1,578,177.98                  | 126,254.24               |
| Grupo VI (ponderados al 100%)    | 609,000.00                    | 48,720.00                |
| Grupo VI (ponderados al 115%)    | 77,000.00                     | 6,160.00                 |
| Grupo VI (ponderados al 150%)    | -                             | -                        |
| Grupo VI (ponderados al 172.5%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_A (ponderados al 10%)  | -                             | -                        |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA IV.2 Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo

| Concepto  | Activos ponderados por riesgo | Requerimiento de capital |
|---|-------------------------------|--------------------------|
| Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)   | -                             | -                        |
| Grupo VII_A (ponderados al 20%)   | 975,500.00                    | 78,040.00                |
| Grupo VII_A (ponderados al 23%)   | -                             | -                        |
| Grupo VII_A (ponderados al 50%)   | 596,250.00                    | 47,700.00                |
| Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)   | -                             | -                        |
| Grupo VII_A (ponderados al 100%)  | 17,043,429.25                 | 1,363,474.34             |
| Grupo VII_A (ponderados al 115%)  | 722,375.00                    | 57,790.00                |
| Grupo VII_A (ponderados al 120%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_A (ponderados al 138%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_A (ponderados al 150%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 0%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 20%)   | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 23%)   | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 50%)   | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)   | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 100%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 115%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 120%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 138%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 150%)  | -                             | -                        |
| Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)  | -                             | -                        |
| Grupo VIII (ponderados al 125%)   | -                             | -                        |
| Grupo IX (ponderados al 100%)   | 5,137,375.00                  | 410,990.00               |
| Grupo IX (ponderados al 115%)   | 603,375.00                    | 48,270.00                |
| Grupo X (ponderados al 1250%)   | -                             | -                        |
| Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)                             | -                             | -                        |
| Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)                             | -                             | -                        |
| Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)                            | -                             | -                        |
| Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)                            | -                             | -                        |
| Bursatilizaciones con grado de Riesgo 4, 5, 6 o No calificados<br>(ponderados al 1250%) | -                             | -                        |
| Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)                           | -                             | -                        |
| Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)                          | -                             | -                        |
| Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)                          | -                             | -                        |
| Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)                          | -                             | -                        |
| Rebursatilizaciones con grado de Riesgo 5, 6 o No Calificados<br>(ponderados al 1250%)  | -                             | -                        |

# ANEXO 1 - O

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA IV.3 Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

| Método empleado             | Activos ponderados por riesgo | Requerimiento de capital |
|-----------------------------|-------------------------------|--------------------------|
| Método del Indicador Básico | 3,870                         | 310                      |

| Promedio del requerimiento por riesgo de mercado y de crédito de los últimos 36 meses | Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses |
|---|--|
| 0   | 0  |



# ANEXO 1 - O BIS

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA I.1 Formato Estandarizado de revelación para la razón de apalancamiento.

| REFERENCIA   | DESCRIPCION  | IMPORTE |
|--|--|---------|
| <b>Exposiciones dentro del balance</b>                   |  |         |
| 1  | Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamos de valores pero incluidos colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)              | 87,282  |
| 2  | Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea   | - 2,554 |
| 3  | Exposiciones dentro del Balance (netas) excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)  | 84,727  |
| <b>Exposiciones a instrumentos financieros derivados</b> |  |         |
| 4  | Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)   | 547     |
| 5  | Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados   | 139     |
| 6  | Incremento por colaterales aportados en operaciones con instrumentos 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 aportado en operaciones con instrumentos derivados  | 0       |
| 8  | Exposición por operaciones en instrumentos derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la contraparte central              |         |
| 9  | Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos derivados de crédito suscritos  |         |
| 10   | Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos |         |
| 11   | Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)  | 687     |

# ANEXO 1 - O BIS

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA I.1 Formato Estandarizado de revelación para la razón de apalancamiento.

| REFERENCIA  | DESCRIPCION  | IMPORTE |
|---|--|---------|
| <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 | 6,404   |
| 13  | Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas  | -       |
| 14  | Exposición de riesgo de contraparte por SFT  |         |
| 15  | Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros   |         |
| 16  | Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores ( suma de las lineas 12 a 15)                   | 6,404   |
| <b>Otras exposiciones fuera de balance</b>                        |  |         |
| 17  | Exposición fuera de balance (importe notional bruto)   | 12,306  |
| 18  | Ajuste por conversión a equivalentes crediticios   | -       |
| 19  | Partidas fuera del balance (suma de las lineas 17 y 18)  | 12,306  |
| <b>Capital y exposiciones totales</b>                             |  |         |
| 20  | Capital de nivel 1   | 6,529   |
| 21  | Exposiciones totales (suma de las lineas 3 ,11,16 y 19)  | 104,124 |
| <b>Coefficiente de apalancamiento</b>                             |  |         |
| 22  | Coefficiente de apalancamiento basilea III   | 6.27%   |

# ANEXO 1 – O BIS SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA II.1 Comparativo de los Activos Totales y Activos Ajustados

| REFERENCIA | DESCRIPCION   | IMPORTE |
|------------|---|---------|
| 1          | Activos totales   | 87,691  |
| 2          | 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 | - 1,289 |
| 3          | 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                            |         |
| 4          | Ajuste por instrumentos financieros derivados   | 687     |
| 5          | Ajuste por operaciones de reporto y prestamos de valores  | 5,994   |
| 6          | Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden   | 12,306  |
| 7          | Otros ajustes   | - 1,265 |
| 8          | Exposición del coeficiente de apalancamiento  | 104,124 |

# ANEXO 1 - O BIS

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA III.1 Conciliación entre Activo Total y la Exposición dentro del Balance

| REFERENCIA | DESCRIPCION  | IMPORTE |
|------------|--|---------|
| 1          | Activos totales  | 87,691  |
| 2          | Operaciones en instrumentos financieros derivados  | - 410   |
| 3          | Operaciones en reporto y prestamos de valores  | -       |
| 4          | Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento |         |
| 5          | Exposiciones dentro del balance  | 87,282  |

# ANEXO 1 – O BIS

## SEGUNDO TRIMESTRE 2024



Miles MXN

TABLA IV.1 Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la razón de apalancamiento.

| CONCEPTO/ TRIMESTRE     | Junio   | Marzo  | Variación % |
|-------------------------|---------|--------|-------------|
| Capital Básico          | 6,529   | 6,382  | 2.3%        |
| Activos ajustados       | 104,124 | 92,218 | 12.9%       |
| Razón de apalancamiento | 6.27%   | 6.92%  | -0.65%      |