

ANEXO 1 - O

PRIMER 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) | 957,778.24 |
| 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 | Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios | 8,865,337.20 |
| Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios | | |
| 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) | 302,607.84 |
| 10 (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) | 619,136.63 |
| 11 | Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo | 199,444.15 |
| 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 (conservador) | Inversiones en acciones propias | |
| 17 (conservador) | Inversiones recíprocas en el capital ordinario | 1,175,976.51 |

ANEXO 1 - O

PRIMER TRIMESTRE 2024



Miles MXN

| | | |
|---------------------|---|--------------|
| 18 (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 (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 (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 | 186,630.20 |
| 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 | 186,630.20 |
| 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 | Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1 | 2,483,795.32 |
| 29 | Capital común de nivel 1 (CET1) | 6,381,541.88 |

ANEXO 1 - O

PRIMER 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 | Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios | - |

Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios

| | | |
|---------------------|--|--------------|
| 37 (conservador) | Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1 | No aplica |
| 38 (conservador) | Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1 | No aplica |
| 39 (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 (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 | Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1 | 0.00% |
| 44 | Capital adicional de nivel 1 (AT1) | - |
| 45 | Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) | 6,381,541.88 |

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

PRIMER TRIMESTRE 2023



Miles MXN

| | | |
|---|--|---------------|
| 50 | Reservas | - |
| 51 | Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios | - |
| Capital de nivel 2: ajustes regulatorios | | |
| 52 (conservador) | Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2 | No aplica |
| 53 (conservador) | Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2 | No aplica |
| 54 (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 (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 | Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2 | 0.00% |
| 58 | Capital de nivel 2 (T2) | - |
| 59 | Capital total (TC = T1 + T2) | 6,381,541.88 |
| 60 | Activos ponderados por riesgo totales | 41,423,834.31 |
| Razones de capital y suplementos | | |
| 61 | Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) | 15.41% |
| 62 | Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) | 15.41% |
| 63 | Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) | 15.41% |
| 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) | 18% |
| 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) | 8.41% |

ANEXO 1 - O

PRIMER TRIMESTRE 2023



Miles MXN

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

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

PRIMER 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 | 6,381,541.88 | 15.41% | 0.00% | 6,381,541.88 | 15.41% |
| Capital Básico 2 | - | 0.00% | 0.00% | - | 0.00% |
| Capital Básico | 6,381,541.88 | 15.41% | 0.00% | 6,381,541.88 | 15.41% |
| Capital Complementario | - | 0.00% | 0.00% | - | 0.00% |
| Capital Neto | 6,381,541.88 | 15.41% | 0.00% | 6,381,541.88 | 15.41% |
| Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) | 41,423,834.31 | No aplica | No aplica | 41,423,834.31 | No aplica |
| Indice capitalización | 15.41% | No aplica | No aplica | 15.41% | No aplica |

ANEXO 1 - O

PRIMER 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 |
|--|---|--|
| | Activo | |
| BG1 | Disponibilidades | 2,052,986.00 |
| BG2 | Cuentas de margen | - |
| BG3 | Inversiones en valores | 21,507,882.00 |
| BG4 | Deudores por reporto | 616,763.00 |
| BG5 | Préstamo de valores | - |
| BG6 | Derivados | 7,279,982.00 |
| BG7 | Ajustes de valuación por cobertura de activos financieros | - 2,452.00 |
| BG8 | Total de cartera de crédito (neto) | 52,107,922.00 |
| BG9 | Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización | - |
| BG10 | Otras cuentas por cobrar (neto) | 2,490,049.00 |
| BG11 | Bienes adjudicados (neto) | 726,102.00 |
| BG12 | Inmuebles, mobiliario y equipo (neto) | 16,540.00 |
| BG13 | Inversiones permanentes | 1,179,429.00 |
| BG14 | Activos de larga duración disponibles para la venta | 79,950.00 |
| BG15 | Impuestos y PTU diferidos (neto) | 1,071,765.00 |
| BG16 | Otros activos | 819,276.00 |
| | Pasivo | |
| BG17 | Captación tradicional | 53,045,895.00 |
| BG18 | Préstamos interbancarios y de otros organismos | 4,881,706.00 |
| BG19 | Acreedores por reporto | 12,566,364.00 |
| BG20 | Préstamo de valores | - |

ANEXO 1 - 0

PRIMER TRIMESTRE 2024



Miles MXN

| | | |
|------|--|----------------|
| BG21 | Colaterales vendidos o dados en garantía | 200,248.00 |
| BG22 | Derivados | 6,962,322.00 |
| BG23 | Ajustes de valuación por cobertura de pasivos financieros | - |
| BG24 | Obligaciones en operaciones de bursatilización | - |
| BG25 | Otras cuentas por pagar | 3,172,321.00 |
| BG26 | Obligaciones subordinadas en circulación | - |
| BG27 | Impuestos y PTU diferidos (neto) | 64,404.00 |
| BG28 | Créditos diferidos y cobros anticipados | 210,140.00 |
| | Capital contable | |
| BG29 | Capital contribuido | 3,909,218.00 |
| BG30 | Capital ganado | 4,779,946.00 |
| | Cuentas de orden | |
| BG31 | Avales otorgados | - |
| BG32 | Activos y pasivos contingentes | - |
| BG33 | Compromisos crediticios | 11,329,406.00 |
| BG34 | Bienes en fideicomiso o mandato | 113,481,604.00 |
| BG35 | Agente financiero del gobierno federal | - |
| BG36 | Bienes en custodia o en administración | 9,141.00 |
| BG37 | Colaterales recibidos por la entidad | 617,391.00 |
| BG38 | Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad | 200,472.00 |
| BG39 | Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto) | - |
| BG40 | Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida | 126,264.00 |
| BG41 | Otras cuentas de registro | 220,398,276.00 |

ANEXO 1 - O

PRIMER 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 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 |
|---------------|--|---|--|--|
| | Activo | | | |
| 1 | Crédito mercantil | 8 | - | |
| 2 | Otros Intangibles | 9 | 302,607.84 | BG16 819,276 |
| 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 | 1,175,976.51 | BG17 53,045,895 |
| 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

PRIMER 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 | 186,630.20 | BG16 819,276 |
| 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

PRIMER TRIMESTRE 2024



Miles MXN

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

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

ANEXO 1 - O

PRIMER TRIMESTRE 2024



Miles MXN

| Capital contable | | | | |
|---|---|----------------|--------------|----------------|
| 34 | Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q | 1 | 3,909,218.49 | BG29 3,909,218 |
| 35 | Resultado de ejercicios anteriores | 2 | 3,998,340.47 | BG30 4,779,946 |
| 36 | Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable | 3 | 199,444.15 | BG30 4,779,946 |
| 37 | Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores | 3 | 758,334.09 | BG30 4,779,946 |
| 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 | | |
| Cuentas de orden | | | | |
| 43 | Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas | 26 - K | - | |
| Conceptos regulatorios no considerados en el balance general | | | | |
| 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

PRIMER 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 | 4,984,673 | 398,774 |
| Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable | 636,188 | 50,895 |
| Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's | 4,917 | 393 |
| Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General | 9,675 | 774 |
| Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC | 156 | 12.51 |
| Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del salario mínimo general | 1,818 | 145 |
| Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal | 108,771 | 8,702 |
| Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio | 174,875 | 13,990 |
| Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupo de acciones | 331,748 | 26,540 |
| Posiciones en Mercancías | 1,438 | 115 |

ANEXO 1 - O

PRIMER 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 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%) | 824,250.00 | 65,940.00 |
| Grupo III (ponderados al 23%) | - | - |
| Grupo III (ponderados al 50%) | - | - |
| 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%) | 404,750.00 | 32,380.00 |
| 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%) | 646,666.92 | 51,733.35 |
| Grupo VI (ponderados al 50%) | 2,828,480.75 | 226,278.46 |
| Grupo VI (ponderados al 75%) | 1,597,056.61 | 127,764.53 |
| Grupo VI (ponderados al 100%) | 630,375.00 | 50,430.00 |
| Grupo VI (ponderados al 115%) | 71,750.00 | 5,740.00 |
| Grupo VI (ponderados al 150%) | - | - |
| Grupo VI (ponderados al 172.5%) | - | - |
| Grupo VII_A (ponderados al 10%) | - | - |

ANEXO 1 - O

PRIMER 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%) | 340,750.00 | 27,260.00 |
| Grupo VII_A (ponderados al 23%) | - | - |
| Grupo VII_A (ponderados al 50%) | 507,125.00 | 40,570.00 |
| Grupo VII_A (ponderados al 57.5%) | - | - |
| Grupo VII_A (ponderados al 100%) | 16,914,696.76 | 1,353,175.74 |
| Grupo VII_A (ponderados al 115%) | 1,057,375.00 | 84,590.00 |
| 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%) | 4,997,375.00 | 399,790.00 |
| Grupo IX (ponderados al 115%) | 536,375.00 | 42,910.00 |
| 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 (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 (ponderados al 1250%) | - | - |

ANEXO 1 - O

PRIMER 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 | 3,813 | 305 |

| 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

PRIMER TRIMESTRE 2024



Miles MXN

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

| REFERENCIA | DESCRIPCION | IMPORTE |
|--|--|---------|
| Exposiciones dentro del balance | | |
| 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) | 82,133 |
| 2 | Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea | - 2,484 |
| 3 | Exposiciones dentro del Balance (netas) excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) | 79,649 |
| Exposiciones a instrumentos financieros derivados | | |
| 4 | Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible) | 475 |
| 5 | Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados | 149 |
| 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) | 623 |

ANEXO 1 - O BIS

PRIMER TRIMESTRE 2024



Miles MXN

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

| REFERENCIA | DESCRIPCION | IMPORTE |
|---|--|---------|
| Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores | | |
| 12 | Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas | 617 |
| 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) | 617 |
| Otras exposiciones fuera de balance | | |
| 17 | Exposición fuera de balance (importe notional bruto) | 11,329 |
| 18 | Ajuste por conversión a equivalentes crediticios | - |
| 19 | Partidas fuera del balance (suma de las lineas 17 y 18) | 11,329 |
| Capital y exposiciones totales | | |
| 20 | Capital de nivel 1 | 6,382 |
| 21 | Exposiciones totales (suma de las lineas 3 ,11,16 y 19) | 92,218 |
| Coefficiente de apalancamiento | | |
| 22 | Coefficiente de apalancamiento basilea III | 6.92% |

ANEXO 1 – O BIS PRIMER TRIMESTRE 2024



Miles MXN

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

| REFERENCIA | DESCRIPCION | IMPORTE |
|------------|---|---------|
| 1 | Activos totales | 82,870 |
| 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 | - 1,176 |
| 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 | 623 |
| 5 | Ajuste por operaciones de reporto y prestamos de valores | - 123 |
| 6 | Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden | 11,329 |
| 7 | Otros ajustes | - 1,305 |
| 8 | Exposición del coeficiente de apalancamiento | 92,218 |

ANEXO 1 - O BIS

PRIMER TRIMESTRE 2024



Miles MXN

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

| REFERENCIA | DESCRIPCION | IMPORTE |
|------------|--|---------|
| 1 | Activos totales | 82,870 |
| 2 | Operaciones en instrumentos financieros derivados | - 321 |
| 3 | Operaciones en reporto y prestamos de valores | - 417 |
| 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 | 82,133 |

ANEXO 1 – O BIS

PRIMER TRIMESTRE 2024



Miles MXN

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

| CONCEPTO/ TRIMESTRE | Marzo | Diciembre | Variación % |
|-------------------------|--------|-----------|-------------|
| Capital Básico | 6,382 | 6,103 | 4.6% |
| Activos ajustados | 92,218 | 96,684 | -4.6% |
| Razón de apalancamiento | 6.92% | 6.31% | 0.61% |