



BANCO SANTANDER S.A.
LISTADO DE INSTRUMENTOS
INTERNALIZADOR SISTEMÁTICO



1. INSTRUMENTOS FINANCIEROS

1.1 Régimen obligatorio

Banco Santander, S.A. (Código MIC SANT) es "Internalizador Sistemático" de acuerdo con el artículo 4(1)(20) de MiFID II (Directiva 2014/65/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 15 de mayo de 2014, relativa a los mercados de instrumentos financieros y por la que se modifican la Directiva 2002/92/CE y la Directiva 2011/61/UE) para los siguientes instrumentos financieros a partir del 15 de Mayo de 2021:

1.1.1 Bonos (todos los tipos de bonos excepto materias primas cotizadas (ETCs), pagarés cotizados (ETNs))

a. Bonos Soberanos

| Issuer LEI | Issuer | Legal Jurisdiction |
|-----------------------|--|--------------------|
| 549300KPBYGYF7HCHO27 | The Republic of Argentina | AR |
| 254900ZFY40OYEADAP90 | Federative Republic of Brazil | BR |
| 549300FLZTJM5YJF8D34 | Republic of Chile | CL |
| 959800T4M5QUPYMSCH69 | EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASAJEROS METRO S.A. | CL |
| 549300MHDRBVR6B9117 | Republic of Colombia | CO |
| 549300SU25T08EMXB434 | EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN E.S.P | CO |
| 9598007A56S18711AH60 | SECRETARÍA GENERAL DEL TESORO Y FINANCIACIÓN INTERNACIONAL | ES |
| ECTRVYYCEF89VWYS6K36 | Her Majesty's Treasury | GB |
| 254900EGTWEU67VP6075 | United Mexican States | MX |
| 549300SHS4T08CL0LP14 | Ministry of Economy and Finance of the Republic of Panama | PA |
| 254900STKLK2DBJJZ530 | Republica del Peru | PE |
| 259400R9L8QEOP0TPXS31 | REPUBLIC OF POLAND-MINISTRY OF POLAND | PL |
| 529900UXXKJTJPCU0HK83 | República del Paraguay | PY |
| 254900HROIFWPRGM1V77 | United States Department of the Treasury | US |
| 549300RDR012H2V82H43 | República Oriental Del Uruguay | UY |

b. Bonos Corporativos

| Issuer LEI | Issuer | Legal Jurisdiction |
|----------------------|---|--------------------|
| 5493003N7447U18U5U53 | YPF SOCIEDAD ANONIMA | AR |
| 5493002W2IVG62O3ZJ94 | ITAU UNIBANCO HOLDING S.A. | BR |
| 254900MTXR9LUVQFU480 | BRF S.A. | BR |
| QE0Q0253K88YAGNPE356 | BANCO DO BRASIL SA | BR |
| 549300RPMQUFGBB7EY44 | Braskem S/A | BR |
| 5493000J801JZRCMFE49 | PETROLEO BRASILEIRO S A PETROBRAS | BR |
| 2549001OK55PFGXM4827 | USINAS SIDERURGICAS DE MINAS GERAIS S.A. USIMINAS | BR |
| 254900SMTWBX7RU2SR20 | Vale S.A. | BR |



| | | |
|----------------------|--|----|
| 549300SZJ9VS8SGXAN81 | UBS Group AG | CH |
| 549300506S19CRFV9Z86 | Credit Suisse Group AG | CH |
| 254900IDGKJICKBPA66 | ECOPETROL S.A. | CL |
| 549300BBUKBHWLSUZM17 | Grupo Aval Acciones Y Valores S.A | CL |
| 549300YM5CWCAUVOPB53 | ENEL CHILE S.A. | CL |
| 529900LG618OWYVHI655 | Grupo Energía Bogotá SA ESP | CL |
| 254900IXHTV7LDSFQD65 | Promigas S.A. E.S.P. | CL |
| 529900780HCVLCEM2440 | Transportadora de Gas Internacional S.A. ESP | CL |
| 851WYGNLUQLFZBSYGB56 | COMMERZBANK Aktiengesellschaft | DE |
| 7LTWFZYICNSX8D621K86 | DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT | DE |
| 549300UDG16DOYUPR330 | Thyssenkrupp AG | DE |
| 529900PH63HYJ86ASW55 | Deutsche Lufthansa Aktiengesellschaft | DE |
| 529900NNUPAGGOMPXZ31 | VOLKSWAGEN AKTIENGESELLSCHAFT | DE |
| 5493006QMFDDMYWIAM13 | Banco Santander S.A. | ES |
| K8MS7FD7N5Z2WQ51AZ71 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SOCIEDAD ANONIMA | ES |
| 7CUNS533WID6K7DGF87 | CAIXABANK SA | ES |
| R0MUW5FPU8MPRO8K5P83 | BNP PARIBAS | FR |
| MLU0ZO3ML4LN2LL2TL39 | CRPB | GB |
| 335800BO2LHWJJ8TZI32 | TATA MOTORS LIMITED | IN |
| WOCMU6HCIOJWNPRZ533 | ENEL - SPA | IT |
| 2W8N8UU78PMDQKZENC08 | INTESA SANPAOLO SPA | IT |
| 549300TRUWO2CD2G5692 | UNICREDIT, SOCIETA' PER AZIONI | IT |
| 222100BC34RLK5I1BK26 | CSN ISLANDS XII CORP | KY |
| 222100R8R68DM7VM3661 | CSN Inova Ventures | KY |
| 5299007RH8MA67ZC6J07 | Gol Finance | LU |
| 549300CAZKPF4HKMPX17 | Petróleos Mexicanos | MX |
| 549300QTVYRPFH50J362 | Banco Mercantil del Norte, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Banorte | MX |
| SCRYQ25DTRHYMM6P89 | Banco Santander Mexico, S.A. | MX |
| YH0V7ZHY352ITDGEYB83 | Braskem Idesa, S.A.P.I. | MX |
| 549300RIG2CXWN6IV731 | CEMEX S A B DE C V | MX |
| 724500PBR8LR26XBSP67 | EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV | NL |
| 549300XKJ91C4SZLG750 | VOLCAN COMPANIA MINERA S.A. | PE |
| 549300SMVCQN2P006I58 | Santander Holdings USA, Inc. | US |
| 2549007U6NAP46Q9TU15 | Southern Copper Corporation | US |
| 549300B56MD0ZC402L06 | Bloomberg L.P. | US |

c. Bonos Convertibles

| Issuer LEI | Issuer | Legal Jurisdiction |
|----------------------|-----------------------|--------------------|
| 5493006QMFDDMYWIAM13 | Banco Santander, S.A. | ES |

Derivados sobre Divisas

Banco Santander, S.A. (Código MIC SANT) es “Internalizador Sistemático” de acuerdo con el artículo 4(1)(20) de MiFID II para Derivados sobre Divisas a partir del 15 de Mayo de 2021, para algunos pares de divisas y periodos en los productos: Opciones sobre divisas, Contratos a plazo entregables, Swaps de divisas entregables, Contratos a plazo no entregables y Opciones sobre divisas no entregables.

1.2 Régimen voluntario

Banco Santander S.A. de forma voluntaria será Internalizador Sistemático en los siguientes instrumentos financieros:

1.2.1 Derivados sobre Divisas:

- FX swap: todas las divisas y todos los periodos.
- Swaps no entregables: todas las divisas y todos los periodos.
- Contratos a plazo no entregables (NDF): todas las divisas y todos los periodos.
- Contratos a plazo entregables (DF): todas las divisas y todos los periodos.
- Opciones sobre divisas no entregables (NDO): todas las divisas y todos los periodos.
- Opciones sobre divisas entregables (DO): todas las divisas y todos los periodos.
- Otros derivados sobre divisas: todas las divisas y todos los periodos.

1.2.2 Derivados sobre tipos de interés y swaps de divisa

a. ToTV EUR Swap

- Subclases de activos:
 - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable.
 - «Swaps en una sola divisa» fijo por fijo y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por fijo.
 - «Swaps en una sola divisa» variable por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» variable por variable.
 - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS.
 - «Swaps en una sola divisa» de inflación y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» de inflación.
- Criterio de segmentación 1 — moneda nocional en que se expresan los dos lados de la permuta: **EUR**
- o Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

b. ToTV GBP Swap

- Subclases de activos:
 - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable



- «Swaps en una sola divisa» fijo por fijo y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por fijo
 - «Swaps en una sola divisa» variable por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» variable por variable.
 - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS
 - «Swaps en una sola divisa» de inflación y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» de inflación
 - Criterio de segmentación 1 — moneda nacional en que se expresan los dos lados de la permuta: **GBP**
 - Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**
- c. ToTV BRL Swap**
- Subclases de activos:
 - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
 - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS
 - Criterio de segmentación 1 — moneda nacional en que se expresan los dos lados de la permuta: **BRL**
 - Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**
- d. ToTV MXN Swap**
- Subclases de activos:
 - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
 - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS
 - Criterio de segmentación 1 — moneda nacional en que se expresan los dos lados de la permuta: **MXN**
 - Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**
- e. ToTV CLP Swap**
- Subclases de activos:
 - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
 - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS
 - Criterio de segmentación 1 — moneda nacional en que se expresan los dos lados de la permuta: **CLP**
 - Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

f. ToTV COP Swap

- Subclases de activos:
 - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
 - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS
- Criterio de segmentación 1 — moneda nacional en que se expresan los dos lados de la permuta: **COP**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

g. ToTV PLN Swap

- Subclases de activos:
 - «Swaps en una sola divisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» fijo por variable
 - «Swaps en una sola divisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps en una sola divisa» OIS
- Criterio de segmentación 1 — moneda nacional en que se expresan los dos lados de la permuta: **PLN**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

h. ToTV CCS:

- Subclases de activos:
 - «Swaps multdivisa» fijo por fijo y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multdivisa» fijo por fijo
 - «Swaps multdivisa» fijo por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multdivisa» fijo por variable
 - «Swaps multdivisa» variable por variable y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multdivisa» variable por variable
 - «Swaps multdivisa» OIS y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multdivisa» OIS
 - «Swaps multdivisa» de inflación y contratos de futuros/contratos a plazo sobre «swaps multdivisa» de inflación
- Criterio de segmentación 1 — par de monedas nacionales definido como combinación de las dos monedas en que se expresan los dos lados de la permuta: **todas**
- Criterio de segmentación 2 — período de vencimiento de la permuta: **todos los periodos.**

1.2.3 Bonos (todos los tipos de bonos excepto materias primas cotizadas (ETCs), pagarés cotizados (ETNs))
a. Bonos Soberanos

- Todos los bonos soberanos emitidos por España, Reino Unido y Portugal.



b. Bonos Corporativos

- Todos los emisores de bonos corporativos con emisiones en EUR y GBP (excepto emisores latinoamericanos y polacos).

c. Bonos Garantizados

- Todos los emisores de bonos garantizados con emisiones en EUR, USD y GBP (excepto emisores latinoamericanos y polacos).

1.2.4 Opciones sobre Tipos de Interés

a. Cap

- Todas las divisas y todos los periodos.

b. Floor

- Todas las divisas y todos los periodos.

1.2.5 Bond Forward

a. Subyacente: Bono

1.2.6 Swaptions

Banco Santander será Internalizador Sistemático de forma voluntaria para todos los Swaptions.

1.2.7 Total Return Swap

a. Subyacente: Bono / Inflación

2. OBLIGACIONES POSTNEGOCIACIÓN

En cumplimiento del artículo 7(6) del *Reglamento Delegado (UE) 2017/583 de la Comisión, de 14 de julio de 2016, por el que se completa el Reglamento (UE) n.º 600/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo, relativo a los mercados de instrumentos financieros, en lo que respecta a las normas técnicas de regulación sobre los requisitos de transparencia aplicables a los centros de negociación y las empresas de servicios de inversión con relación a los bonos, los productos de financiación estructurada, los derechos de emisión y los derivados*, le informamos de que, en aquellos casos en que Banco Santander, S.A. sea el único IS en un determinado instrumento financiero y esté actuando como comprador en una determinada transacción, cumpliremos con las obligaciones de transparencia post negociación.

3. REVISIÓN PERIÓDICA

La lista de instrumentos financieros será revisada trimestralmente cuando ESMA publique los cálculos oficiales del régimen de IS.