

Nota general - Actuación de BBVA como Internalizador Sistemático en la UE

Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A. (BBVA) actuará como Internalizador Sistemático (SI) en la Unión Europea, cuando negocie por cuenta propia al ejecutar órdenes de clientes fuera de un mercado regulado, un sistema multilateral de negociación (SMN) o un sistema organizado de contratación (SOC) de la Unión Europea (o reconocido por la UE), en relación con los instrumentos financieros listados en el presente documento.

No obstante lo anterior, cuando así lo solicite el cliente, BBVA, aparte de su capacidad de SI, podrá:

- negociar instrumentos financieros por cuenta propia; y/o
- ejecutar órdenes en nombre de clientes en un mercado regulado, un SMN o un SOC de manera extrabursátil.

A los efectos del presente documento se entenderá que son "Traded on a Trading Venue" o "TOTV" aquellos instrumentos negociados o admitidos a negociación en un mercado regulado, SMN o un SOC, establecido en la Unión Europea.

Para más información, consulte la Política Comercial de Internalizador Sistemático de BBVA⁽¹⁾.

Bonos y Titulizaciones

Bonos que son ToTV así como bonos no ToTV de una lista específica de emisores (ver página "Detalle UE").

BBVA no actúa como SI en bonos convertibles, ni en ETCs ni en ETNs

Titulizaciones que sean ToTV.

Derivados sobre Tipo de Interés (IRD), Crédito (CRD) y C10

| Clase de activo | Sub-clase de activo | Divisa del nominal/ ISIN | |
|-----------------|---|---|-------------------------|
| | | Instrumentos ToTV | Instrumentos no ToTV |
| IRD | Contratos FRA | Todos | |
| IRD | 'Swaps en una sola divisa' fijo por variable (y contratos a plazo sobre los mismos) | EUR/ USD/ GBP/ MXN/ COP/ CLP/ CLF/ PEN/ HKD | |
| IRD | 'Swaps en una sola divisa' variable por variable (y contratos a plazo sobre los mismos) | EUR/ USD/ GBP/ MXN/ COP/ CLP/ CLF/ PEN/ HKD | |
| IRD | 'Swaps en una sola divisa' fijo por fijo (y contratos a plazo sobre los mismos) | EUR/ USD/ GBP/ MXN/ COP/ CLP/ CLF/ PEN/ HKD | |
| IRD | 'Swaps en una sola divisa' OIS (y contratos a plazo sobre los mismos) | EUR/ USD/ GBP/ MXN/ COP/ CLP/ CLF/ PEN/ HKD | |
| IRD | 'Swaps multidivisa' o 'swaps de divisas' fijo por variable (y contratos a plazo sobre los mismos) | Todos | |
| IRD | 'Swaps multidivisa' o 'swaps de divisas' variable por variable (y contratos a plazo sobre los mismos) | Todos | |
| IRD | 'Swaps multidivisa' o 'swaps de divisas' fijo por fijo (y contratos a plazo sobre los mismos) | Todos | |
| IRD | Contratos a plazo sobre bonos | Todos | Ver página "Detalle UE" |
| IRD | Opciones sobre bonos | Todos | - |
| IRD | Opciones sobre tipos de interés | Todos | - |
| IRD | Opciones sobre permutas financieras ('swaptions') | EUR/ USD | - |
| IRD | Permutas financieras sobre inflación | EUR/ USD/ GBP | - |
| C10 | Opciones sobre inflación | EUR/ USD/ GBP | - |

Derivados sobre Acciones e Instrumentos asimilados (EQD)

| Clase de activo | Sub-clase de activo | ISIN subyacente | |
|-----------------|--|-------------------|-------------------------|
| | | Instrumentos ToTV | Instrumentos no ToTV |
| EQD | Opciones sobre índices bursátiles | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre índices bursátiles | Todos | - |
| EQD | Opciones sobre acciones | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre acciones | Todos | - |
| EQD | Opciones sobre índices de dividendos | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre índices de dividendos | Todos | - |
| EQD | Opciones sobre índices de volatilidad | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre índices de volatilidad | Todos | - |
| EQD | Opciones sobre ETF | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre ETF | Todos | - |
| EQD | 'Swaps' | Todos | Ver página "Detalle UE" |
| EQD | 'Swaps' de cartera | Todos | - |

Derivados sobre Divisas (FXD)

| Clase de activo | Sub-clase de activo | Pares de divisas | |
|-----------------|---|-------------------|----------------------|
| | | Instrumentos ToTV | Instrumentos no ToTV |
| FXD | Contratos a plazo sobre divisa no entregable | Todos | Todos |
| FXD | Contratos a plazo sobre divisa entregable | Todos | Todos |
| FXD | Opciones sobre divisas no entregables | Todos | Todos |
| FXD | Opciones sobre divisas entregables | Todos | Todos |
| FXD | Permutas financieras sobre divisas no entregables | Todos | Todos |
| FXD | Permutas financieras sobre divisas entregables | Todos | Todos |

(1) <https://www.bbvacib.com/global-markets/regulation/policies#regulation>.

Bonos

| Clase de Bono | Emisor del bono |
|----------------|------------------------------------|
| Corporate Bond | Alfa SAB de CV |
| Corporate Bond | Aalsea SAB de CV |
| Corporate Bond | America Movil SAB de CV |
| Corporate Bond | AvalonBay Communities Inc |
| Corporate Bond | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria |
| Corporate Bond | Banco Bradesco SA |
| Corporate Bond | Banc Credito Inversiones |
| Corporate Bond | Banco do Brasil SA |
| Corporate Bond | Banco Santander SA |
| Corporate Bond | Banco Votorantim SA |
| Corporate Bond | Braskem SA |
| Corporate Bond | BRF SA |
| Corporate Bond | Camden Property Trust |
| Corporate Bond | Cemex SAB de CV |
| Corporate Bond | Cencosud SA |
| Corporate Bond | Cia Siderurgica Nacional SA |
| Corporate Bond | Corp Nacional del Cobre de Chile |
| Corporate Bond | Credicorp Ltd |
| Corporate Bond | Electricite de France SA |
| Corporate Bond | InterCorp Peru Ltd |
| Corporate Bond | Inversiones CMPC SA |
| Corporate Bond | Itau Unibanco Holding SA |
| Corporate Bond | Itausa - Inverimentos Itau SA |
| Corporate Bond | Extra Space Storage LP |
| Corporate Bond | Falabella SA |
| Corporate Bond | Fomento Económico Mexicano SAB |
| Corporate Bond | French Republic |
| Corporate Bond | General Motors Co |
| Corporate Bond | Gerdau SA |
| Corporate Bond | Grupo Aeroportuario de la Ciudad |
| Corporate Bond | Grupo Financiero Inbursa SAB de CV |
| Corporate Bond | JBS S/A |
| Corporate Bond | Kingdom of Saudi Arabia |
| Corporate Bond | Landbk Hessen-Thuringen |
| Corporate Bond | Marfrig Global Foods SA |
| Corporate Bond | Minerva SA/Brazil |
| Corporate Bond | Petrobras Global Finance B.V. |
| Corporate Bond | Petroleo Brasileiro SA |
| Corporate Bond | Petroleos Mexicanos |
| Corporate Bond | Realty Income Corp |
| Corporate Bond | Simon Property Group Inc |
| Corporate Bond | Suzano SA |
| Corporate Bond | Tyson Foods Inc |
| Corporate Bond | Unifin Financiera |
| Corporate Bond | United Mexican States |
| Sovereign Bond | Argentine Republic |
| Sovereign Bond | Dominican Republic |
| Sovereign Bond | Federal Republic of Germany |
| Sovereign Bond | Federative Republic of Brazil |
| Sovereign Bond | Kingdom of Saudi Arabia |
| Sovereign Bond | Kingdom of Spain |
| Sovereign Bond | Oriental Republic of Uruguay |
| Sovereign Bond | Republic of Chile |
| Sovereign Bond | Republic of Colombia |
| Sovereign Bond | Republic of Italy |
| Sovereign Bond | Republic of Panama |
| Sovereign Bond | Republic of Peru |
| Sovereign Bond | Republic of Turkey |
| Sovereign Bond | United Mexican States |
| Sovereign Bond | United States of America |

Derivados sobre Tipos de Interés (IRD)

| Sub-clase de activo | Emisor del bono |
|-------------------------------|--|
| Contratos a plazo sobre bonos | 529900AQBND3S6YJLY83 (Bundesrepublik Deutschland) |
| Contratos a plazo sobre bonos | 815600DE60799F5A9309 (Republica Italiana) |
| Contratos a plazo sobre bonos | 969500KCGF3SUYJHPV70 (Direction Generale Du Tresor) |
| Contratos a plazo sobre bonos | 9598007A56S18711AH60 (Bonos y Obligaciones del Estado) |

Derivados sobre Acciones e Instrumentos asimilados (EQD)

| Sub-clase de activo | Tipo de subyacente | Subyacente |
|---------------------|--------------------|---------------------------|
| Swaps | Denominación única | ES0178430E18 (Telefónica) |

Nota general - Actuación de BBVA como Internalizador Sistemático en el Reino Unido

Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A. (BBVA) actuará como Internalizador Sistemático (SI) en el Reino Unido, cuando desde su sucursal de Londres negocie por cuenta propia al ejecutar órdenes de clientes fuera de un mercado regulado, un sistema multilateral de negociación (SMN) o un sistema organizado de contratación (SOC) del Reino Unido, en relación con los instrumentos financieros listados en el presente documento.

No obstante lo anterior, cuando así lo solicite el cliente, BBVA, aparte de su capacidad de SI, podrá:

- negociar instrumentos financieros por cuenta propia; y/o
- ejecutar órdenes en nombre de clientes en un mercado regulado, un SMN o un SOC del Reino Unido, o de manera extrabursátil.

A los efectos del presente documento se entenderá que son "Traded on a Trading Venue" o "TOTV" aquellos instrumentos negociados o admitidos a negociación en un mercado regulado, SMN o un SOC, establecido en el Reino Unido

Para más información, consulte la Política Comercial de Internalizador Sistemático de BBVA⁽¹⁾.

Bonos y Titulizaciones

Bonos que son ToTV.

BBVA no actúa como SI en bonos convertibles, ni en ETCs ni en ETNs.

Titulizaciones que sean ToTV.

Derivados sobre Tipo de Interés (IRD), Crédito (CRD) y C10

| Clase de activo | Sub-clase de activo | Divisa del nominal/ ISIN | |
|-----------------|---|---|----------------------|
| | | Instrumentos ToTV | Instrumentos no ToTV |
| IRD | Contratos FRA | Todos | |
| IRD | 'Swaps en una sola divisa' fijo por variable (y contratos a plazo sobre los mismos) | EUR/ USD/ GBP/ MXN/ COP/ CLP/ CLF/ PEN/ HKD | |
| IRD | 'Swaps en una sola divisa' variable por variable (y contratos a plazo sobre los mismos) | EUR/ USD/ GBP/ MXN/ COP/ CLP/ CLF/ PEN/ HKD | |
| IRD | 'Swaps en una sola divisa' fijo por fijo (y contratos a plazo sobre los mismos) | EUR/ USD/ GBP/ MXN/ COP/ CLP/ CLF/ PEN/ HKD | |
| IRD | 'Swaps en una sola divisa' OIS (y contratos a plazo sobre los mismos) | EUR/ USD/ GBP/ MXN/ COP/ CLP/ CLF/ PEN/ HKD | |
| IRD | 'Swaps multidivisa' o 'swaps de divisas' fijo por variable (y contratos a plazo sobre los mismos) | Todos | |
| IRD | 'Swaps multidivisa' o 'swaps de divisas' variable por variable (y contratos a plazo sobre los mismos) | Todos | |
| IRD | 'Swaps multidivisa' o 'swaps de divisas' fijo por fijo (y contratos a plazo sobre los mismos) | Todos | |
| IRD | Contratos a plazo sobre bonos | Todos | - |
| IRD | Opciones sobre bonos | Todos | - |
| IRD | Opciones sobre tipos de interés | Todos | - |
| IRD | Opciones sobre permutas financieras ('swaptions') | EUR/ USD | - |
| IRD | Permutas financieras sobre inflación | EUR/ USD/ GBP | - |
| C10 | Opciones sobre inflación | EUR/ USD/ GBP | - |

Derivados sobre Acciones e Instrumentos asimilados (EQD)

| Clase de activo | Sub-clase de activo | ISIN subyacente | |
|-----------------|--|-------------------|----------------------|
| | | Instrumentos ToTV | Instrumentos no ToTV |
| EQD | Opciones sobre índices bursátiles | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre índices bursátiles | Todos | - |
| EQD | Opciones sobre acciones | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre acciones | Todos | - |
| EQD | Opciones sobre índices de dividendos | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre índices de dividendos | Todos | - |
| EQD | Opciones sobre índices de volatilidad | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre índices de volatilidad | Todos | - |
| EQD | Opciones sobre ETF | Todos | - |
| EQD | Contratos a plazo sobre ETF | Todos | - |
| EQD | 'Swaps' | Todos | - |
| EQD | 'Swaps' de cartera | Todos | - |

Derivados sobre Divisas (FXD)

| Clase de activo | Sub-clase de activo | Pares de divisas | |
|-----------------|---|-------------------|----------------------|
| | | Instrumentos ToTV | Instrumentos no ToTV |
| FXD | Contratos a plazo sobre divisa no entregable | Todos | Todos |
| FXD | Contratos a plazo sobre divisa entregable | Todos | Todos |
| FXD | Opciones sobre divisas no entregables | Todos | Todos |
| FXD | Opciones sobre divisas entregables | Todos | Todos |
| FXD | Permutas financieras sobre divisas no entregables | Todos | Todos |
| FXD | Permutas financieras sobre divisas entregables | Todos | Todos |

(1) <https://www.bbvacib.com/global-markets/regulation/policies#regulation>.