



Anexo
Scotiabank Inverlat

BANCO LÍDER EN LAS AMÉRICAS

Scotiabank[®]

| Scotiabank Indicadores Financieros | 2020 | | | | 2019 |
|--|--------|-------|-------|-------|-------|
| | T4 | T3 | T2 | T1 | T4 |
| ROE (Utilidad neta del trimestre anualizada / Capital contable promedio) | 7.9 | 2.6 | 1.4 | 10.3 | 6.9 |
| ROA (Utilidad neta del trimestre anualizada / Activo total promedio) | 0.7 | 0.2 | 0.1 | 0.9 | 0.6 |
| MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio) | 2.8 | 2.2 | 2.2 | 2.7 | 3.1 |
| Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio) | 3.0 | 3.0 | 2.8 | 3.0 | 3.4 |
| Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre) | 3.05 | 2.62 | 2.58 | 2.31 | 2.37 |
| Índice de Cobertura de Cartera de Crédito Vencida (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre) | 134.8 | 143.8 | 125.0 | 121.4 | 118.6 |
| Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito | 15.94* | 15.91 | 15.14 | 14.43 | 15.36 |
| Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional) | 13.91* | 13.85 | 13.44 | 12.91 | 13.69 |
| Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos) | 64.0 | 76.5 | 65.9 | 65.8 | 66.5 |

* Sujeto a aprobación del Banco Central.

| Scotiabank Información Financiera Condensada | 3 meses | | | | 12 meses | | |
|---|----------------|----------------|----------------|------------|----------------|----------------|-------------|
| | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 | A/A Δ% | 31 dic 2019 | 31 dic 2020 | A/A Δ% |
| (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) | | | | | | | |
| Ingresos por intereses | 12,862 | 11,764 | 11,208 | -13% | 50,720 | 48,275 | -5% |
| Gastos por intereses | (7,000) | (5,378) | (4,779) | 32% | (27,458) | (23,083) | 16% |
| Margen Financiero | 5,862 | 6,386 | 6,429 | 10% | 23,262 | 25,192 | 8% |
| Comisiones | 1,019 | 906 | 1,004 | -1% | 4,258 | 3,825 | -10% |
| Intermediación | 113 | 646 | 508 | >+100% | 641 | 2,334 | >+100% |
| OI OE | 581 | 257 | 592 | 2% | 2,230 | 1,732 | -22% |
| Ingresos no Financieros | 1,713 | 1,809 | 2,104 | 23% | 7,129 | 7,891 | 11% |
| Ingresos | 7,575 | 8,195 | 8,533 | 13% | 30,391 | 33,083 | 9% |
| Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios | (1,700) | (2,951) | (2,153) | -27% | (5,885) | (10,164) | -73% |
| Total Ingresos | 5,875 | 5,244 | 6,380 | 9% | 24,506 | 22,919 | -6% |
| Gastos de Administración y Promoción | (4,851) | (4,880) | (4,960) | -2% | (17,717) | (18,920) | -7% |
| Resultado de la Operación | 1,024 | 364 | 1,420 | 39% | 6,789 | 3,999 | -41% |
| Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas y Asociadas | - | - | - | 0% | 1 | 1 | 0% |
| Utilidad antes de Impuestos a la Utilidad | 1,024 | 364 | 1,420 | 39% | 6,790 | 4,000 | -41% |
| Impuestos a la Utilidad | (106) | (5) | (338) | >-100% | (1,842) | (981) | 47% |
| Utilidad después de Impuestos a la Utilidad | 918 | 359 | 1,082 | 18% | 4,948 | 3,019 | -39% |

En el cuarto trimestre de 2020, la utilidad neta consolidada de Scotiabank Inverlat, S.A. de C.V. (Scotiabank), se ubicó en \$1,082 millones y la utilidad antes de impuestos fue de \$1,420 millones. Durante los últimos trimestres se constituyeron reservas voluntarias, por encima de las regulatorias por \$3,750 millones, \$1,540 en el segundo trimestre, \$1,710 millones en el tercero y \$500 millones en el cuarto trimestre; sin estos efectos, la utilidad del trimestre ascendería a \$1,432 millones, un incremento de \$514 millones o 56% respecto al año pasado.

La utilidad del trimestre antes de impuestos, sin incluir las reservas mencionadas anteriormente asciende a \$1,920 millones, un incremento de \$896 millones u 88% respecto al mismo periodo del año pasado, debido principalmente a mayores ingresos por margen financiero e intermediación, compensados parcialmente con mayores gastos de administración y promoción.

Respecto al trimestre anterior, sin incluir el efecto antes mencionado, la utilidad antes de impuestos mostró una disminución de \$154 millones o 7%, debido a mayores requerimientos de la estimación preventiva para riesgos crediticios, un incremento en los gastos de operación; compensados parcialmente por mayores ingresos no financieros, así como mayor margen financiero.

Al 31 de diciembre de 2020, la utilidad neta consolidada se ubicó en \$3,019 millones, sin incluir las reservas mencionadas con anterioridad, la utilidad se ubica en \$5,644 millones, un incremento anual de 14%, esto debido principalmente a mayores ingresos provenientes del margen financiero e intermediación, compensado parcialmente por un incremento en gastos de administración y promoción; mayores requerimientos de la estimación preventiva para riesgos crediticios, así como menores ingresos por comisiones netas y por otros ingresos / egresos de la operación.

Las principales variaciones se ven reflejadas en los cuadros siguientes:

| Scotiabank Comisiones y Tarifas (netas) | 3 meses | | | | 12 meses | | |
|---|----------------|----------------|----------------|------------|----------------|----------------|-------------|
| | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 | A/A Δ% | 31 dic 2019 | 31 dic 2020 | A/A Δ% |
| (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) | | | | | | | |
| Comisiones de Crédito | 142 | 91 | 132 | -7% | 457 | 403 | -12% |
| Manejo de cuenta | 76 | 80 | 77 | 1% | 324 | 318 | -2% |
| Tarjeta de Crédito y Débito | 485 | 389 | 452 | -7% | 2,041 | 1,660 | -19% |
| Actividades fiduciarias | 47 | 59 | 46 | -2% | 225 | 207 | -8% |
| Servicios de banca electrónica | 119 | 117 | 120 | 1% | 424 | 468 | 10% |
| Compraventa de valores | 9 | 12 | 9 | 0% | 45 | 46 | 2% |
| Cartas de crédito sin refinanciamiento | 49 | 44 | 43 | -12% | 166 | 185 | 11% |
| Otras | 92 | 114 | 125 | 36% | 576 | 538 | -7% |
| Total de Comisiones y Tarifas (netas) | 1,019 | 906 | 1,004 | -1% | 4,258 | 3,825 | -10% |

| Scotiabank Otros Ingresos/Egresos de la Operación | 3 meses | | | | 12 meses | | |
|--|----------------|----------------|----------------|-----------|----------------|----------------|-------------|
| | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 | A/A Δ% | 31 dic 2019 | 31 dic 2020 | A/A Δ% |
| (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) | | | | | | | |
| Otras Recuperaciones | - | - | - | 0% | - | 3 | 0% |
| Gastos por Adquisición de Cartera de Crédito | (3) | (3) | (1) | 67% | (7) | (14) | -100% |
| Castigos y Quebrantos | (101) | (208) | (196) | -94% | (500) | (603) | -21% |
| Resultado neto por Venta de Bienes Adjudicados | 22 | 20 | 52 | >+100% | 121 | 110 | -9% |
| Intereses por Préstamos a Empleados | 1 | 1 | 1 | 0% | 4 | 4 | 0% |
| Ingresos por Arrendamiento | 89 | 20 | 18 | -80% | 160 | 80 | -50% |
| Otras partidas de los Ingresos/Egresos de la operación | 573 | 427 | 718 | 25% | 2,452 | 2,275 | -7% |
| Pérdida por Cesión de Cartera de Crédito | - | - | - | 0% | - | (123) | 0% |
| Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación | 581 | 257 | 592 | 2% | 2,230 | 1,732 | -22% |

| Scotiabank Gastos de Administración y Promoción | 3 meses | | | | 12 meses | | |
|--|----------------|----------------|----------------|------------|-----------------|-----------------|------------|
| | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 | A/A Δ% | 31 dic 2019 | 31 dic 2020 | A/A Δ% |
| (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) | | | | | | | |
| Gastos de Personal | (49) | (83) | (75) | -53% | (275) | (325) | -18% |
| Gastos de Operación | (4,802) | (4,797) | (4,885) | -2% | (17,442) | (18,595) | -7% |
| Total de Gastos de Administración y Promoción | (4,851) | (4,880) | (4,960) | -2% | (17,717) | (18,920) | -7% |

En el cuarto trimestre de 2020, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$2,153 millones, un incremento de \$453 millones o 27% respecto al mismo periodo del año pasado. Sin incluir las reservas mencionadas anteriormente, se muestra una disminución de \$47 millones o 3%, debido principalmente a menores requerimientos en la cartera comercial, así como mayores requerimientos en cartera de consumo, hipotecaria y automotriz.

Respecto al trimestre anterior, la estimación preventiva para riesgos crediticios muestra una disminución de \$798 millones o 27%. Sin incluir las reservas mencionadas anteriormente, se muestra un incremento de \$412 millones o 33%, debido principalmente a mayores requerimientos en la cartera hipotecaria, de consumo, automotriz y de tarjeta de crédito; compensado parcialmente por menores requerimientos en la cartera comercial.

Al 31 de diciembre de 2020, la estimación preventiva para riesgos crediticios, ascendió a \$10,164 millones, un incremento anual de \$4,279 millones o 73%. Sin incluir las reservas mencionadas anteriormente, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubica en \$6,414 millones, un incremento de \$529 millones o 9%, debido principalmente a mayores requerimientos en la cartera de consumo e hipotecaria; así menores requerimientos en la cartera comercial y tarjeta de crédito.

| Scotiabank Impuestos | 3 meses | | | | 12 meses | | |
|---|----------------|----------------|----------------|------------------|----------------|----------------|------------|
| | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 | A/A Δ% | 31 dic 2019 | 31 dic 2020 | A/A Δ% |
| (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) | | | | | | | |
| Impuesto a la Utilidad Causado | 19 | (508) | (770) | > -100% | (1,847) | (2,677) | -45% |
| Impuesto a la Utilidad Diferido | (125) | 503 | 432 | >+100% | 5 | 1,696 | >+100% |
| Total de Impuestos a la Utilidad | (106) | (5) | (338) | >-100% | (1,842) | (981) | 47% |

En el cuarto trimestre de 2020, se registró un impuesto neto a cargo de \$338 millones, un incremento de \$232 millones respecto del mismo periodo del año pasado y de \$333 millones respecto al trimestre anterior. Ambos incrementos se debieron a una mayor utilidad en el periodo.

Al 31 de diciembre de 2020, el total de impuestos netos mostró una disminución anual de \$861 millones o 47%, principalmente por una menor utilidad del periodo.

| Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 | A/A Δ% |
|---|----------------|----------------|----------------|-----------|
| Caja, bancos, Valores | 149,376 | 222,901 | 210,986 | 41% |
| Cartera Vigente | 403,946 | 412,269 | 402,545 | 0% |
| Cartera Vencida | 9,785 | 11,085 | 12,661 | 29% |
| Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios | (11,606) | (15,940) | (17,063) | -47% |
| Otros Activos | 32,527 | 36,139 | 28,634 | -12% |
| Activo Total | 584,028 | 666,454 | 637,763 | 9% |
| Depósitos | 364,870 | 407,167 | 406,125 | 11% |
| Préstamos bancarios | 55,642 | 65,675 | 66,612 | 20% |
| Obligaciones Subordinadas | 9,046 | 9,094 | 9,052 | 0% |
| Otros Pasivos | 101,274 | 129,850 | 100,653 | -1% |
| Capital | 53,196 | 54,668 | 55,321 | 4% |
| Total Pasivo y Capital | 584,028 | 666,454 | 637,763 | 9% |

Al 31 de diciembre de 2020, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$637,763 millones, \$53,735 millones o 9% superior al cierre de diciembre de 2019. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en inversiones en valores gubernamentales, principalmente en títulos disponibles para la venta; así como a un incremento en deudores por reporte, derivados con fines de negociación y en deudores por colaterales otorgados en efectivo, parcialmente compensados por una disminución en deudores por liquidación de operaciones y disponibilidades (divisas por entregar y a recibir).

Respecto al cierre del trimestre anterior, los activos totales disminuyeron \$28,691 millones o 4%, debido principalmente a menores volúmenes en cartera de crédito vigente, deudores por liquidación de operaciones, inversiones en valores en títulos para negociar y disponibilidades.

El total del pasivo ascendió a \$582,442 millones al 31 de diciembre de 2020, un incremento de \$51,610 millones o 10% respecto al año pasado. Este crecimiento fue resultado principalmente de mayores volúmenes en depósitos de clientes y plazo, préstamos bancarios de corto plazo y derivados con fines de negociación; parcialmente compensados por una disminución en acreedores por reporto y valores asignados por liquidar.

Respecto al trimestre anterior, el pasivo total disminuyó \$29,344 millones o 5%, debido principalmente a menores volúmenes en acreedores por liquidación de operaciones, valores asignados por liquidar y acreedores por reporto.

La cartera vigente de préstamos de menudeo, creció \$7,019 millones o 4% respecto al año pasado y disminuyó \$916 millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual fue impulsado por un mayor volumen en la cartera hipotecaria por \$12,583 millones o 9%; parcialmente compensado con un menor volumen en tarjeta de crédito y otros préstamos personales por \$5,564 millones o 12%. La disminución trimestral, fue debido a un menor volumen en tarjeta de crédito y otros préstamos personales; compensada parcialmente por un mayor volumen en la cartera hipotecaria.

El total de préstamos vigentes con entidades comerciales, financieras y gubernamentales mostró una disminución anual y trimestral de \$8,420 millones o 4% y de \$8,808 millones o 4% respectivamente. La disminución anual se debió a un menor volumen en créditos a entidades financieras y gubernamentales; compensada parcialmente con un mayor volumen en créditos comerciales. La baja trimestral se debió a un menor volumen en los créditos a entidades gubernamentales, entidades financieras y créditos comerciales.

La captación tradicional mostró un crecimiento anual del 11%, debido al incremento en depósitos de exigibilidad inmediata 21%, en depósitos a plazo 9%. Respecto al trimestre anterior mostró una disminución, debido a la baja de volúmenes en depósitos a plazo 6% y títulos de crédito emitidos 8%.

Las principales variaciones se ven reflejadas en los cuadros siguientes:

| Scotiabank – Cartera de Crédito Vigente (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 | A/A Δ% |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|-------------------|
| Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales | 44,600 | 41,904 | 39,036 | -12% |
| Créditos a la Vivienda | 133,627 | 144,258 | 146,210 | 9% |
| Total Préstamos de Menudeo | 178,227 | 186,162 | 185,246 | 4% |
| Actividad Empresarial o Comercial | 176,385 | 180,787 | 179,410 | 2% |
| Entidades Financieras | 35,282 | 31,618 | 28,878 | -18% |
| Entidades Gubernamentales | 14,052 | 13,702 | 9,011 | -36% |
| Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales | 225,719 | 226,107 | 217,299 | -4% |
| Total Cartera Vigente | 403,946 | 412,269 | 402,545 | 0% |

| Scotiabank – Cartera de Crédito Vencida (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 | A/A Δ% |
|--|------------------------|------------------------|------------------------|-------------------|
| Cartera Vencida | 9,785 | 11,085 | 12,661 | 29% |
| Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios | (11,606) | (15,940) | (17,063) | -47% |
| Cartera Vencida Neta | (1,821) | (4,855) | (4,402) | > -100% |
| Cartera Vencida Bruta a Cartera Total | 2.37% | 2.62% | 3.05% | 68 pb |

| Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 | A/A Δ% |
|--|--------------------|--------------------|--------------------|---------------|
| Total Depósitos Vista y Ahorro | 167,240 | 189,258 | 202,354 | 21% |
| Público en General | 109,087 | 154,041 | 154,621 | 42% |
| Mercado de Dinero | 46,780 | 27,230 | 15,536 | -67% |
| Total Depósitos a Plazo | 155,867 | 181,271 | 170,157 | 9% |
| Títulos de Crédito Emitidos | 41,152 | 36,030 | 33,000 | -20% |
| Cuenta global de captación sin movimientos | 611 | 608 | 614 | 0% |
| Total de Depósitos | 364,870 | 407,167 | 406,125 | 11% |

| Scotiabank Composición de Inversiones en Valores (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020 valor razonable) | | | | | |
|---|---------------------|----------------|---------------------------------|------------------------|----------------|
| Categoría | Deuda Gubernamental | Deuda Bancaria | Instrumentos de Patrimonio neto | Otros títulos de deuda | Total |
| Títulos para negociar | 56,128 | - | 22 | 64 | 56,214 |
| Sin restricción: | - | - | 22 | - | 22 |
| Restringidos: | 56,128 | - | - | 64 | 56,192 |
| <i>En operaciones de reporto</i> | 44,610 | - | - | - | 44,610 |
| <i>Préstamos de valores</i> | 557 | - | - | 64 | 621 |
| <i>Otros</i> | 10,961 | - | - | - | 10,961 |
| Títulos disponibles para la venta | 49,658 | 14,233 | - | 717 | 64,608 |
| Sin restricción: | 48,690 | 14,233 | - | 717 | 63,640 |
| Restringidos: | 968 | - | - | - | 968 |
| <i>En operaciones de reporto</i> | - | - | - | - | - |
| <i>Otros</i> | 968 | - | - | - | 968 |
| Títulos conservados a vencimiento | 5,048 | - | - | - | 5,048 |
| Sin restricción | 5,048 | - | - | - | 5,048 |
| Total | 110,834 | 14,233 | 22 | 781 | 125,870 |

| Scotiabank Inversiones en Valores no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto) (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020) | | | | |
|---|----------------|-------|-------|---------|
| Emisor | Títulos | Tasa | Plazo | Importe |
| I-BANSAN-21025 | 11,838,087,745 | 4.14% | 28 | 11,817 |

| Scotiabank Derivados y operaciones de cobertura (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020; valor razonable) | | | | | | | | | | | | | | |
|---|-----------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|---------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|------------------------------------|-----------------|--------------|--------------|
| | Contratos Adelantados | | Futuros | | Opciones | | Operaciones Estructuradas | | Swaps | | Paquetes de Instrumentos Derivados | | Total activo | Total Pasivo |
| | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva | | |
| Con fines de Negociación | 2,167 | 2,055 | - | - | 628 | 388 | 240 | 328 | 16,955 | 17,295 | - | - | 19,990 | 20,066 |
| Cobertura | - | - | - | - | - | - | - | - | 4,006 | 6,232 | - | - | 4,006 | 6,232 |

Scotiabank
Montos nacionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de diciembre de 2020)

| | Contratos adelantados | | Futuros | | Operaciones Estructuradas | | Opciones | | Swaps | | Paquetes de instrumentos Derivados | |
|--------------------------|-----------------------|-----------------|-----------------|-----------------|---------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|------------------------------------|-----------------|
| | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva | Posición Activa | Posición Pasiva |
| Con fines de negociación | | | | | | | | | | | | |
| Posición USD | 1,253 | 1,218 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Divisas MXN | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Divisas USD | - | - | - | - | 12 | 12 | 415 | 415 | - | - | - | - |
| Posición JPY | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Posición EUR | 9 | 9 | - | - | - | - | 5 | 5 | - | - | - | - |
| Acciones MXN | - | - | - | - | - | - | 95 | 95 | - | - | - | - |
| Acciones USD | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Índices MXN | - | - | - | - | 1,006 | 2,478 | 3,277 | 1,805 | - | - | - | - |
| Tasa de interés | | | | | | | | | | | | |
| Pesos | - | - | - | - | 1 | 1 | 25,715 | 26,085 | 294,172 | 293,206 | - | - |
| Dólares | - | - | - | - | - | - | 135 | 135 | 1,239 | 1,647 | - | - |
| CLF Chilena | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Euros | - | - | - | - | - | - | - | - | 25 | - | - | - |
| Con fines de cobertura | | | | | | | | | | | | |
| Tasa de interés | | | | | | | | | | | | |
| Pesos | - | - | - | - | - | - | - | - | 44,314 | - | - | - |
| Dólares | - | - | - | - | - | - | - | - | 471 | 5 | - | - |
| Euros | - | - | - | - | - | - | - | - | 4 | - | - | - |

| Scotiabank Cartera de Crédito Vigente (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020) | Pesos | Dólares | Total |
|---|----------------|----------------|----------------|
| Actividad empresarial o comercial | 143,678 | 35,732 | 179,410 |
| Créditos a entidades financieras | 28,723 | 155 | 28,878 |
| Créditos a entidades gubernamentales | 9,011 | - | 9,011 |
| Créditos al consumo | 39,036 | - | 39,036 |
| Créditos a la vivienda | 146,178 | 32 | 146,210 |
| Total | 366,626 | 35,919 | 402,545 |

| Scotiabank Cartera de Crédito Vencida (millones de pesos al 31 diciembre de 2020) | Pesos | Dólares | Total |
|--|---------------|----------------|---------------|
| Actividad empresarial o comercial | 4,551 | 219 | 4,770 |
| Créditos a entidades financieras | 82 | - | 82 |
| Créditos al consumo | 2,526 | - | 2,526 |
| Créditos a la vivienda | 5,219 | 64 | 5,283 |
| Total | 12,378 | 283 | 12,661 |

Scotiabank
Variaciones de Cartera Vencida
(millones de pesos)

| | |
|--|---------------|
| Saldo al 30 de septiembre de 2020 | 11,085 |
| Traspaso de Cartera Vigente a Vencida | 2,778 |
| Recuperaciones | (85) |
| Quitas y Castigos | (1,076) |
| Fluctuación Tipo de Cambio | (41) |
| Saldo al 31 de diciembre de 2020 | 12,661 |

Scotiabank
Estimaciones preventivas para riesgos crediticios
(millones de pesos)

| | |
|---|---------------|
| Saldo al 30 de septiembre de 2020 | 15,940 |
| Más: Creación de reservas | 2,305 |
| Menos: Liberaciones | - |
| Cancelaciones | - |
| Adjudicaciones y otros | 16 |
| Castigos y quitas | 1,061 |
| Comercial | 321 |
| Hipotecario | 166 |
| Consumo | 574 |
| Castigos y aplicaciones por programa de apoyo | - |
| Desliz cambiario | 105 |
| Saldo al 31 de diciembre de 2020 | 17,063 |

Scotiabank
Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito

| | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 |
|------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| Cartera Vigente | | | |
| Metropolitano | 62.7% | 61.7% | 56.5% |
| Noroeste – Centro | 10.3% | 10.2% | 11.9% |
| Norte | 13.8% | 15.0% | 15.9% |
| Bajío | 7.7% | 7.8% | 9.3% |
| Sur | 5.5% | 5.2% | 6.4% |
| Cartera Vencida | | | |
| Metropolitano | 41.2% | 41.2% | 37.6% |
| Noroeste – Centro | 17.9% | 15.4% | 21.1% |
| Norte | 12.0% | 11.4% | 11.1% |
| Bajío | 9.2% | 12.6% | 9.7% |
| Sur | 19.7% | 19.4% | 20.5% |

Scotiabank
Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2020)

| No. Acreditados / Grupos | Monto | % Capital Básico |
|--|--------|------------------|
| 1 | 11,013 | 21.39% |
| 2 | 6,447 | 12.52% |
| 3 | 5,995 | 11.64% |
| 4 | 5,977 | 11.61% |
| 5 | 5,653 | 10.98% |
| Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos | | 23,455 |

Scotiabank
Calificación de la Cartera Crediticia
Al 31 de diciembre de 2020
(millones de pesos)

| | Importe Cartera Crediticia | Cartera Comercial | Reservas Preventivas Necesarias | | | Total Reservas Preventivas |
|------------------------------|----------------------------|-------------------|---------------------------------|---|---------------------|----------------------------|
| | | | No Revolventes | Consumo Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes | Cartera de Vivienda | |
| Exceptuada calificada | | | | | | |
| Riesgo A1 | 304,896 | 880 | 111 | 373 | 240 | 1,604 |
| Riesgo A2 | 62,443 | 618 | 37 | 206 | 15 | 876 |
| Riesgo B1 | 25,525 | 377 | 50 | 81 | 13 | 521 |
| Riesgo B2 | 8,766 | 70 | 48 | 48 | 51 | 217 |
| Riesgo B3 | 14,263 | 337 | 22 | 52 | 46 | 457 |
| Riesgo C1 | 5,761 | 115 | 34 | 118 | 76 | 343 |
| Riesgo C2 | 3,664 | 34 | 51 | 215 | 187 | 487 |
| Riesgo D | 8,045 | 1,062 | 99 | 1,127 | 784 | 3,072 |
| Riesgo E | 7,078 | 2,453 | 1,436 | 729 | 805 | 5,423 |
| Total | 440,441 | 5,946 | 1,888 | 2,949 | 2,217 | 13,000 |
| Exceso | | | | | | 4,063 |
| Reservas Constituidas | | | | | | 17,063 |

NOTAS:

- Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas, son las correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 31 de diciembre de 2020.
- La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, pudiendo calificarse por metodologías internas autorizadas por la Comisión.

La institución de crédito utiliza metodología de la CNBV para créditos a cargo personas morales y físicas con actividad empresarial distintas a entidades federativas, municipios y entidades financieras, con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales mayores o iguales a 14 millones de UDIs. Para los portafolios de créditos a cargo de empresas con ventas menores a 14 millones de UDIs, para créditos a cargo de Entidades Federativas y Municipios, créditos para proyectos de Inversión con fuente de pago propia, créditos a cargo de Entidades Financieras, así como para la cartera de crédito menudeo, se utiliza la metodología establecida por la CNBV.

Las instituciones de crédito utilizan los grados de riesgos A-1; A-2; B-1; B-2; B-3; C-1; C-2; D; y E, para efectos de agrupar las reservas preventivas de acuerdo con el tipo de cartera y el porcentaje que las reservas representen del saldo insoluto del crédito, que se establecen en la Sección Quinta "De la constitución de reservas y su clasificación por grado de riesgo", contenida en el Capítulo V del Título Segundo de las citadas disposiciones.

- El exceso en las reservas preventivas constituidas se explica por lo siguiente:

| | |
|---|-----------------|
| -Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida | \$ 56 |
| -Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia) | 31 |
| -Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos | 210 |
| -Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores | <u>3,766</u> |
| Total | \$ 4,063 |

Terminación anticipada de los programas hipotecarios

El 15 y 26 de julio de 2010, se firmó el convenio y se dieron a conocer a través del Diario Oficial de la Federación las Disposiciones de carácter general aplicables en la terminación anticipada a los programas de apoyo para deudores de créditos de vivienda.

Por los descuentos a cargo del Gobierno Federal se reconoció un crédito con vigencia de cinco años pagaderos anualmente, dentro del rubro “Créditos comerciales – Entidades Gubernamentales” formando parte de la cartera de crédito vigente hasta el año 2015.

El Banco recibió hasta el año 2015 cinco pagos anuales por \$366 (\$330 de capital y \$36 de intereses) sobre los descuentos a cargo del Gobierno Federal al amparo del convenio.

Asimismo, los Cetes Especiales que al 31 de diciembre de 2020 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en valores - Títulos conservados al vencimiento” son:

| Scotiabank | | | |
|---|-------------------|--------------|-------------|
| Terminación anticipada de los programas hipotecarios | | | |
| Cetes especiales | | | |
| (millones de pesos) | | | |
| | Títulos | Importe | Vencimiento |
| B4 220707 | 3,961,831 | 510 | 07-jul-22 |
| B4 220804 | 21,792 | 3 | 04-ago-22 |
| B4 270701 | 11,209,686 | 1,443 | 01-jul-27 |
| BC 220804 | 3,115 | - | 04-ago-22 |
| BV 270701 | 6 | - | 01-jul-27 |
| Total | 15,196,430 | 1,956 | |

| Scotiabank | | | |
|---|-------|--------------------------|------|
| Tasas Pagadas en Captación Tradicional | | | |
| (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020) | | | |
| | Pesos | Tasa Promedio Dólares | Udis |
| Depósitos a la vista (incluye ahorro) | 2.18% | 0.27% | - |
| Depósitos a plazo | 5.21% | 0.00% | - |

| Scotiabank | | | | | | |
|---|----------------|-----------------|---------------------|-------------------|--------------|---------------|
| Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos | | | | | | |
| (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020) | | | | | | |
| Vencimiento | Préstamos | | Financiamiento | | Otros | Total |
| | Banca Múltiple | Banco de México | Banca de Desarrollo | Fondos de Fomento | Organismos | |
| Pesos | | | | | | |
| Inmediato | - | - | - | - | - | - |
| Mediano | - | 101 | 6,139 | 10,745 | 4,733 | 21,718 |
| Largo | - | - | 25,000 | 6,071 | - | 31,071 |
| Total | - | 101 | 31,139 | 16,816 | 4,733 | 52,789 |
| Tasa Promedio | 0.00% | 4.55% | 5.88% | 4.71% | 4.83% | |
| Otros | | | | | | |
| Inmediato | - | - | - | - | - | - |
| Mediano | 10,966 | - | 18 | 434 | 10 | 11,428 |
| Largo | - | - | - | 404 | 1,991 | 2,395 |
| Total | 10,966 | - | 18 | 838 | 2,001 | 13,823 |
| Tasa Promedio | 0.41% | - | 2.43% | 1.00% | 1.03% | |
| Total Préstamos Interbancarios | 10,966 | 101 | 31,157 | 17,654 | 6,734 | 66,612 |

Scotiabank no cuenta con créditos o financiamientos específicos que representen más del 10% de los pasivos que se muestran en sus estados financieros al 31 de diciembre de 2020.

| Scotiabank Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional | 31 dic 2019 | 30 sep 2020 | 31 dic 2020 |
|--|----------------|----------------|----------------|
| Depósitos a la Vista | 51.7% | 50.2% | 54.3% |
| Metropolitano | 25.3% | 21.4% | 24.3% |
| Noroeste – Centro | 7.4% | 11.9% | 10.5% |
| Norte | 7.2% | 7.7% | 8.1% |
| Bajío | 5.7% | 3.6% | 5.5% |
| Sur | 6.1% | 5.7% | 5.9% |
| Depósitos Ventanilla | 33.8% | 41.6% | 41.5% |
| Metropolitano | 13.4% | 21.8% | 20.7% |
| Noroeste - Centro | 4.8% | 4.8% | 5.1% |
| Norte | 6.4% | 7.3% | 7.0% |
| Bajío | 4.6% | 2.4% | 3.9% |
| Sur | 4.6% | 5.4% | 4.8% |
| Total de Captación del Público | 85.5% | 91.9% | 95.8% |
| Fondeo Profesional | 14.5% | 8.1% | 4.2% |

| Scotiabank Impuestos Diferidos (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020) | |
|---|--------------|
| Pérdida de arrastre fiscal | 7 |
| Provisión por pérdidas de crédito | 5,095 |
| Compensación diferida | (1,049) |
| Ingresos diferidos | 625 |
| Instalaciones y equipos / depreciación | 623 |
| Beneficios a los empleados | 340 |
| Provisiones | 336 |
| Otros | 685 |
| Efecto Neto en Diferido | 6,662 |

Al 31 de diciembre de 2020, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

| Scotiabank Resultados por Intermediación (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020) | | |
|---|---|--|
| | Resultados del periodo por Valuación | Resultados del periodo por Compra - Venta |
| Inversiones en valores | 6 | 491 |
| Operaciones con instrumentos financieros derivados de negociación y cobertura | (347) | 829 |
| Divisas y otros | (19) | 1,374 |
| Total | (360) | 2,694 |

Criterios Contables Especiales aplicables a los programas de apoyo otorgados por Scotiabank en respuesta a la contingencia sanitaria ocasionada por el virus COVID-19

Programas de apoyo

Mediante oficios número P-285/2020 y 026/2020 de fecha 26 de marzo y 15 de abril de 2020, respectivamente, la Comisión Bancaria determinó emitir con carácter temporal, los CCE aplicables a los programas de apoyo otorgados por el Banco. Posteriormente, mediante oficio número P-325/2020 de fecha 23 de junio de 2020, la Comisión Bancaria indicó lo siguiente:

- Los CCE serán aplicados de manera general a los clientes que se hayan visto afectados y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo 2020.
- El plazo para realizar los trámites de reestructuración o renovación deberán concluir a más tardar el 31 de julio de 2020.

Los programas de apoyo consisten en otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 4 meses y con posibilidad de extenderlo a 2 meses adicionales, otorgando un período de gracia total hasta de 6 meses. Será de 18 meses tratándose de créditos otorgados a los sectores primarios agrícola, ganadero, forestal y pesquero; y a los sectores industrial, comercial y servicios que estén integrados los citados sectores primarios.

Lo anterior será aplicable a los siguientes tipos de crédito y para clientes que se encuentren clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo de 2020:

- a. Créditos para la construcción de vivienda.
- b. Créditos individuales con garantía hipotecaria.
- c. Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).
- d. Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial.
- e. Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.
- f. Microcréditos individuales o grupales.

Para los CCE no se consideran como reestructuras y/o renovaciones y serán consideradas como cartera vigente los siguientes:

1. Créditos con “pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento”, que sean reestructurados o renovados, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 79 del Criterio Contable B-6 “Cartera de Crédito” (el “Criterio Contable B-6”) contenido en el Anexo 33 de la Circular única de Bancos (“CUB”). Esto siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.
2. Para créditos con “pagos periódicos de principal e intereses”, que se reestructuren o renueven, podrán considerarse como vigentes al momento en que se lleve a cabo dicho acto, sin que sea aplicable lo que establecen los párrafos 82 y 84 del Criterio Contable B-6. Esto siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.
3. Los créditos que desde su inicio se estipule su carácter revolvente, que se reestructuren o renueven, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 80 y 81 del Criterio Contable B-6. Esto siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

En relación a los créditos citados en los numerales anteriores, estos no se considerarán como reestructurados conforme lo que establece el párrafo 40 del Criterio Contable B-6.

4. En caso de incluir quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, las Instituciones podrán diferir la constitución de Estimaciones Preventivas de Riesgos Crediticios (“EPRC”), cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que la EPRC se constituirá una reserva por la diferencia en un período que no exceda el ejercicio de 2020.

El detalle por tipo de cartera de los importes que se hubieran registrado y presentado en el balance general consolidado y en el estado consolidado de resultados al 31 de diciembre de 2020, de no haber aplicado los criterios contables especiales se presenta a continuación:

| Concepto | Saldos apoyo COVID | Efectos | Saldo sin apoyo COVID |
|--|--------------------|----------------------|-----------------------|
| Balance General | | | |
| Cartera de crédito vigente | | | |
| Créditos comerciales | 217,299 | (26) | 217,273 |
| Créditos consumo | 39,036 | 402 | 39,438 |
| Créditos vivienda | 146,210 | (2,803) | 143,407 |
| Subtotal cartera vigente | 402,545 | (2,427) | 400,118 |
| Cartera de crédito vencida | | | |
| Créditos comerciales | 4,852 | 26 | 4,878 |
| Créditos consumo | 2,526 | (484) | 2,042 |
| Créditos vivienda | 5,283 | 2,632 | 7,915 |
| Subtotal cartera vencida | 12,661 | 2,174 | 14,835 |
| Total Cartera de crédito | 415,206 | (253) | 414,953 |
| (Menos) Estimación preventiva para riesgos crediticios | | | |
| Créditos comerciales | 5,719 | 27 | 5,746 |
| Créditos consumo | 4,837 | 820 | 5,657 |
| Créditos vivienda | 2,217 | 1,612 | 3,829 |
| Operaciones contingentes y avales | 227 | - | 227 |
| Estimación preventiva para riesgos crediticios derivada de la calificación | 13,000 | 2,459 | 15,459 |
| Estimación preventiva para riesgos crediticios adicional | 4,063 | (3,750) ¹ | 313 |
| Total Estimación preventiva para riesgos crediticios | 17,063 | (1,291) | 15,772 |
| Cartera de crédito (neta) | 398,143 | 1,038 | 399,181 |
| Cuentas de Orden | | | |
| Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida | 644 | 234 | 878 |
| Estado de Resultados | | | |
| Ingresos por intereses de Cartera | | | |
| Créditos comerciales | 16,702 | - | 16,702 |
| Créditos consumo | 8,784 | (62) | 8,722 |
| Créditos vivienda | 14,552 | (172) | 14,380 |
| Total Ingresos por intereses de Cartera | 40,038 | (234) | 39,804 |
| Estimación preventiva para riesgos crediticios | | | |
| Créditos comerciales | 1,061 | 27 | 1,088 |
| Créditos consumo | 4,121 | 839 | 4,960 |
| Créditos vivienda | 1,169 | 1,612 | 2,781 |
| Operaciones contingentes y avales | (3) | - | (3) |
| Estimación preventiva para riesgos crediticios derivada de la calificación | 6,348 | 2,478 | 8,826 |
| Estimación preventiva para riesgos crediticios adicional | 3,816 | (3,750) ¹ | 66 |
| Total Estimación preventiva para riesgos crediticios | 10,164 | (1,272) | 8,892 |

¹El Banco ha constituido a la fecha \$3,750 millones de reservas adicionales por efectos de COVID-19, con la finalidad de cubrir riesgos incrementales que no se encuentran actualmente previstos en las diferentes metodologías de calificación; las cuales cubren las necesidades en caso de no contar con criterios contables especiales.

Mediante oficio número 141-5/2263/2020 de fecha 2 de septiembre de 2020, la Comisión Bancaria extendió el plazo hasta el 30 de septiembre de 2020 para que el Banco pudiera aplicar los planes de reestructura o renovación para aquellos clientes ya inscritos en el programa de apoyo al 31 de julio de 2020, y que requieren dos meses adicionales de diferimiento para que de esta forma cuenten con los 6 meses de diferimiento al amparo de los CCE, establecidos en los oficios de fechas 26 de marzo, 15 de abril y 23 de junio de 2020.

Emisión de Certificados Bursátiles

Las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

| | Quinta* | Cuarta** | Quinta** | Septima** | Septima** | Primera*** | Segunda*** | Primera*** |
|------------------------------------|---|-----------------------------|-----------------------------|---|---|-----------------------------|--|--------------------------------------|
| Clave de Pizarra | SCOTIAB 13-2 | SCOTIAB 17-2 | SCOTIAB 17-3 | SCOTIAB 18 | SCOTIAB 18 (reapertura) | SCOTIAB 19 | SCOTIAB 19D | SCOTIAB 19 (reapertura) ¹ |
| Monto de la Emisión | \$1,150 millones | \$2,875 millones | \$3,450 millones | \$3,450 millones | \$2,875 millones | \$3,653 millones | \$123 millones dólares | \$2,352 millones |
| Fecha de Emisión y Colocación | 28 junio 2013 | 4 abril 2017 | 18 agosto 2017 | 16 marzo 2018 | 22 marzo 2018 | 27 mayo 2019 | 28 mayo 2019 | 29 julio 2019 |
| Plazo de Vigencia de la Emisión | 3,640 días, 20 períodos 182 días, aprox. 10 años | 1,820 días, aprox. 5 años | 1,456 días, aprox. 4 años | 1,459 días aprox. 4 años | 1,459 días aprox. 4 años | 1,263 días, aprox. 3.5 años | 1,260 días, aprox. 3.5 años | 1,200 días, aprox. 3.3 años |
| Garantía | Quirografaria | Quirografaria | Quirografaria | Quirografaria | Quirografaria | Quirografaria | Quirografaria | Quirografaria |
| Tasa de interés | 7.30% Fijo | TIIE 28 + 0.50% | TIIE 28 + 0.36% | TIIE 28 + 0.24% | TIIE 28 + 0.24% | TIIE 28 + 0.18% | LIBOR 3 MESES + 0.57% | TIIE 28 + 0.18% |
| Pago de Intereses | Cada 182 días durante la vigencia de la emisión | Cada 28 días | Cada 28 días | Cada 28 días para los primeros 51 períodos el último período tendrá una vigencia de 31 días | Cada 28 días para los primeros 51 períodos el último período tendrá una vigencia de 31 días | Cada 28 días | Cada 90 días | Cada 28 días |
| Calificaciones otorgadas Fitch/S&P | AAA(mex) /"mxAAA" | AAA(mex) /"mxAAA" | AAA(mex) /"mxAAA" | AAA(mex) /"mxAAA" | AAA(mex) /"mxAAA" | AAA(mex) /"mxAAA" | AAA(mex) /"mxAAA" | AAA(mex) /"mxAAA" |
| Amortización del principal | Un sólo pago al vencimiento | Un sólo pago al vencimiento | Un sólo pago al vencimiento | Un sólo pago al vencimiento | Un sólo pago al vencimiento | Un sólo pago al vencimiento | Un sólo pago al vencimiento en dólares | Un sólo pago al vencimiento |

| | Segunda*** | Tercera*** |
|------------------------------------|--|-----------------------------|
| Clave de Pizarra | SCOTIAB 19D (reapertura) ¹ | SCOTIAB 19-2 |
| Monto de la Emisión | \$112 millones dólares | \$6,000 millones |
| Fecha de Emisión y Colocación | 29 julio 2019 | 6 diciembre 2019 |
| Plazo de Vigencia de la Emisión | 1,198 días, aprox. 3.3 años | 1,207 días, aprox. 3.3 años |
| Garantía | Quirografaria | Quirografaria |
| Tasa de interés | LIBOR 3 MESES + 0.57% | TIIE 28 + 0.15% |
| Pago de Intereses | Cada 90 días | Cada 28 días |
| Calificaciones otorgadas Fitch/S&P | AAA(mex) /"mxAAA" | AAA(mex) /"mxAAA" |
| Amortización del principal | Un sólo pago al vencimiento en dólares | Un sólo pago al vencimiento |

* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

** Programa autorizado por la CNBV en septiembre de 2015

*** Programa autorizado por la CNBV en diciembre de 2018

¹ Las reaperturas SCOTIAB 19 y SCOTIAB 19D fueron autorizadas el 24 de Julio 2019.

Emisión de Obligaciones Subordinadas

| Fecha Inicio | Fecha Vencimiento | ISIN | Plazo (días) | Importe (\$) | Tasa (%) |
|---|-------------------|--------------|--------------|----------------------|----------|
| 18-diciembre-14 | 05-diciembre-24 | MX0QSC1N0016 | 3,640 | 2,093,000,000 | 7.4 |
| 28-junio-18 | 09-junio-33 | MX0QSC1N0024 | 5,460 | 3,360,000,000 | 12.3 |
| 11-septiembre-18 | Perpetua | MX0QSC1N0032 | - | 3,455,000,000 | 11.3 |
| Total de Obligaciones Subordinadas | | | | 8,908,000,000 | |

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

A continuación, se detallan las emisiones de bonos bancarios estructurados con los que cuenta Scotiabank actualmente:

| Clave | Número de títulos | Fecha de Emisión | Vencimiento | Plazo (días) | Subyacente | Monto |
|---|-------------------|------------------|-------------|--------------|----------------|------------------------|
| BONO SCOTIAB 2-19 | 716,915 | 11-abr-19 | 09-abr-21 | 729 | NIKKEI 225 | 71,691,500 |
| BONO SCOTIAB 4-19 | 980,100 | 22-may-19 | 21-may-21 | 730 | S&P/TSX 60 | 98,010,000 |
| BONO SCOTIAB 6-19 | 238,250 | 04-jun-19 | 03-jun-21 | 730 | S&P/TSX 60 | 23,825,000 |
| BONO SCOTIAB 9-19 | 1,403,500 | 25-jul-19 | 22-jul-21 | 728 | TIIIE28 | 140,350,000 |
| BONO SCOTIAB 10-19 | 344,200 | 04-sep-19 | 04-mar-21 | 547 | IPC | 34,420,000 |
| BONO SCOTIAB 12-19 | 529,100 | 22-nov-19 | 22-nov-21 | 731 | MSFDVTHY INDEX | 52,910,000 |
| BONO SCOTIAB 13-19 | 663,200 | 22-nov-19 | 22-nov-22 | 731 | MSFDVTHY INDEX | 66,320,000 |
| BONO SCOTIAB 01-20 | 949,800 | 29-ene-20 | 22-ene-21 | 359 | SPX | 94,980,000 |
| BONO SCOTIAB 02-20 | 870,100 | 29-ene-20 | 22-ene-21 | 359 | USDMXN | 87,010,000 |
| BONO SCOTIAB 04-20 | 100,000 | 13-feb-20 | 05-feb-21 | 358 | SPX | 10,000,000 |
| BONO SCOTIAB 05-20 | 1,930,500 | 19-feb-20 | 17-feb-23 | 1,094 | MSFDVTIG IDEX | 193,050,000 |
| BONO SCOTIAB 06-20 | 6,515,910 | 27-mar-20 | 27-mar-23 | 1,095 | MSFDVTIG IDEX | 651,591,000 |
| BONO SCOTIAB 07-20 | 7,956,100 | 14-may-20 | 12-may-23 | 1,093 | SPXSRT5E INDEX | 795,610,000 |
| BONO SCOTIAB 08-20 | 415,850 | 11-jun-20 | 09-jun-23 | 1,093 | SPXSRT5E INDEX | 41,585,000 |
| BONO SCOTIAB 09-20 | 633,800 | 28-dic-20 | 27-dic-21 | 364 | USDMXN | 63,380,000 |
| Total Bonos Bancarios al 31 de diciembre de 2020 | | | | | | \$2,424,732,500 |

Capitalización

| Scotiabank Integración del Capital Revelación de la integración del Capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios. (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020) | | |
|---|---|-----------|
| 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 | 10,877 |
| 2 | Resultado de ejercicios anteriores | 36,432 |
| 3 | Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) | 8,013 |
| 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 | 55,322 |
| 7 | Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios 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) | - |
| 10 conservador | Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) | - |
| 11 | Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo | - |
| 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 | - |
| 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) | 1,769 |
| 22 | Monto que excede el umbral del 15% del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras | No aplica |
| 23 | del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras | No aplica |
| 24 | del cual: Derechos de servicios hipotecarios | No aplica |
| 25 | del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales | No aplica |
| 26 | Ajustes regulatorios nacionales | 5,546 |
| 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 propia | - |

| | | |
|----------------|---|-----------|
| I | del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones | - |
| J | del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados | 5,260 |
| K | del cual: Posiciones en Esquemas de Primera 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 | Se Deroga | - |
| P | del cual: Inversiones en cámaras de compensación | 286 |
| 27 | Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones | - |
| 28 | Ajustes regulatorios totales al capital común | 7,315 |
| 29 | Capital común de nivel 1 (CET1) | 48,007 |
| | Capital adicional de nivel 1: instrumentos | |
| 30 | Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima | 3,580 |
| 31 | de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables | 3,580 |
| 32 | de los cuales: Clasificados como pasivos 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 | 3,580 |
| | 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 de 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 | - |
| 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 | - |
| 44 | Capital adicional de nivel 1 (AT1) | 3,580 |
| 45 | Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) | 51,587 |
| | Capital de nivel 2: instrumentos y reservas | |
| 46 | Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima | 4,631 |
| 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, de 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 |
| 50 conservador | Reservas | 21 |
| 51 | Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios | 4,652 |
| 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 las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido | No aplica |
| 56 | Ajustes regulatorios nacionales | - |
| 57 | Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2 | - |

| | | |
|----|--|-----------|
| 58 | Capital de nivel 2 (T2) | 4,652 |
| 59 | Capital total (TC = T1 + T2) | 56,239 |
| 60 | Activos ponderados por riesgo totales | 404,186 |
| | Razones de capital y suplementos | |
| 61 | Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) | 11.88% |
| 62 | Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) | 12.76% |
| 63 | Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) | 13.91% |
| 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 D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) | 14.98% |
| 65 | del cual: Suplemento de conservación de capital | 2.50% |
| 66 | del cual: Suplemento contracíclico bancario específico | 0.00% |
| 67 | del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB) | 0.60% |
| 68 | Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) | 4.88% |
| | 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 (neto de los 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 de límite) | 21 |
| 77 | Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada | 2,057 |
| 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 de 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 |
| | Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022) | |
| 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) | - |

| Referencia | Descripción |
|----------------|--|
| 1 | Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 2 | Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones. |
| 3 | Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo, resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remediones por beneficios definidos a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones. |
| 4 | No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté representado por títulos representativos o acciones. |
| 5 | No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado. |
| 6 | Suma de los conceptos 1 a 5. |
| 7 | No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado. |
| 8 | Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 9 | Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 10 conservador | Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 11 | Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo. |
| 12 conservador | Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable. |
| | Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| | Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como aquéllas constituidas con cargo a cuentas contables que no formen parte de las partidas de resultados o del capital contable y no sólo la diferencia positiva entre las Pérdidas Esperadas Totales menos las Reservas Admisibles Totales, en el caso de que las Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital. |
| 13 | Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 14 | No aplica. |
| 15 | Inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos que corresponden a los recursos a los que la Institución no tiene acceso irrestricto e ilimitado. Estas inversiones se considerarán netas de los pasivos del plan y de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo que correspondan que no hayan sido aplicados en algún otro ajuste regulatorio. |
| 16 conservador | El monto de la inversión en cualquier acción propia que la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de los fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. |
| | Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido. |
| 17 conservador | Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del Grupo Financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I |

| | |
|----------------|---|
| | <p>inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.</p> |
| 18 conservador | <p>Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.</p> |
| 19 conservador | <p>Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.</p> |
| 20 conservador | <p>Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.</p> |
| 21 | <p>El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.</p> |
| 22 | No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21. |
| 23 | No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19. |
| 24 | No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20. |
| 25 | No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21. |
| 26 | Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos. |
| A | A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa. |
| B | B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| C | C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| D | D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo. |

| | |
|----------------|---|
| E | E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en fondos de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| F | F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| G | G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de fondos de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable del citado fondo de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores. |
| H | H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del Grupo Financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| I | I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| J | J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| K | K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6. |
| L | L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| M | M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso s) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| N | N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15. |
| O | O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo. |
| P | P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6. |
| 27 | No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1. |
| 28 | Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27. |
| 29 | Renglón 6 menos el renglón 28. |
| 30 | El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones. |
| 31 | Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables. |
| 32 | No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital. |
| 33 | Obligaciones subordinadas computables como capital básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a). |
| 34 | No aplica. Ver la nota de la referencia 5. |
| 35 | No aplica. Ver la nota de la referencia 5. |
| 36 | Suma de los renglones 30, 33 y 34. |
| 37 conservador | No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1. |
| 38 conservador | No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1. |
| 39 conservador | No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1. |
| 40 conservador | No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1. |
| 41 | Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo. |
| 42 | No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1. |
| 43 | Suma de los renglones 37 a 42. |
| 44 | Renglón 36, menos el renglón 43. |
| 45 | Renglón 29, más el renglón 44. |

| | |
|----------------|---|
| 46 | El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el capital Fundamental ni en el capital básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones. |
| 47 | Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a. |
| 48 | No aplica. Ver la nota de la referencia 5. |
| 49 | No aplica. Ver la nota de la referencia 5. |
| 50 | Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7. |
| 51 | Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50. |
| 52 conservador | No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1. |
| 53 conservador | No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1. |
| 54 conservador | No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1. |
| 55 conservador | No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1. |
| 56 | Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo. |
| 57 | Suma de los renglones 52 a 56. |
| 58 | Renglón 51, menos renglón 57. |
| 59 | Renglón 45, más renglón 58. |
| 60 | Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales. |
| 61 | Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje). |
| 62 | Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje). |
| 63 | Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje). |
| 64 | Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61,65, 66 y 67. |
| 65 | Reportar 2.5% |
| 66 | Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción III, del Artículo 2 Bis 5. |
| 67 | La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5. |
| 68 | Renglón 61 menos 7%. |
| 69 | No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011. |
| 70 | No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011. |
| 71 | No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011. |
| 72 | No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18. |
| 73 | No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19. |
| 74 | No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20. |
| 75 | El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes. |
| 76 | Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito. |
| 77 | 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito. |
| 78 | Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito. |
| 79 | 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito. |

| | |
|----|---|
| 80 | No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1. |
| 81 | No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1. |
| 82 | Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos. |
| 83 | Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33. |
| 84 | Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos. |
| 85 | Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47. |

Scotiabank
Relación del Capital neto con el Balance General
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2020)

| Referencias de los rubros del balance general | Rubros del Balance General | Monto presentado en el balance general |
|---|--|--|
| | Activo | |
| BG1 | Disponibilidades | 29,117 |
| BG2 | Cuentas de Margen | 2,659 |
| BG3 | Inversiones en valores | 125,870 |
| BG4 | Deudores por reporto | 27,835 |
| BG5 | Préstamo de valores | - |
| BG6 | Derivados | 23,996 |
| BG7 | Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros | 576 |
| BG8 | Total de cartera de crédito (neto) | 398,143 |
| BG9 | Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización | - |
| BG10 | Otras cuentas por cobrar (neto) | 12,238 |
| BG11 | Bienes adjudicados (neto) | 201 |
| BG12 | Inmuebles, mobiliario y equipo (neto) | 1,736 |
| BG13 | Inversiones permanentes | 3,165 |
| BG14 | Activos de larga duración disponibles para la venta | 22 |
| BG15 | Impuestos y PTU diferidos (neto) | 6,747 |
| BG16 | Otros activos | 5,873 |
| | Pasivo | |
| BG17 | Captación tradicional | 406,570 |
| BG18 | Préstamos interbancarios y de otros organismos | 66,612 |
| | Valores asignados por liquidar | 3,193 |
| BG19 | Acreedores por reporto | 44,671 |
| BG20 | Préstamo de valores | - |
| BG21 | Colaterales vendidos o dados en garantía | 523 |
| BG22 | Derivados | 26,298 |
| BG23 | Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros | 13 |
| BG24 | Obligaciones en operaciones de bursatilización | - |
| BG25 | Otras cuentas por pagar | 24,273 |
| BG26 | Obligaciones subordinadas en circulación | 9,052 |
| BG27 | Impuestos y PTU diferidos (neto) | - |
| BG28 | Créditos diferidos y cobros anticipados | 1,651 |
| | Capital contable | |
| BG29 | Capital contribuido | 10,877 |
| BG30 | Capital ganado | 44,445 |
| | Cuentas de orden | |
| BG31 | Avales otorgados | - |
| BG32 | Activos y pasivos contingentes | - |
| BG33 | Compromisos crediticios | 276,490 |
| BG34 | Bienes en fideicomisos o mandato | 426,701 |
| BG35 | Agente financiero del gobierno federal | - |
| BG36 | Bienes en custodia o en administración | 54,736 |
| BG37 | Colaterales recibidos por la entidad | 36,697 |

| | | |
|------|--|-----------|
| BG38 | Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad | 523 |
| BG39 | Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto) | 135,628 |
| BG40 | Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida | 644 |
| BG41 | Otras cuentas de registro | 1,466,255 |

Scotiabank

Relación del Capital neto con el Balance General

Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital neto (millones de pesos al 31 de diciembre de 2020)

| 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 de Capital Neto | Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada |
|---------------|--|---|---|--|
| | ACTIVO | | | |
| 1 | Crédito mercantil | 8 | - | |
| 2 | Otros Intangibles | 9 | - | |
| 3 | Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales | 10 | - | |
| 4 | Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización | 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 | - | |
| 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 | - | |
| 12 | Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales | 21 | 1,769 | BG 15 Impuestos y PTU Diferidos (Neto) \$1,769 |
| 13 | Reservas reconocidas como capital complementario | 50 | 21 | BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$21 |
| 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 | 5,260 | BG 16 Activos Intangibles \$2,865 más Gastos de Instalación \$2,395 |
| 21 | Participación de los trabajadores en la utilidades (neta) | 26-L | - | |

| | | | | |
|----|--|---------------|---------|---|
| 22 | Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos | 26-N | - | |
| 23 | Inversiones en cámara de compensación | 26-P | 286 | BG 13 Inversiones Permanentes \$ 286 |
| | 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 | Pasivo del plan de pensiones por beneficios 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 | 3,580 | BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,580 |
| 30 | Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental | 33 | - | |
| 31 | Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S | 46 | 4,631 | BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$4,631 |
| 32 | Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario | 47 | - | |
| 33 | Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados | 26-J | - | |
| | CAPITAL CONTABLE | | | |
| 34 | Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q | 1 | 10,877 | BG 29 Capital Social \$10,404 más Prima en Venta de Acciones \$473 |
| 35 | Resultado de ejercicios anteriores | 2 | 36,432 | BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$36,432 |
| 36 | Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable | 3 | (1,161) | BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$(1,161) |
| 37 | Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores | 3 | 9,174 | BG 30 Reservas de Capital \$6,758 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta \$417 más Remedición por beneficios definidos a los empleados (\$1,020) más Resultado Neto \$3,020 |
| 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 | Identificador | | |

| | | | |
|----|---|------|------------------------|
| 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 | - Estado de Resultados |
| 46 | Operaciones que contravengan las disposiciones | 26-I | - |
| 47 | Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes | 26-M | - |
| 48 | Derogado | | |

Scotiabank

Nota a los Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto

| Identificador | Descripción |
|---------------|--|
| 1 | Crédito mercantil. |
| 2 | Intangibles, sin incluir al crédito mercantil. |
| 3 | Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales. |
| 4 | Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización. |
| 5 | Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado. |
| 6 | Cualquier acción propia que la Institución adquiera de conformidad con lo previsto en la Ley, que no hayan sido restadas; considerando aquellos montos adquiridos a través de las inversiones en índices de valores y el monto correspondiente a las inversiones en sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18 |
| 7 | Inversiones en acciones de sociedades distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) de la fracción I del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas, considerando aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18. |
| 8 | Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades. |
| 9 | Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades. |
| 10 | Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades. |
| 11 | Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades. |
| 12 | Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales. |
| 13 | Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito. |
| 14 | Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 15 | Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo. |
| 16 | Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 17 | Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 18 | Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores. |

| | |
|----|--|
| 19 | Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de estas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 20 | Cargos diferidos y pagos anticipados. |
| 21 | La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 22 | Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos que tengan ser deducidas de acuerdo con el Artículo 2 Bis 8 de las presentes disposiciones. |
| 23 | Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6. |
| 24 | Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al crédito mercantil. |
| 25 | Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a otros intangibles (distintos al crédito mercantil). |
| 26 | Pasivos del plan de pensiones por beneficios definidos asociados a inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos. |
| 27 | Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al plan de pensiones por beneficios definidos. |
| 28 | Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales distintos los de las referencias 24, 25, 27 y 33. |
| 29 | Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-R de las presentes disposiciones. |
| 30 | Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital Básico No Fundamental. |
| 31 | Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-S de las presentes disposiciones. |
| 32 | Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario. |
| 33 | Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a cargos diferidos y pagos anticipados. |
| 34 | Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-Q de las presentes disposiciones. |
| 35 | Resultado de ejercicios anteriores. |
| 36 | Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a valor razonable. |
| 37 | Resultado neto y resultado por valuación de títulos disponibles para la venta. |
| 38 | Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones. |
| 39 | Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-S de las presentes disposiciones. |
| 40 | Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a costo amortizado. |
| 41 | Efecto acumulado por conversión. |
| 42 | Resultado por tenencia de activos no monetarios. |
| 43 | Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6. |
| 44 | Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 45 | El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 46 | Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 47 | El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 48 | Derogado |

Scotiabank
**Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2020)**

| Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo | Importe de posiciones equivalentes | Requerimiento de capital |
|---|------------------------------------|--------------------------|
| Operaciones en moneda nacional con tasa nominal | 26,850 | 2,148 |
| Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable | 1,863 | 149 |
| Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's | 388 | 31 |
| Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General | - | - |
| Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC | - | - |
| Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General | - | - |
| Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal | 2,125 | 170 |
| Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio | 1,150 | 92 |
| Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones | 325 | 26 |
| Posiciones en Mercancía | - | - |
| Requerimiento de capital por impacto Gamma | - | - |
| Requerimiento de capital por impacto Vega | - | - |
| Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo | Activos ponderados por riesgo | Requerimiento de capital |
| Grupo I-A (ponderados al 0%) | - | - |
| Grupo I-A (ponderados al 10%) | - | - |
| Grupo I-A (ponderados al 20%) | - | - |
| Grupo I-B (ponderados al 2%) | 2 | - |
| Grupo I-B (ponderados al 4%) | - | - |
| Grupo II (ponderados al 0%) | - | - |
| Grupo II (ponderados al 10%) | - | - |
| Grupo II (ponderados al 20%) | 40 | 3 |
| 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%) | 669 | 53 |
| Grupo III (ponderados al 11.5%) | - | - |
| Grupo III (ponderados al 20%) | 3,236 | 259 |
| Grupo III (ponderados al 23%) | - | - |
| Grupo III (ponderados al 25%) | 46 | 4 |
| Grupo III (ponderados al 50%) | 515 | 41 |
| Grupo III (ponderados al 57.5%) | - | - |
| Grupo III (ponderados al 100%) | - | - |
| 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%) | 1,946 | 156 |
| Grupo V (ponderados al 10%) | - | - |
| Grupo V (ponderados al 20%) | 550 | 44 |
| Grupo V (ponderados al 50%) | - | - |
| Grupo V (ponderados al 115%) | - | - |
| Grupo V (ponderados al 150%) | 1,654 | 132 |
| Grupo VI (ponderados al 20%) | - | - |
| Grupo VI (ponderados al 50%) | 30,354 | 2,428 |
| Grupo VI (ponderados al 75%) | 19,068 | 1,525 |

| | | |
|--|---------|--------|
| Grupo VI (ponderados al 100%) | 92,865 | 7,429 |
| Grupo VI (ponderados al 120%) | - | - |
| Grupo VI (ponderados al 150%) | - | - |
| Grupo VI (ponderados al 172.5%) | - | - |
| Grupo VII_A (ponderados al 10%) | - | - |
| Grupo VII_A (ponderados al 11.5%) | 450 | 36 |
| Grupo VII_A (ponderados al 20%) | 11,594 | 928 |
| Grupo VII_A (ponderados al 23%) | 1,061 | 85 |
| Grupo VII_A (ponderados al 25%) | - | - |
| Grupo VII_A (ponderados al 50%) | 8,555 | 684 |
| Grupo VII_A (ponderados al 57.5%) | - | - |
| Grupo VII_A (ponderados al 100%) | 152,794 | 12,224 |
| Grupo VII_A (ponderados al 115%) | 2 | - |
| Grupo VII_A (ponderados al 120%) | 603 | 48 |
| 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%) | 256 | 21 |
| 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 115%) | 4,411 | 353 |
| Grupo VIII (ponderados al 150%) | 2,244 | 179 |
| Grupo IX (ponderados al 100%) | 14,741 | 1,179 |
| Grupo IX (ponderados al 115%) | - | - |
| 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 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%) | - | - |
| Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas | 5,181 | 415 |
| Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación | 17 | 1 |

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

| Método empleado | Activos ponderados por riesgo | Requerimiento de capital |
|---|-------------------------------|--------------------------|
| Estándar Alternativo | 18,631 | 1,491 |
| Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses | 27,418 | |

Categoría Capitalización

Al 31 de diciembre de 2020, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 10.65%, por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

| Scotiabank | | |
|---|---|--|
| Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio | | |
| Referencia | Características | Opciones |
| 1 | Emisor | Scotiabank Inverlat, S.A. , Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat |
| 2 | Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg | N.A. |
| 3 | Marco legal | Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito. |
| Tratamiento regulatorio | | |
| 4 | Nivel de capital con transitoriedad | N.A. |
| 5 | Nivel de capital sin transitoriedad | Fundamental |
| 6 | Nivel del instrumento | Institución de crédito sin consolidar subsidiarias |
| 7 | Tipo de Instrumento | Acción series "F" y "B" |
| 8 | Monto reconocido en el capital regulatorio | 10,876,764,482 |
| 9 | Valor nominal del instrumento | Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales |
| 9A | Moneda del instrumento | Pesos mexicanos |
| 10 | Clasificación contable | Capital |
| 11 | Fecha de emisión | 13-ene-01 |
| 12 | Plazo del instrumento | Perpetuidad |
| 13 | Fecha de vencimiento | Sin vencimiento |
| 14 | Cláusula de pago anticipado | No |
| 15 | Primera fecha de pago anticipado | N.A. |
| 15A | Eventos regulatorios o fiscales | No |
| 15B | Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado | N.A. |
| 16 | Fechas subsecuentes de pago anticipado | N.A. |
| Rendimientos / dividendos | | |
| 17 | Tipo de rendimiento / dividendo | Fijo o Variable |
| 18 | Tasa de Interés /Dividendo | La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre. |
| 19 | Cláusula de cancelación anticipada | Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades. |
| 20 | Discrecionalidad en el pago | Parcialmente discrecional. |
| 21 | Cláusula de aumento de intereses | No |
| 22 | Rendimientos / dividendos | No Acumulable |
| 23 | Convertibilidad del instrumento | N.A. |
| 24 | Condiciones de convertibilidad | N.A. |
| 25 | Grado de convertibilidad | N.A. |
| 26 | Tasa de conversión | N.A. |
| 27 | Tipo de convertibilidad del instrumento | N.A. |
| 28 | Tipo de instrumento financiero de la convertibilidad | N.A. |

| | | |
|----|--|--|
| 29 | Emisor del instrumento | Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social. |
| 30 | Cláusula de disminución de valor (Write-Down) | No |
| 31 | Condiciones para disminución de valor | N.A. |
| 32 | Grado de baja de valor | N.A. |
| 33 | Temporalidad de la baja de valor | N.A. |
| 34 | Mecanismos de disminución de valor temporal | N.A. |
| 35 | Posición de subordinación en caso de liquidación | Los títulos de las acciones están sujetos a las disposiciones que en su caso emite la Secretaría de Hacienda y Crédito Público y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, así como lo que al efecto dispongan los Estatutos Sociales. |
| 36 | Características de incumplimiento | No |
| 37 | Descripción de características de incumplimiento | No |

Scotiabank

Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio

| Referencia | Descripción |
|------------|--|
| 1 | Institución de crédito que emite el título que forma parte del Capital Neto. |
| 2 | Identificador o clave del título que forma parte del Capital Neto, (ISIN, CUSIP o número identificador de valor internacional). |
| 3 | Marco legal con el que el título deberá de cumplir, así como las leyes sobre a las cuales se sujetará. |
| 4 | Nivel de capital al que corresponde el título que está sujeto a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a. |
| 5 | Nivel de capital al que corresponde el título que cumple con el anexo 1-Q, 1-R, o 1-S de las presentes disposiciones. |
| 6 | Nivel dentro del grupo al cual se incluye el título. |
| 7 | Tipo de Instrumento de Capital o título representativo del capital social que se incluye como parte del Capital Neto. En caso de los títulos sujetos a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, establecido en la Resolución 50a, se refiere a las obligaciones subordinadas descritas en el Artículo 64 de la Ley de Instituciones de Crédito. |
| 8 | Monto del Instrumento de Capital o título representativo del capital social, que se reconoce en el Capital Neto conforme al Artículo 2 bis 6 de las presentes disposiciones, en caso de que la referencia 5 sea Fundamental o Básico no Fundamental; y conforme al Artículo 2 bis 7 de las presentes disposiciones en caso de que dicha referencia sea Complementario. En cualquier otro caso, será el monto que corresponda de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a. |
| 9 | Valor nominal del título en pesos mexicanos. |
| 9A | Moneda utilizada para expresar el valor nominal del título en pesos mexicanos conforme al estándar internacional ISO 4217 |
| 10 | Clasificación contable del título que forma parte del Capital Neto. |
| 11 | Fecha de emisión del título que forma parte del Capital Neto. |
| 12 | Especificar si el título tiene vencimiento o es a perpetuidad. |
| 13 | Fecha de vencimiento del título, sin considerar las fechas de pago anticipado. |
| 14 | Especificar si el título incluye una cláusula de pago anticipado por el emisor donde se ejerza el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México. |
| 15 | Fecha en la que el emisor puede, por primera vez, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México. |
| 15A | Especificar si la cláusula de pago anticipado considera eventos regulatorios o fiscales. |
| 15B | Especificar el precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado. |
| 16 | Fechas en la que el emisor puede, posterior a la especificada en la referencia 15, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México. |
| 17 | Especificar el tipo de rendimiento/dividendo que se mantendrá durante todo el plazo del título. |
| 18 | Tasa de interés o índice al que hace referencia el rendimiento/dividendo del título |
| 19 | Especificar si el título incluye cláusulas que prohíban el pago de dividendos a los poseedores de títulos representativos del capital social cuando se incumple con el pago de un cupón o dividendo en algún instrumento de capital. |
| 20 | Discrecionalidad del emisor para el pago de los intereses o dividendos del título. Si la Institución en cualquier momento puede cancelar el pago de los rendimientos o dividendos deberá seleccionarse (Completamente discrecional); si solo puede cancelarlo en algunas situaciones (Parcialmente discrecional) o si la institución de crédito no puede cancelar el pago (Obligatorio). |

| | |
|----|---|
| 21 | Especificar si en el título existen cláusulas que generen incentivos a que el emisor pague anticipadamente, como cláusulas de aumento de intereses conocidas como "Step-Up". |
| 22 | Especificar si los rendimientos o dividendos del título son acumulables o no. |
| 23 | Especificar si el título es convertible o no en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero. |
| 24 | Condiciones bajo las cuales el título es convertible en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero. |
| 25 | Especificar si el título se convierte en su totalidad o solo una parte cuando se satisfacen las condiciones contractuales para convertir. |
| 26 | Monto por acción considerado para convertir el título en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero en la moneda en la que se emitió dicho instrumento. |
| 27 | Especificar si la conversión es obligatoria u opcional. |
| 28 | Tipo de acciones en las que se convierte el título. |
| 29 | Emisor del instrumento en el que se convierte el título. |
| 30 | Especificar si el título tiene una característica de cancelación de principal. |
| 31 | Condiciones bajo las cuales el título disminuye su valor. |
| 32 | Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el título baja de valor en su totalidad o solo una parcialmente. |
| 33 | Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el instrumento baja de valor permanente o de forma temporal. |
| 34 | Explicar el mecanismo de disminución de valor temporal. |
| 35 | Posición más subordinada a la que está subordinado el instrumento de capital que corresponde al tipo de instrumento en liquidación. |
| 36 | Especificar si existen o no características del título que no cumplan con las condiciones establecidas en los anexos 1-Q, 1-R y 1-S de las presentes disposiciones. |
| 37 | Especificar las características del título que no cumplen con las condiciones establecidas en los anexos 1-Q, 1-R y 1-S de las presentes disposiciones. |

GESTIÓN DEL CAPITAL

Las Instituciones, al menos una vez por año, deberán realizar una evaluación interna sobre la suficiencia de su capital con referencia a la exposición de sus riesgos, y a su capacidad para absorber pérdidas, así como para continuar operaciones en el corto y en el largo plazo. Dicha evaluación deberá considerar al menos, lo siguiente:

1. La identificación, medición, vigilancia, control y mitigación de los riesgos a los que está expuesta la Institución.
2. La forma en la que los informes financieros revelan y reflejan los riesgos a los que se refiere el numeral anterior.
3. La identificación, medición, vigilancia, control y mitigación de los riesgos potenciales ante escenarios de estrés que puedan comprometer la suficiencia del capital y la liquidez de la Institución, considerando la estructura del balance y la composición de los activos de la misma en los escenarios de estrés que se consideren.
4. La capacidad para obtener recursos y continuar operando ante un escenario de estrés, en el que se comprometa la suficiencia del capital de la institución sin necesidad de incumplir con los mínimos establecidos en las presentes disposiciones.

Asimismo, deberá incluir la metodología y las conclusiones de la evaluación considerando al menos los aspectos mencionados en el párrafo anterior.

Al 31 de diciembre de 2020, la estructura del capital neto del Banco de \$56,659 tuvo un incremento del 2.6% con relación al año 2019 que era de \$55,233, derivado de la creación de reservas adicionales voluntarias para enfrentar eventuales pérdidas crediticias derivadas de la contingencia por el virus COVID-19 y aumento de las deducciones durante el año.

El Banco realizó durante 2020 su Ejercicio de Evaluación de Suficiencia de Capital, este ejercicio fue cuidadosamente planeado y ejecutado para evaluar la suficiencia de capital y liquidez bajo condiciones de estrés en escenarios internos. El resultado del ejercicio permitió concluir que la liquidez y el capital de la institución permitirían hacer frente a los riesgos derivados de los escenarios de estrés definidos, manteniendo su índice de capital y sus indicadores de liquidez arriba de los mínimos regulatorios.

La Junta de Gobierno de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores ratificó el 27 de marzo de 2020 como Institución de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local a Scotiabank Inverlat, S.A., mediante el comunicado No. 051/2020 su grado de importancia sistémica y el suplemento de conservación de capital adicional, la institución fue calificada como Grado I por lo que deberá constituir un suplemento de capital de 60 puntos base. En base a lo anterior el capital mínimo regulatorio que debe mantener Scotiabank, en condiciones normales es de 11.10% al 31 de diciembre de 2020.

No obstante, en el transcurso de 2020 la Comisión Nacional Bancaria y de Valores emitió una serie de facilidades regulatorias por la pandemia del COVID-19, incluyendo la que permite que los bancos utilicen hasta un 50% del buffer de capital. Facilidad vigente inicialmente hasta marzo 2021, misma que posteriormente fue ampliada para permanecer vigente hasta diciembre 2021, por lo que Scotiabank deberá de mantener un capital mínimo regulatorio de 9.85% hasta entonces.

Ponderadores involucrados en el cálculo del suplemento de capital contra-cíclico de las Instituciones.

Suplemento de capital contracíclico de la Institución

| Jurisdicción | Ponderador | Jurisdicción | Ponderador | Jurisdicción | Ponderador |
|----------------|------------|--------------|------------|----------------------|------------|
| Alemania | - | Francia | - | Reino Unido | - |
| Arabia Saudita | - | Holanda | - | Rusia | - |
| Argentina | - | Hong Kong | - | Singapur | - |
| Australia | - | India | - | Sudáfrica | - |
| Bélgica | - | Indonesia | - | Suecia | - |
| Brasil | - | Italia | - | Suiza | - |
| Canadá | - | Japón | - | Turquía | - |
| China | - | Corea | - | Otras jurisdicciones | - |
| España | - | Luxemburgo | - | diferentes a las | - |
| Estados Unidos | - | México | - | anteriores | - |

Aumentos y/o Disminuciones de Capital

Mediante Asamblea General Extraordinaria de Accionistas de fecha 29 de julio del 2016 Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad de \$870,000,000.00 (Ochocientos setenta millones de pesos 00/100) M.N., suscrito y pagado en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual quedó un capital social suscrito y pagado por la cantidad de \$8,053,500,000.00 (ocho mil cincuenta y tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.

Asimismo, mediante Asamblea General Extraordinaria de Accionistas de fecha 28 de julio del 2017 Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad de \$800,000,000.00 (Ochocientos millones de pesos 00/100, M.N.), suscritos y pagados en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual quedó un capital social suscrito y pagado por una cantidad igual a \$8,853,500,000.00 (ocho mil ochocientos cincuenta y tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.

Mediante Asamblea General Extraordinaria de Accionistas de fecha 29 de junio del 2018 Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad \$150,000,000.00 (Ciento cincuenta millones de pesos 00/100) M.N., suscritos y pagados en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual queda un capital social suscrito y pagado por la cantidad de \$9,003'500,000.00 (Nueve mil tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.

Mediante Asamblea General Extraordinaria de Accionistas de fecha 22 de noviembre del 2018 Scotiabank Inverlat Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad \$150,000,000.00 (Ciento cincuenta millones de pesos 00/100) M.N., suscritos y pagados en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual queda un capital social suscrito y pagado por la cantidad de \$9,153'500,000.00 (Nueve mil ciento cincuenta y tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.

Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos

Cifras en millones de pesos

El proceso de administración integral de riesgos tiene como objetivo el identificar los riesgos, medirlos, hacer seguimiento de su impacto en la operación y controlar sus efectos sobre las utilidades y el valor del capital, mediante la aplicación de las estrategias de mitigación más adecuadas y la integración de la cultura del riesgo en la operación diaria.

De acuerdo con las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito en materia de administración de riesgos emitidas por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV), mismas que son cumplidas por la Institución, el Consejo de Administración asume la responsabilidad sobre los objetivos, lineamientos y políticas de administración de riesgos del Banco, asimismo aprueba por lo menos una vez al año, los objetivos, lineamientos y políticas para la Administración Integral de Riesgos, así como la estructura de límites para los distintos tipos de riesgo.

El Consejo de Administración delega en el Comité de Riesgos y en la Unidad de Administración Integral de Riesgos (UAIR), la instrumentación de las políticas de riesgo y el establecimiento de límites específicos por factor de riesgo, así como la responsabilidad de implementar los procedimientos para la medición, administración y control de riesgos, conforme a las políticas establecidas.

Asimismo, el Comité de Riesgos delega en el Comité de Activos y Pasivos (CAPA) la responsabilidad de monitorear el cumplimiento de las políticas y procedimientos en los riesgos de mercado y liquidez. De igual forma, la UAIR cuenta con políticas en donde se incorporan lineamientos para informar desviaciones a los límites establecidos, debiendo en este caso informar al Comité de Riesgos y, en su caso, al propio Consejo de Administración, sobre dichas desviaciones.

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en la Dirección Corporativa de Riesgos, la cual a su vez está organizada en 8 direcciones encaminadas a monitorear y mitigar los riesgos a los que está expuesto el Banco; lo anterior para garantizar una gestión adecuada de riesgos tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

La UAIR es también responsable de revisar y presentar para aprobación del Comité de Riesgos y/o del Consejo de Administración las diversas metodologías utilizadas para gestionar los riesgos a los que está expuesta la institución, así como el marco de apetito de riesgo, políticas de gestión para los distintos tipos de riesgo, límites globales y específicos de exposición y niveles de tolerancia al riesgo correspondientes. Asimismo, provee a la Alta Dirección información confiable y oportuna para la toma de decisiones, monitoreo y gestión de las líneas de negocio.

Finalmente, la gestión de riesgos está en función de mejores prácticas internacionales pues se cuenta con un marco normativo que cumple con la regulación local y con estándares y lineamientos corporativos establecidos por BNS.

Riesgo de mercado

La administración del riesgo de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en las tasas de interés, tipos de cambio, precios del mercado accionario, índices y otros factores de riesgo en los mercados de dinero, cambios, capitales y productos derivados a los que están expuestas las posiciones de negociación del Banco. Las posiciones de riesgo del Banco incluyen instrumentos de mercado de dinero de tasa fija y flotante, acciones, posiciones cambiarias y derivados tales como futuros de tasas de interés, contratos adelantados, opciones de divisas, swaps de tasas de interés, opciones de tasas de interés y swaps de moneda extranjera. Se tienen límites establecidos y aprobados para cada uno de los portafolios.

Para la administración del riesgo de mercado es extraída la información de los diversos aplicativos y sistemas con los que cuenta la institución, asimismo a través de sistemas especializados se realizan las estimaciones relativas al riesgo de mercado, tales como valor en riesgo, sensibilidades y pruebas de estrés.

La estructura de límites de riesgo de mercado contempla montos volumétricos o nocionales de valor en riesgo (VaR), de sensibilidad, de concentración, límites de estrés y de plazo, entre otros. Para el cálculo del VaR se utiliza la metodología de simulación histórica con 300 días. La política del Grupo Financiero para el cálculo del VaR usa como referencia un 99% de nivel de confianza y un día como período de tiempo.

El VaR global de un día para el Banco al cierre del 31 de diciembre de 2020 fue de \$24.84 y su promedio durante el cuarto trimestre de 2020 fue de \$12.44 mismo que corresponde a un 0.023% del capital neto (\$55,322 a diciembre 2020). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del cuarto trimestre de 2020 se muestran a continuación:

| Nocional (millones de pesos) | Cierre diciembre 2020 | Promedio |
|------------------------------|-----------------------|----------|
| Factor de Riesgo | | |
| Tasas de interés | | |
| Derivados | 680,396 | 687,835 |
| Mercado de Dinero | 57,819 | 37,037 |
| Tipo de cambio | | |
| Derivados | 127,887 | 110,181 |
| Capitales | | |
| Cash | 14 | 16 |
| Derivados | 13,747 | 13,754 |

| VaR 1 día (millones de pesos) | Cierre diciembre 2020 | Promedio |
|-------------------------------|-----------------------|--------------|
| Factor de Riesgo | | |
| Tasas de interés | 29.30 | 13.47 |
| Tipo de cambio | 2.45 | 3.84 |
| Capitales | 0.15 | 1.77 |
| VaR Global | 24.84 | 12.44 |

Las exposiciones de VaR y nocionales se encuentran por debajo de los límites establecidos y aprobados por los órganos colegiados del Banco.

Debido a que la medida del VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, diariamente se realizan pruebas bajo condiciones extremas con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando fluctuaciones anormales en los precios de mercado (cambios en la volatilidad y correlaciones entre factores de riesgo). La prueba bajo condiciones extremas al cierre del cuarto trimestre de 2020 muestra una pérdida máxima de \$355.99. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, México 1994 por el denominado "Error de diciembre" y México 1997 por el efecto de la "crisis del Rublo" y la crisis financiera asiática.

Asimismo, mensualmente se realizan pruebas de “backtesting” para comparar las pérdidas y ganancias teóricas y reales con el valor en riesgo observado y, en consecuencia, en su caso calibrar los modelos utilizados. El nivel de eficiencia del modelo se basa en el enfoque establecido por el BIS. Respecto de las pruebas de backtesting, durante el cuarto trimestre de 2020, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

El Banco administra su exposición al riesgo de liquidez y de tasa de interés conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado, considerando las posiciones para el manejo estructural del balance.

Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se han establecido límites, los cuales son revisados al menos de manera anual y monitoreados de manera periódica¹ a fin de que los mitigantes del riesgo estén actualizados y sean precisos. Entre los límites aplicables se encuentran aquellos relacionados a activos líquidos, brechas de liquidez, sensibilidad del margen y sensibilidad del valor económico, mismos que se encuentran alineados con el apetito de riesgo de la institución. La estructura de límites de riesgo de liquidez y tasas de interés contempla montos nocionales, así como de plazo y concentración; de manera periódica se informa al Comité de Activos y Pasivos, Comité de Riesgos y al Consejo de Administración sobre el desempeño de dichos límites, así como de los indicadores en materia de riesgo de liquidez y tasas de interés.

Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés la información es extraída de los diversos aplicativos y sistemas con los que cuenta la institución, asimismo a través de sistemas especializados se realizan las estimaciones relativas al riesgo de liquidez y tasas de interés.

En adición, es importante señalar que para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se cuenta con métricas prospectivas, las cuales son incorporadas en el ejercicio anual del Plan de Exposiciones, Ejercicios de Suficiencia de Capital Bajo Escenarios propios y regulatorios, así como el Plan de Contingencia (para riesgos de solvencia y liquidez) de la institución; y con pruebas bajo escenarios extremos y pruebas de backtesting. Se destaca que los modelos utilizados para la gestión del riesgo de liquidez y tasas de interés son revisados al menos de manera anual.

El Banco asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que el Banco pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles, para lo cual el Banco aplica controles a las brechas de liquidez, monitorea indicadores clave de liquidez, mantiene fuentes diversificadas de fondeo, establece límites y mantiene un porcentaje mínimo de activos líquidos.

El riesgo de liquidez se monitorea y controla mediante brechas de liquidez acumuladas. Estas brechas se construyen a través de los vencimientos y flujos por pagos de los diferentes instrumentos del balance, tanto activos como pasivos, creando así una brecha diaria que corresponde a la diferencia de las obligaciones de pago y derechos de cobro generados día a día. Las brechas de liquidez incluyen los flujos de vencimiento contractuales del Banco (entradas y salidas de efectivo). Las brechas de liquidez son estimadas bajo lineamientos corporativos que consideran condiciones normales de mercado y son distintas de aquellas brechas calculadas para la estimación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez, en virtud de que éstas últimas incluyen factores de estrés tanto para los flujos de entrada como de salida.

¹ Dependiendo de la naturaleza de los límites estos son monitoreados de manera diaria, semanal o mensual.

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de diciembre 2020 así como el promedio del cuarto trimestre de 2020 se muestran a continuación:

| Scotiabank (millones de pesos) | Posición (Cierre)² | Posición (Promedio) |
|--|--|--------------------------------|
| Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) | (2,123) | 9,679 |
| Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) | 102,358 | 97,363 |

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales, incluyendo posiciones de derivados de cobertura. Adicionalmente, las exposiciones de riesgo de liquidez se encuentran dentro de los límites aprobados. Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez de frente a la contingencia sanitaria por COVID-19, con un CCL promedio durante el tercer trimestre de 2020 de 155%, manteniéndose por arriba del 100%; así como una amplia reserva de activos líquidos.

Adicionalmente, los órganos colegiados del Banco mantienen sesiones periódicas, en las cuales se evalúa y se toman las decisiones relacionadas con la identificación, administración y mitigación del riesgo de liquidez derivado de la crisis.

Por otro lado, el riesgo de tasas de interés deriva de la incertidumbre en las utilidades y/o valor del portafolio como resultado de movimientos en las tasas de interés, y se presenta cuando existen desfases (brechas) en la revisión de activos y pasivos con vencimiento contractual o sujetos a revisión de tasa dentro de un periodo de tiempo determinado, o bien cuando existen distintas tasas de referencia para activos y pasivos. Este riesgo aparece como resultado de las actividades de fondeo, colocación e inversión del Banco y se materializa ante un cambio en las tasas de interés como una variación en el margen financiero.

Para la medición del riesgo de tasas de interés se emplean indicadores tales como sensibilidad del valor económico y sensibilidad de margen. Para el cálculo de dichos indicadores se utilizan brechas de reprecio, construidas con base en las tasas de referencia de activos y pasivos; para el caso de posiciones a tasa fija son modeladas acorde a sus amortizaciones y vencimientos contractuales, mientras que aquellas posiciones referenciadas a una tasa flotante se modelan en función a su próxima fecha de reprecio. La metodología para el cálculo de los indicadores considera supuestos de estabilidad de depósitos de exigibilidad inmediata y de prepago de hipotecas. El primero consiste en un análisis de cosechas a fin de evaluar la permanencia de los depósitos mientras que el segundo considera segmentación por antigüedad del crédito a fin de asignarle una tasa de prepago.

Tanto la sensibilidad del valor económico como de la sensibilidad de margen contemplan un impacto de ± 100 puntos base en las tasas de interés y considera la máxima pérdida esperada por escenario. Esta medición se realiza de manera semanal y se reporta a los miembros del Comité de Activos y Pasivos, al Comité de Riesgos y Consejo de Administración en sus respectivas sesiones.

La sensibilidad del valor económico incorpora el impacto del cambio en tasas de interés sobre el total de los flujos esperados en una ventana de 30 años y proporciona una medida del impacto a largo plazo de estas variaciones, mientras que la ventana de tiempo para estimar la sensibilidad de margen es de 12 meses.

² Cifras previas al cierre de diciembre 2020.
Reporte del Cuarto Trimestre 2020

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de diciembre 2020 y en promedio para el cuarto trimestre de 2020 es la siguiente:

| Scotiabank (millones de pesos) | Posición Cierre | Posición Promedio |
|---|----------------------------------|------------------------------------|
| Valor Económico (+100 pbs) | (979) | (922) |
| Sensibilidad de Margen (+100 pbs) | 651 | 643 |

Los títulos disponibles para la venta y derivados de cobertura, al ser parte integral del manejo de balance para el Banco, son monitoreados bajo las medidas de sensibilidad antes descritas (valor económico y sensibilidad de margen) y por tanto se exceptúan de cálculo de VaR.

| Scotiabank (millones de pesos) | Posición Cierre | Posición Promedio |
|---|----------------------------------|------------------------------------|
| Títulos Disponibles para la venta | 92,436 | 84,886 |
| Derivados de Cobertura | 53,779 | 52,231 |

1/ Incluye operaciones de venta en directo y en reporto.

Baja de Calificación

Como medida conservadora y a manera de estar preparados para un posible aumento de requerimientos de liquidez como resultado de una posible baja en la calificación del Banco (esto asociado a que una baja en la calificación del Banco desencadenaría un aumento del colateral requerido en operaciones de derivados), el grupo de administración de riesgos realiza de manera periódica el impacto que tendría este escenario y las consecuencias en las medidas de liquidez y activos líquidos. El impacto de la baja en la calificación de la institución en 3 niveles para cierre de diciembre 2020 y el promedio del cuarto trimestre del 2020 fueron \$1,486 y \$1,930, respectivamente.

Riesgo de crédito

Pérdida potencial por falta de pago de un acreditado o por el incumplimiento de una contraparte en las operaciones financieras que efectúa el Banco en carteras de crédito, cartera de valores, operaciones con derivados, etc.

La gestión del riesgo de crédito del Banco se basa en diversas estrategias como la centralización de los procesos de crédito, la diversificación de la cartera, análisis de crédito, estrecha vigilancia y un modelo de calificación de riesgo crediticio, esta gestión de riesgo de crédito incorpora instrumentos financieros.

Existen distintos niveles de resolución crediticia instituidos en dos niveles: Consejo de Administración y Facultades Mancomunadas del departamento de Crédito. La distinción entre niveles se da en función del monto de la operación, clasificación de riesgo del acreditado, tipo de acreditado y destino de los recursos.

Para la administración del riesgo de crédito, la información se extrae de los diversos aplicativos y sistemas con los que cuenta la institución, asimismo, es a través de sistemas especializados donde se realizan estimaciones tales como la pérdida esperada, no esperada y la exposición potencial futura para el riesgo crédito de contraparte.

Para el caso de la cartera comercial, las áreas de negocio y crédito evalúan constantemente la situación financiera de cada cliente, realizando cuando menos una vez al año una revisión exhaustiva y un análisis del riesgo de cada acreditado. En estas revisiones se considera el riesgo de crédito global, incluyendo operaciones con instrumentos financieros y derivados. En el caso de riesgos identificados, se realizan revisiones complementarias con mayor frecuencia. Para el caso de cartera hipotecaria y de consumo, se tienen modelos de originación que evalúan la calidad crediticia de los acreditados y se cuenta también con políticas y procedimientos establecidos para gestionar los procesos de autorización de nuevos créditos y dar seguimiento a la calidad crediticia de los distintos portafolios de crédito.

Concentraciones de riesgo crediticio- El Banco ha implementado políticas y procedimientos para mantener un portafolio sano, diversificado y con riesgo prudente y controlado, entre las que destacan el establecimiento de límites de exposición al riesgo crediticio, por unidades de negocio, moneda, plazo, sector, etc. Los límites se autorizan anualmente por el Comité de Riesgos y/o por el Consejo de Administración; su comportamiento es vigilado e informado mensualmente al Comité de Riesgos y en su caso, de manera trimestral al Consejo de Administración.

Metodología para identificar, cuantificar, administrar y controlar el riesgo de crédito- El proceso de establecimiento de límites de exposición a cada tipo de portafolio sujeto a riesgo crédito contempla el análisis de la información e identificación de los riesgos inherentes a cada acreditado, documentado en políticas con base en un proceso de autorización y revisión continua. Todas las exposiciones de crédito incluyendo instrumentos financieros y derivados son monitoreadas por la UAIR; el proceso de monitoreo considera informar al Comité de Riesgos y al Consejo de Administración el consumo de los límites, los excesos observados a los mismos y las estrategias implementadas para el restablecimiento de parámetros. Asimismo, el Consejo delega al Comité de Riesgos la facultad de autorización de límites específicos y actualizaciones a las metodologías utilizadas para la administración de riesgo crédito y contraparte.

Metodología para determinar las estimaciones preventivas para riesgos crediticios El Banco cuenta con un sistema de clasificación de riesgos crediticios aprobado a nivel institucional para cartera Comercial y modelos de score y/o métricas de seguimiento de desempeño para la cartera de Menudeo. También se cuenta con procesos y sistemas que permiten clasificar la cartera por nivel de riesgo y estimar sus reservas conforme a los modelos regulatorios de CNBV.

Se utilizan las siguientes Agencias Calificadoras en el método estándar: S&P, MOODY´S, FITCH, HR RATINGS y VERUM, con base al Anexo 1-B de la CNBV "Mapeo de Calificaciones y Grados de Riesgo".

La calificación de agencias calificadoras es utilizada por el Banco para el cálculo de la Probabilidad de Incumplimiento en:

- Estados y Municipios.
- Admisibilidad de garantes que cuenten con calificación global a largo plazo grado de riesgo 1 y 2.
- Clientes con domicilio en el extranjero y que no cuenten con información de experiencia de pago dentro de las Sociedades de Información Crediticia nacionales, que cuenten con calificación global a largo plazo grado de riesgo 1 y 2.

Las estimaciones para la cartera comercial se basan en la evaluación individual del riesgo crediticio de los deudores y su clasificación, en apego a la CUB (metodología estándar). Se exceptúa de calificar a la cartera garantizada o a cargo del Gobierno Federal, del Banco de México y del Instituto para la Protección al Ahorro Bancario, de acuerdo con las Reglas para la calificación de la Cartera Crediticia de las Instituciones de Banca Múltiple.

Proceso de administración y reconocimiento de la cobertura para el riesgo de crédito. El Banco tiene implementadas políticas para la evaluación de las garantías, mismas que implican la revisión de cada uno de los elementos y riesgos relacionados dependiendo de su tipo, considerando tanto las políticas para garantías, como las correspondientes al análisis y evaluación de crédito. El Banco aplica controles en la evaluación de los garantes / obligados identificando el detalle de la estructura corporativa, así como cualquier aspecto de subordinación significativa que afecte el respaldo otorgado.

La calificación de crédito del garante u obligado se determina de forma continua y consistente durante la vigencia del crédito.

Mecanismos de control de los sistemas de calificación, incluido un análisis de su independencia, responsabilidad y evaluación. El Banco cuenta con diversos aplicativos para el control de los sistemas de calificación y el registro adecuado y completo de las características y requisitos de cada garantía, que se encuentra definido en el catálogo institucional de garantías, así como procesos de solicitud y autorización de crédito.

Los sistemas referidos realizan la clasificación de los portafolios y califican a los créditos bajo la metodología estándar de la CNBV. El cálculo de reservas de los acreditados pertenecientes a las carteras de consumo e hipotecas, además de la cartera de crédito comercial se realiza con base en las metodologías regulatorias publicadas en la CUB, mismas que se basan en el cálculo de la Pérdida Esperada para cada uno de los créditos a partir de parámetros de Probabilidad de Incumplimiento (PI), Severidad de Pérdida (SP) y Exposición al Incumplimiento (EI) empleando información y características específicas de los créditos y/o acreditados evaluados.

Criterios contables especiales por programa de apoyo por virus SARS-CoV2 (COVID-19)

Con el objetivo de mitigar los efectos negativos económicos derivados de la contingencia por el virus SARS-CoV2 (COVID-19), con base al oficio P285/2020 de la CNBV, notificado expresamente a Scotiabank Inverlat mediante oficio número 141-5/2046/2020, el Banco emitió un esquema de apoyo para acreditados cuya fuente de pago fue afectada por esta contingencia. El apoyo consistía en que la cartera crediticia de los clientes afectados por esta pandemia, fuera considerada contablemente como vigente dando cumplimiento con los criterios especiales establecidos por la Comisión Bancaria. Con base al oficio P325/2020 de la CNBV emitido el 23 de junio de 2020, notificó la ampliación por un mes adicional al esquema, es decir, los trámites de la reestructuración o renovación de cada uno de los créditos a adherirse al programa, debían concluirse a más tardar el 31 de Julio de 2020.

Plan de apoyo para créditos de la cartera comercial. El programa de apoyo permitió otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 6 meses. El Banco determinó las condiciones generales del programa en apoyo a sus clientes, lo informó a la CNBV y reportó mes a mes los créditos beneficiados con el mismo. El programa terminó el 31 de Julio de 2020, siendo el máximo diferimiento el 31 de diciembre de 2020, por lo cual al cierre de diciembre 2020 concluyó la aplicación del programa para cartera comercial.

Plan de apoyo para créditos de consumo y pequeñas empresas. El Banco desarrolló un plan de asistencia al cliente, el cual consistió en implementar el aplazamiento de pago hasta un máximo de 6 meses a través del enfoque de aceptación para los clientes que no puedan mantener pagos futuros debido a la pérdida / reducción de ingresos causada por COVID-19:

Condiciones del diferimiento.

- El aplazamiento de pago es hasta un máximo de 6 meses.
- No se marcarán a estos clientes como reestructurados para efectos de reporte a Buró de Crédito.
- No se realizará capitalización de intereses.

Elegibilidad de clientes.

- Cliente en la etapa "Vigentes Contables" con base en los oficios P285/2020 y P325/2020 de la CNBV.
- Cobertura nacional.
- Aplica para todos los productos de Consumo y Pequeñas Empresas.

Constitución de reservas adicionales por emergencia sanitaria virus SARS-CoV2 (COVID-19)

Considerando la emergencia sanitaria por COVID-19 que se está presentando no solo en México sino a nivel mundial y que afecta el entorno económico y financiero, a diciembre 2020, el Banco ha constituido reservas adicionales por \$3,750 para cubrir riesgos incrementales que no se encuentran actualmente previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia.

Los riesgos incrementales antes mencionados tienen como base la afectación del cuadro macroeconómico y financiero del país que a su vez podría impactar la calidad crediticia y la capacidad de pago de los acreditados de los distintos portafolios del Banco, es decir, tanto de las carteras de consumo como de la cartera hipotecaria y cartera comercial.

Por lo tanto, las reservas adicionales fueron constituidas sin asignación directa inicial para algún portafolio, por lo que se trata de reservas genéricas que se aplicarán acorde con las necesidades particulares de cada portafolio.

El proceso desarrollado por el Banco para el cálculo de las reservas adicionales incluye el análisis y el efecto de variables significativos como son: sectores de la economía proyecciones macro económicas y características propias de las carteras.

Información metodológica

La medición y el monitoreo del riesgo de crédito se basa en un modelo de pérdida esperada y pérdida no esperada, cuyo cálculo es realizado en una herramienta especializada interna, robusta y de uso institucional.

- La pérdida esperada representa el monto que el Banco espera perder durante los próximos doce meses por concepto de incumplimientos dadas las características de sus carteras. Es igual al resultado de multiplicar la exposición al incumplimiento (EI), la probabilidad de incumplimiento (PI) y la severidad de la pérdida (SP) de las exposiciones crediticias.
- La pérdida no esperada, es una medida de dispersión alrededor de la pérdida esperada. Representa el capital económico necesario para mantener solvente a la Institución en caso de un evento adverso de gran magnitud que impacte las carteras crediticias.

Adicionalmente, se realizan pruebas bajo condiciones extremas para determinar su impacto sobre la pérdida esperada y no esperada del portafolio.

| Métricas Riesgo de Crédito ¹ (Cifras al 31 de diciembre 2020) | Pérdida Esperada | Pérdida no Esperada |
|--|------------------|---------------------|
| Hipotecas | 0.4% | 3.4% |
| Consumo | 6.0% | 12.9% |
| Cartera Comercial | 1.0% | 5.0% |
| Total | 1.3% | 5.2% |

1/ Excluye cartera vencida. El cálculo incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos inter compañía.

| Parámetros de Riesgo ¹ (Cifras en millones de pesos al 31 de diciembre 2020) | EI ² | PI | SP |
|---|-----------------|-------|--------|
| Hipotecas | 146,202 | 1.95% | 18.94% |
| Consumo | 54,453 | 7.27% | 72.42% |
| Cartera Comercial | 252,481 | 2.5% | 43.7% |

1/ EI calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en incumplimiento.

2/ Incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos inter compañía.

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

El Banco cuenta con políticas y procesos que le permite realizar una valoración de las garantías. En general se puede considerar que no existen restricciones respecto de la aceptación de garantías; no obstante, de forma previa a su aceptación, es necesario valorar los impactos que se tendrán en términos de rentabilidad, y como mitigante en mediciones de riesgo y cálculos regulatorios de reservas preventivas y requerimientos de capital.

La mayor parte de la concentración de garantías con las que cuenta el Banco, para mitigar el riesgo de crédito corresponden a garantías reales no financieras.

La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de diciembre de 2020.

Políticas para asegurar las garantías reales y establecer reservas de crédito

Las garantías que cubren los créditos, dependiendo de su tipo y características pueden mejorar el nivel de riesgo de crédito y, por consecuencia el monto de las reservas requeridas. Para estos efectos se consideran dos tipos de garantías: personales y reales.

Las garantías que se utilicen para mejorar la calificación de crédito, en adición a los requisitos específicos para su tipo (personal o real), de forma general deben cubrir lo siguiente:

- La garantía esté otorgada y constituida en la forma y términos establecidos en las disposiciones legales aplicables y las políticas internas del Banco.
- Cuando un crédito esté cubierto por garantías del tipo real y personal; y están otorgadas simultáneamente por el mismo garante personal, sólo una de ellas puede mejorar la calificación.

En créditos sindicados con otra(s) Institución(es) de Crédito, el Banco podrá pactar los siguientes derechos, en el contrato de crédito correspondiente: El primer lugar en el orden al cobro sobre la garantía; o el mismo grado de prelación en el orden al cobro que los demás participantes, en los casos en que la garantía esté asignada de forma proporcional entre todas las Instituciones que participen en el crédito.

Riesgo de crédito en instrumentos financieros

Constantemente se evalúa la situación financiera de cada cliente, emisor y contraparte y al menos una vez al año se realiza una revisión exhaustiva y análisis del riesgo. Estas revisiones consideran el riesgo de crédito global, incluyendo operaciones con instrumentos financieros, derivados y cambios.

Al cierre de diciembre 2020 y en promedio durante el cuarto trimestre de 2020, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.03% y 0.03% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.73% y 0.79% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

Adicionalmente a las medidas de riesgo mencionadas anteriormente y para operaciones con derivados, el Banco cuantifica sus exposiciones de crédito con la finalidad de controlar el uso de líneas otorgadas a sus contrapartes para la operación de instrumentos derivados. Este control es llevado a cabo mediante el cálculo de la exposición potencial futura (PFE) a nivel contraparte a través de herramientas especializadas, incorporando elementos mitigantes de riesgo tales como acuerdos de compensación, contratos de garantías y colaterales. Se cuenta con políticas de riesgo de contraparte y de monitoreo de límites establecidas que contemplan el proceso a seguir en caso de presentarse excesos en los mismos.

Metodología para establecimiento de límites de crédito para contrapartes y asignación de capital

El Banco, mediante el establecimiento de políticas de operación, define la asignación de capital con base en criterios de negocio y apetito de riesgo, es decir, a través de los Comités de Crédito se definen los criterios de elegibilidad de clientes y el establecimiento de límites máximos de exposición considerando como principal parámetro de riesgo la exposición potencial futura de cada contraparte, estimada de acuerdo a la metodología aprobada por el Comité de Riesgos.

Destacar que previo a cualquier operación que implique riesgo de crédito, se tiene un proceso de revisión de los acreditados/contrapartes para evaluar su perfil de riesgo y definir el límite de exposición aceptado con cada uno.

Una vez aprobados los límites, son monitoreados por la UAIR y revisados de manera anual por el área de Crédito o con mayor frecuencia en caso de que se detecte algún riesgo potencial o bien la línea de negocio así lo solicite.

El requerimiento de capital para operaciones con derivados se calcula bajo metodología regulatoria, tal es el caso del valor ajustado por valuación crediticia o CVA por sus siglas en inglés.

Asimismo, se cuenta con lineamientos de BNS para identificar el riesgo de correlación adversa durante el proceso de autorización de crédito para operaciones con contrapartes.

Riesgo Operacional

El riesgo operacional es un riesgo no discrecional que se define como la pérdida potencial por fallas o deficiencias en los controles internos, por errores en el procesamiento y almacenamiento de las operaciones o en la transmisión de información, así como por resoluciones administrativas y judiciales adversas, fraudes o robos, eventos externos, y comprende, entre otros, al riesgo tecnológico y al riesgo legal.

Metodología General

El Banco ha implementado políticas y procedimientos que le permiten tener un adecuado proceso de gestión del riesgo operacional, mismos que a continuación se detallan.

Políticas para la gestión de Riesgo Operacional

Tienen como propósito establecer los principios y el marco de gestión, para identificar, medir, monitorear, limitar, controlar, divulgar y gestionar los riesgos operacionales inherentes a sus actividades diarias, además de promover una cultura de administración de riesgos en todo el Banco.

Evaluación de Riesgo Operacional

El Banco cuenta con una metodología estructurada de evaluación de riesgo operacional, que le permite identificar, evaluar y mitigar, los riesgos inherentes a sus procesos y su actividad de negocios misma que se aplica a toda su estructura, la evaluación se basa en la identificación del riesgo operacional inherente, la evaluación de la eficacia de los controles de dichos riesgos, con lo que se determina un nivel de riesgo residual en función del cual se establecen acciones de mitigación sobre los riesgos identificados.

Manual para la recolección y clasificación de datos de Riesgo Operacional

Define los requerimientos para reportar la información que soporta los procesos de medición, así como el alcance del proceso de recolección de información, las funciones y responsabilidades de las unidades de negocio para recolectar y reportar los datos de pérdida, y los requerimientos específicos de esta.

Niveles de tolerancia de Riesgo Operacional

Es una herramienta de gestión de pérdidas operacionales, que permite a cada área del Banco conocer los niveles de tolerancia de pérdidas aplicables a cada evento de pérdida asumido, así como incentivar mejoras en el proceso de gestión del riesgo operacional y que se adopten las acciones necesarias para minimizar el riesgo de futuras pérdidas.

Indicadores clave de riesgo (KRI)

Este proceso permite al Banco establecer indicadores a partir de variables extraídas de los procesos, cuyo comportamiento está relacionado con el nivel de riesgo asumido. Mediante el seguimiento de cada indicador se identifican tendencias que permiten gestionar en el tiempo los valores del indicador; se establecen umbrales admisibles para cada uno de los indicadores seleccionados.

Riesgo Legal

El riesgo legal se define como la pérdida potencial por el incumplimiento de las disposiciones legales y administrativas aplicables, la emisión de resoluciones administrativas y judiciales desfavorables y la aplicación de sanciones, en relación con las Operaciones que la Institución lleva a cabo.

Además de estar sujeto a la metodología general de riesgos operacionales, el Banco cuenta con una metodología de estimación de pérdidas esperadas y no esperadas de riesgo legal, a través de la cual se estiman las probables pérdidas como consecuencia de un resultado adverso de sus juicios en proceso. Dicha metodología está basada en la experiencia de pérdidas de ejercicios anteriores, con las que, mediante un análisis estadístico de severidad y ocurrencia, se determina la probabilidad de pérdida de los asuntos legales en curso.

Cálculo del requerimiento capital

La Institución calcula su requerimiento de capital por riesgo operacional a través del Método Estándar Alternativo, mismo que fue autorizado por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, para lo cual el Banco tuvo que demostrar ante esta H. Comisión; que cuenta con una gestión robusta que le permite reducir su requerimiento de capital por debajo de lo requerido conforme al cálculo del Indicador Básico.

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de octubre-diciembre de 2020, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$170.1 MM, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de diciembre 2020 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$192.1 MM, \$90.6 MM corresponden a riesgo operacional y \$101.5 MM a riesgo legal, el 100% de la exposición cuenta con provisiones.

Riesgo Tecnológico

El riesgo tecnológico se define como la pérdida potencial por daños, interrupción, alteración o fallas derivadas del uso del hardware, software, sistemas aplicaciones, redes y cualquier otro canal de transmisión de información en la prestación de servicios a los clientes del Banco.

Para gestionar el riesgo tecnológico, el Banco cuenta con la Política de Gestión del Riesgo Tecnológico y de Ciberseguridad que describe las políticas y los principios generales para gestionar y vigilar los riesgos asociados con las Tecnologías de la Información y la Ciberseguridad.

Las auditorías habituales realizadas por un departamento independiente y experimentado de Auditoría Interna de Tecnologías de la Información, incluyen revisiones totales del diseño, implementación y explotación de los sistemas de control interno en todas las áreas de negocio y apoyo, nuevos productos y sistemas y la confiabilidad e integridad de las operaciones de procesamiento de datos.

En la sección Estados Financieros Relación con Inversionistas del portal oficial de Scotiabank, se presenta información adicional con la finalidad de dar cumplimiento a la totalidad de requerimientos establecidos en el artículo 88 de la CUB sobre la revelación de información relativa a los distintos tipos de riesgo gestionados por la Institución.

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)

Periodo Reportado: septiembre 2020 - diciembre 2020

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez³

| (Cifras en millones de pesos) | Importe sin ponderar (promedio) | Importe ponderado (promedio) |
|--|------------------------------------|---------------------------------|
| ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES | | |
| 1 Total de Activos Líquidos Computables | No aplica | 97,063.95 |
| SALIDAS DE EFECTIVO | | |
| 2 Financiamiento minorista no garantizado | 139,676.28 | 10,504.15 |
| 3 Financiamiento estable | 69,269.44 | 3,463.47 |
| 4 Financiamiento menos estable | 70,406.84 | 7,040.68 |
| 5 Financiamiento mayorista no garantizado | 186,882.99 | 68,977.81 |
| 6 Depósitos operacionales | 73,830.07 | 17,198.36 |
| 7 Depósitos no operacionales | 108,553.86 | 47,280.39 |
| 8 Deuda no garantizada | 4,499.06 | 4,499.06 |
| 9 Financiamiento mayorista garantizado | No aplica | 471.86 |
| 10 Requerimientos adicionales: | 287,436.19 | 23,594.73 |
| 11 Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías | 11,360.39 | 4,352.68 |
| 12 Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda | - | - |
| 13 Líneas de crédito y liquidez | 276,075.80 | 19,242.05 |
| 14 Otras obligaciones de financiamiento contractuales | 33.43 | 33.43 |
| 15 Otras obligaciones de financiamiento contingentes | - | - |
| 16 TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO | No aplica | 103,581.98 |
| ENTRADAS DE EFECTIVO | | |
| 17 Entradas de efectivo por operaciones garantizadas | 25,033.82 | 1,119.49 |
| 18 Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas | 39,571.54 | 25,525.83 |
| 19 Otras entradas de efectivo | 14,095.77 | 14,095.77 |
| 20 TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO | 78,701.12 | 40,741.08 |
| | | Importe ajustado |
| 21 TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES | No aplica | 97,063.95 |
| 22 TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO | No aplica | 62,851.14 |
| 23 COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ | No aplica | 155.11⁴ |

(a) *Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando.*
92 días naturales

(b) *Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL) y la evolución de sus principales componentes.*

³ Anexo 5 de las disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple.

⁴ Cifras previas sujetas a confrontas de Banco de México.

- **Durante diciembre 2020, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):⁵**

- o Principales Salidas de Efectivo:
Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$38,912 y depósitos a plazo tradicionales por \$38,180, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por \$912 y \$1,286 respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$19,441.
- o Principales Entradas de Efectivo:
Entradas por flujo de carteras de \$10,401 y por operaciones de call money de \$7,879 y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$12,969.
- o Activos Líquidos:
Activos Líquidos totales de \$102,362 en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$78,027 en títulos de deuda de nivel 1, \$15,117 en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por \$6,208 y \$3,009 en títulos de nivel 2A.

(c) *Los cambios de los principales componentes dentro del trimestre que se reporte;*

Cierre de septiembre 2020: 150% – cierre de diciembre 2020: 139% (decremento: -11%) El coeficiente de cobertura de liquidez disminuyó 11% respecto de septiembre 2020, esto debido principalmente a:

- o El fondeo total del banco se mantuvo en el mismo nivel, sin embargo, las salidas ponderadas incrementaron en \$6,401, debido al aumento de recursos de clientes mayoristas y disminución de minoristas.
- o En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$7,649 y se presenta un decremento en entradas a 30 días por \$5,302, respecto al trimestre anterior.
- o Finalmente, los activos líquidos tuvieron un incremento de \$8,965.

(d) *La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables⁶;*

| Evolución de Activos Líquidos T4-2020 | | | |
|--|-------------|-------------|-------------|
| | Octubre | Noviembre | Diciembre |
| Efectivo | 5% | 6% | 6% |
| Reservas en el Banco Central | 21% | 16% | 15% |
| Nivel 1 | 70% | 74% | 76% |
| Nivel 2 ^a | 4% | 4% | 3% |
| Nivel 2B | 0% | 0% | 0% |
| Total de Activos Líquidos Ponderados | 100% | 100% | 100% |

⁵ Salidas y entradas ponderadas para los próximos 30 días considerando los factores definidos en las Disposiciones de Carácter General sobre los requerimientos de Liquidez para las Instituciones de Banca Múltiple.

⁶ Activos líquidos computables bajo los lineamientos establecidos por Banco de México.

(e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

| Concentración de fuentes de Financiamiento | Octubre | Noviembre | Diciembre |
|--|-------------|-------------|-------------|
| CAPTACION TRADICIONAL | | | |
| Depósitos de exigibilidad inmediata | 42% | 43% | 43% |
| Depósitos a plazo | | | |
| Del público en general | 32% | 32% | 33% |
| Mercado de dinero | 5% | 4% | 3% |
| Títulos de crédito emitidos | 7% | 7% | 7% |
| Cuenta global de captación sin movimientos | 0% | 0% | 0% |
| PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS | | | |
| De exigibilidad inmediata | | | |
| De corto plazo | 6% | 6% | 7% |
| De largo plazo | 8% | 8% | 7% |
| Total | 100% | 100% | 100% |

(f) Las exposiciones en instrumentos financieros derivados y posibles llamadas de margen;

El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo a las políticas establecidas.

Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:

- o Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo-rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.
- o Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.
- o Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
- o Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados como de negociación, cobertura o arbitraje.

El Banco cuenta con políticas y manuales, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y a la administración de derivados. Entre los procedimientos aplicables para el monitoreo y mitigación de los riesgos asociados a los derivados se calcula la exposición potencial futura, se monitorean el colateral asociado, posibles llamadas de margen y como medida conservadora y a manera de estar preparados para un posible aumento de requerimientos de liquidez como resultado de una posible baja en calificación del Banco se calcula periódicamente el impacto potencial en aumento en colaterales.

| (Cifras en millones de pesos) | |
|--|-------|
| Exposición Potencial Futura (Diciembre 2020) | |
| Con contrato de compensación | 2,470 |
| Sin contrato de compensación | 9,261 |
| Posibles llamadas de margen (Diciembre 2020) | |
| Colateral en Tránsito | 39 |
| Downgrade (Diciembre 2020) | |
| Baja calificación 3 niveles | 1,286 |

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de diciembre 2020 es la siguiente:

| Scotiabank Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos) | Posición Cierre |
|--|-----------------|
| Factor de Riesgo | |
| Tasas de interés | 728,464 |
| Tipo de cambio | 69,575 |
| Capitales | 12,822 |
| Total | 810,861 |

(g) *El descalce en divisas;*

La política general es fondear los activos con la misma moneda en que se otorguen.

(h) *Una descripción del grado de centralización de la administración de la liquidez y la interacción entre las unidades del grupo;*

Dentro del grupo existe una unidad encargada de la gestión de la liquidez, Tesorería Grupo, en cuya responsabilidad está cubrir los excedentes y faltantes de la liquidez de la institución, para lo cual recibe información de forma diaria acerca de los flujos contractuales que tendrán lugar en un día corriente de mercado, así como las expectativas de liquidez de corto y mediano plazo esperadas para los principales productos.

Las diferentes áreas del banco generadoras de negocios tienen que informar con anticipación al menos 24-48 horas en los diferentes comités (pipeline) o directamente a la Tesorería de Grupo su estrategia de corto, mediano y largo plazo, a fin de que la misma programe su estructura de fondeo para hacer frente a dichos compromisos.

(i) *Los flujos de efectivo de salida y de entrada que, en su caso, no se capturen en el presente marco, pero que la Institución considera relevantes para su perfil de liquidez.*

Es relevante mencionar que para el cálculo del coeficiente de cobertura de liquidez se registran los flujos de efectivo de salida y de entrada a nivel contractual; no obstante la institución de manera diaria calcula las brechas de liquidez considerando no solo los flujos de efectivo de salida y entrada a nivel contractual sino que también considera flujos estimados, en adición extiende la programación de flujos a un periodo de más allá de 30 días, por lo que la institución tiene la posibilidad de anticipar y tomar medidas a fin de hacer frente a los compromisos posteriores a este periodo.

Asimismo, las Instituciones deberán como mínimo revelar la información que corresponda al trimestre inmediato anterior que al que se revele, conforme a lo siguiente:

I. Información cuantitativa:

(a) *Los límites de concentración respecto de los distintos grupos de garantías recibidas y las fuentes principales de financiamiento;*

Dentro de las políticas aprobadas por la institución en términos de liquidez, se encuentra establecido que la institución tendrá una baja dependencia del mercado mayorista, así como, mantener diversificadas las fuentes de fondeo y una baja concentración de recursos en depositantes específicos. Esta diversificación, no solo se realiza por fuentes de fondeo, sino por plazos y variedad de productos.

En adición, también se establece la calidad crediticia mínima de las garantías recibidas. Estas garantías no podrán ser inferiores a una calificación de crédito nivel A.

Adicionalmente, la institución establece límites de concentración de depósitos con la finalidad de asegurar la diversificación de sus fuentes de fondeo entre sus monedas relevantes.

| Concentración de Depósitos | |
|----------------------------------|-----------|
| Concepto | Límite MM |
| Concentración de Depósitos (MXN) | 4,500 MXN |
| Concentración de Depósitos (USD) | 100 USD |

Por otro lado, la institución monitorea el potencial future exposure (PFE) a nivel contraparte para la operación de instrumentos financieros derivados y por otro lado cuenta con límites de crédito para monitorear la exposición al riesgo de crédito de contraparte.

La exposición al riesgo liquidez y las necesidades de financiamiento son monitoreadas teniendo en cuenta posibles limitaciones legales, regulatorias y operacionales; para esto el Banco asume una política prudente de riesgos de manejo de liquidez; adicionalmente se han establecido límites internos de brechas de liquidez y activos líquidos. Los descalces de liquidez se muestran en el siguiente inciso.

Las exposiciones al riesgo de liquidez son cubiertos desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.

Actualmente el cálculo del CCL incorpora posiciones de la entidad legal banco y sus subsidiarias.

(b) Las operaciones del balance desglosadas por plazos de vencimiento y las brechas de liquidez resultantes, incluyendo las operaciones registradas en cuentas de orden.

Para tener un control sobre el descalce generado por la naturaleza del balance entre activos y pasivos, Scotiabank establece límites para sus brechas de liquidez en diferentes plazos. Asimismo, el banco monitorea las brechas diarias durante los próximos 360 días, con la finalidad de tener un panorama más amplio de las obligaciones que la institución tiene a más de 30 días; las brechas incorporan posiciones activas y pasivas del balance, así como posiciones fuera del mismo. Los resultados al cierre de diciembre 2020 y el promedio del cuarto trimestre de 2020 son:

| Scotiabank (millones de pesos) | Posición (Cierre) ⁷ | Posición (Promedio) |
|--|-----------------------------------|------------------------|
| Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) | (2,123) | 9,679 |
| Liquidity Buffer (métrica CCL) | 102,358 | 97,363 |

Asimismo, el banco monitorea brechas diarias durante los próximos 360 días, con la finalidad de tener un panorama más amplio de las obligaciones que la institución tiene a más de 30 días.

⁷ Cifras previas al cierre de diciembre 2020.
Reporte del Cuarto Trimestre 2020

II. Información cualitativa

(a) *La manera en la que se gestiona el riesgo de liquidez en la Institución, considerando para tal efecto la tolerancia a dicho riesgo; la estructura y responsabilidades para la administración del riesgo de liquidez; los informes de liquidez internos; la estrategia de riesgo de liquidez y las políticas y prácticas a través de las líneas de negocio y con el consejo de administración;*

Uno de los principales objetivos de Scotiabank es la generación de valor para sus accionistas manteniendo la estabilidad y solvencia de la organización.

Los principios del proceso de Administración de Riesgo de Liquidez son:

- Asegurar un gobierno y supervisión del Riesgo de liquidez, incluyendo lineamientos claros de roles y responsabilidades para asegurar que el monitoreo, valuación, contabilización, medición de riesgo, y procesos de gestión de riesgo, sean conducidos y reportados independientemente.
- Identificar, medir y administrar la relación riesgo/rendimiento, dentro de los límites de tolerancia y apetito al riesgo establecidos por el Consejo de Administración, asegurando que estas actividades se realicen de manera prudente.

Dentro del Grupo Financiero existe una unidad encargada de la gestión de la liquidez, el área Tesorería Grupo, cuya responsabilidad es cubrir los excedentes y faltantes de liquidez de la institución, para lo cual recibe información de forma diaria acerca de los flujos contractuales que tendrán lugar en un día corriente de mercado, así como las expectativas de liquidez de corto y mediano plazo esperadas para los principales productos. Por otro lado el área de Administración del Riesgo de Liquidez tiene la responsabilidad de velar por que los principales indicadores de liquidez se encuentren bajo los límites aprobados y a su vez se encuentren alineados con el apetito de riesgo de la institución, para tales efectos el área de Administración del Riesgo de Liquidez produce información periódica relativa activos líquidos y brechas de liquidez; en caso de que hubiese alguna desviación, debe notificar a Tesorería Grupo y área involucradas con la finalidad de corregir cualquier desviación que pudiera impactar a la liquidez estructural de la institución.

En secciones posteriores se enuncian los informes internos de liquidez, así como las políticas puestas en marcha que tienen como finalidad la Administración Integral del Riesgo de Liquidez.

(b) *La estrategia de financiamiento, incluyendo las políticas de diversificación, y si la estrategia de financiamiento es centralizada o descentralizada;*

La estrategia de fondeo es determinada por Tesorería Grupo de la institución, pero consensada y autorizada por el Comité de Activos y Pasivos. Donde participan diversas áreas del banco incluyendo áreas de negocio.

(c) *Las técnicas de mitigación del riesgo de liquidez utilizadas por la Institución;*

La institución monitorea el riesgo de liquidez a través de distintas métricas e informes alineados con el apetito del riesgo las cuales contemplan:

- Cálculo de CCL (Coeficiente de Cobertura de Liquidez)
- Cálculo de CFEN (Coeficiente de Financiamiento Estable Neto)
- Cómputo de Activos Líquidos
- Cálculo de LDR (Loan to Deposit Ratio)
- Monitoreo de la concentración de fondeo profesional
- Monitoreo de Brechas de Liquidez
- Monitoreo de Concentración de Depósitos
- Monitoreo de Depósitos con Bancos
- Monitoreo del Portafolio de Inversión
- Monitoreo de créditos cedidos como garantía de fondeo
- Pruebas de Estrés de Liquidez
- Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez

- Reportes periódicos al Comité de Activos y Pasivos de la Institución
- Reportes periódicos al Comité de Riesgos
- Reportes al Consejo de Administración
- Políticas y Manuales alusivos a la Administración del Riesgo de Liquidez
- Plan de Contingencia para Riesgos de Solvencia y Liquidez

A efectos de mitigar el riesgo de liquidez, el Banco ha establecido lineamientos, políticas y procedimientos prudentes, poniendo particular atención en:

- Medición, supervisión y pronóstico de compromisos que involucren flujos de efectivo para las principales monedas manejadas por el Banco (MXP+UDIs y USD).
- Procurar una distribución uniforme de los flujos de efectivo, minimizando las brechas de liquidez entre activos y pasivos, considerando el impacto potencial de renovaciones, prepagos, retiros de depósitos, otorgamiento de crédito y el incumplimiento en pago de créditos.
- Mantener fuentes diversificadas de fondeo.
- Establecer programas de corresponsalías y préstamos interbancarios para ayudar a mantener el acceso a mercado.
- Instrumentar y mantener disponibles programas para la emisión de pasivos, y descuento de cartera con fondos especializados.
- Mantener la capacidad operativa en los sistemas de liquidación establecidos por Banco de México, considerando para esto los requerimientos de garantía y límites establecidos para tal efecto.
- Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.

El Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez incorpora las acciones correctivas que la institución tendría que poner en marcha en caso de contingencia.

(d) Una explicación de cómo se utilizan las pruebas de estrés; y

De acuerdo a la norma vigente estipulada en el anexo 12-B de la Circular Única para Bancos, que requiere la realización de ejercicios de liquidez en escenarios de estrés, el banco realiza pruebas de forma periódica esto con la finalidad de cerciorarse de su capacidad para afrontar escenarios adversos y ser capaz de honrar sus obligaciones de corto plazo basados en un horizonte de supervivencia de 30 días.

Estos escenarios de estrés contemplan entre otros, los siguientes supuestos:

- Aumento en la pérdida esperada de las carteras de crédito
- Aumento en retiro de los depósitos
- Disposición de líneas de crédito
- Aumento en las obligaciones del Banco por degradación de la calificación de la institución.
- Salida de los principales depositantes del Banco
- Pérdida de Valor de Mercado de los Activos Líquidos de la Institución

Las pruebas de estrés de liquidez de la institución contemplan distintos escenarios (i.e. idiosincrático, sistémico y combinado) con 3 niveles de severidad cada uno. Los resultados de las pruebas de estrés son presentados de manera periódica a los órganos colegiados de la institución.

Los escenarios de estrés indican una visión sobre las brechas de liquidez, los activos líquidos y el horizonte de supervivencia de la institución, esta información es fundamental para la toma de decisiones con el fin de mantener una posición sólida en torno a activos líquidos, así como sus obligaciones a corto plazo en escenarios adversos. Es relevante apuntar que la institución cuenta con el Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez el cual incorpora las acciones correctivas que la institución tendría que poner en marcha en caso de contingencia.

(e) Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

Periódicamente, el Grupo Financiero Scotiabank Inverlat revisa todos los aspectos de liquidez para la administración de los riesgos potenciales. El Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez es un componente integral de dicha revisión y proporciona un marco de referencia para determinar las acciones a realizar en evento de crisis y poder reestablecer la situación financiera del Grupo.

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

- o Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
- o Apegarse a los sistemas de alertas tempranas, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.
- o Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.
- o Plantear acciones que aseguren que el riesgo de liquidez global del Grupo este dentro de los límites de tolerancia aprobados por el Consejo de Administración.
- o Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.
- o Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital de manera oportuna.

En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de éstas: (i) operaciones de crédito simple garantizado con depósitos de regulación monetaria o depósitos en Dólares que el Grupo Financiero mantenga en el Banco de México, o (ii) reportos sobre títulos elegibles. Dicho financiamiento está sujeto al procedimiento que señala la circular 10/2015 de Banxico.

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el cuarto trimestre de 2020, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del cuarto trimestre 2020, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 10

Posiciones en Acciones

Al cierre de diciembre de 2020 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$22.30 millones de pesos, con una minusvalía de \$0.22 millones de pesos.

| Institución | Tipo de Cotización | Emisora | Títulos | Importe Valuado | Costo | Plusvalía/ Minusvalía |
|--------------|--------------------|---------------|------------------|-----------------|--------------|-----------------------|
| Scotiabank | Pública | 1-KIMBER-A | 70,000 | 2.38 | 2.27 | 0.11 |
| Scotiabank | Pública | 1-LIVEPOL-C-1 | 31,000 | 2.17 | 2.15 | 0.02 |
| Scotiabank | Pública | 1I-SHV-* | 1,900 | 4.18 | 4.19 | (0.01) |
| Scotiabank | Pública | 1-CHDRAUI-B | 98,000 | 2.82 | 2.76 | 0.06 |
| Scotiabank | Pública | 1-AC-* | 40,000 | 3.83 | 3.86 | (0.03) |
| Scotiabank | Pública | 1-NEMAK-A | 570,000 | 3.30 | 3.25 | 0.05 |
| Scotiabank | Pública | 1-AMX-L | 250,000 | 3.62 | 3.60 | 0.02 |
| Total | | | 1,060,900 | 22.30 | 22.08 | 0.22 |

Al cierre del cuarto trimestre del año 2020, se reflejó una pérdida acumulada proveniente de las ventas por \$2.20 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

| Institución | Tipo de Cotización | Emisora | Títulos | Utilidad | Pérdida | Utilidad/ Pérdida |
|-------------|--------------------|----------------|-----------|----------|---------|----------------------|
| Scotiabank | Pública | 1-LIVEPOL-C-1 | 1 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1AGGBN | 80,361 | 0.18 | 0.00 | 0.18 |
| Scotiabank | Pública | 1APBRN | 44,703 | 0.43 | (0.02) | 0.41 |
| Scotiabank | Pública | 1VALEN | 5,500 | 0.00 | (0.02) | (0.02) |
| Scotiabank | Pública | 1BNAFTRACISHRS | 60,000 | 0.01 | (0.01) | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1CPSOTRAC15 | 568,910 | 0.03 | (0.01) | 0.02 |
| Scotiabank | Pública | 1IBRZU* | 36,767 | 0.36 | (0.63) | (0.27) |
| Scotiabank | Pública | 1IEWZ* | 10,600 | 0.41 | 0.00 | 0.41 |
| Scotiabank | Pública | 1IFLOAN | 5,184 | 0.04 | 0.00 | 0.04 |
| Scotiabank | Pública | 1IIB01N | 63,047 | 0.01 | (0.08) | (0.07) |
| Scotiabank | Pública | 1IPSQ* | 20,601 | 0.13 | (0.03) | 0.10 |
| Scotiabank | Pública | 1ISHV* | 8,098 | 0.07 | (0.20) | (0.13) |
| Scotiabank | Pública | 1IUSO* | 84,722 | 0.32 | (1.50) | (1.18) |
| Scotiabank | Pública | 1-AC-* | 62,010 | 0.10 | (0.01) | 0.09 |
| Scotiabank | Pública | 1-ALFA-A | 406,987 | 0.32 | (0.01) | 0.31 |
| Scotiabank | Pública | 1-AMX-L | 2,193,349 | 0.59 | (0.25) | 0.34 |
| Scotiabank | Pública | 1-ARA-* | 59,318 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1-BSMX-B | 856,848 | 0.76 | (0.04) | 0.72 |
| Scotiabank | Pública | 1-CEMEX-CPO | 931,271 | 0.20 | (0.08) | 0.12 |
| Scotiabank | Pública | 1-CHDRAUI-B | 7,914 | 0.01 | 0.00 | 0.01 |
| Scotiabank | Pública | 1-ELEMENT-* | 200 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1-FEMSA-UBD | 267,416 | 0.37 | (0.38) | (0.01) |
| Scotiabank | Pública | 1-GCARSO-A1 | 360,357 | 0.38 | (0.11) | 0.27 |
| Scotiabank | Pública | 1-GFINBUR-O | 339,278 | 0.09 | (0.02) | 0.07 |
| Scotiabank | Pública | 1-GMEXICO-B | 14,899 | 0.01 | (0.04) | (0.03) |
| Scotiabank | Pública | 1-ICH-B | 7,525 | 0.02 | 0.00 | 0.02 |
| Scotiabank | Pública | 1-KIMBER-A | 161,364 | 0.13 | (0.03) | 0.10 |
| Scotiabank | Pública | 1-KOF-UBL | 168,425 | 0.15 | (0.02) | 0.13 |
| Scotiabank | Pública | 1-LALA-B | 341,455 | 0.18 | (0.01) | 0.17 |
| Scotiabank | Pública | 1-LIVEPOL-C-1 | 278,388 | 0.48 | (0.10) | 0.38 |
| Scotiabank | Pública | 1-NEMAK-A | 280,619 | 0.01 | (0.01) | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1-R-A | 17,485 | 0.03 | 0.00 | 0.03 |
| Scotiabank | Pública | 1-SIMEC-B | 4 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1-WALMEX-* | 76,300 | 0.13 | 0.00 | 0.13 |
| Scotiabank | Pública | 1AC* | 9,500 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1ALFAA | 159,994 | 0.05 | (0.03) | 0.02 |
| Scotiabank | Pública | 1AMXL | 855,000 | 0.27 | (0.15) | 0.12 |
| Scotiabank | Pública | 1BSMXB | 881,906 | 0.46 | (0.29) | 0.17 |
| Scotiabank | Pública | 1CEMEXCPO | 770,000 | 0.16 | 0.00 | 0.16 |
| Scotiabank | Pública | 1GFINBURO | 52,976 | 0.01 | 0.00 | 0.01 |
| Scotiabank | Pública | 1GFNORTEO | 245,000 | 0.25 | (0.09) | 0.16 |
| Scotiabank | Pública | 1KOFUBL | 27,028 | 0.10 | 0.00 | 0.10 |
| Scotiabank | Pública | 1LIVEPOLC1 | 67,785 | 0.16 | (0.05) | 0.11 |
| Scotiabank | Pública | 1NEMAKA | 494,525 | 0.30 | (0.42) | (0.12) |
| Scotiabank | Pública | 1TLEVISACPO | 75,216 | 0.08 | 0.00 | 0.08 |
| Scotiabank | Pública | 1A-BABA-N | 500 | 0.03 | (0.02) | 0.01 |
| Scotiabank | Pública | 1A-BXP-* | 300 | 0.03 | 0.00 | 0.03 |
| Scotiabank | Pública | 1A-CHL-N | 2,901 | 0.01 | (0.01) | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1A-INTC-* | 1,020 | 0.02 | 0.00 | 0.02 |
| Scotiabank | Pública | 1A-PBR-N | 58,889 | 0.50 | (0.24) | 0.26 |
| Scotiabank | Pública | 1A-WBA-* | 4,695 | 0.03 | (0.22) | (0.19) |
| Scotiabank | Pública | 1ACHLN | 10,001 | 0.52 | 0.00 | 0.52 |
| Scotiabank | Pública | 1AIBM* | 3,744 | 0.28 | (0.04) | 0.24 |
| Scotiabank | Pública | 1ALFAA | 1,048,239 | 0.17 | (0.52) | (0.35) |
| Scotiabank | Pública | 1AMXL | 420,486 | 0.02 | (0.04) | (0.02) |
| Scotiabank | Pública | 1APBRN | 20,419 | 0.08 | (0.10) | (0.02) |

| | | | | | | |
|--------------|---------|------------------|-------------------|--------------|----------------|---------------|
| Scotiabank | Pública | 1ATX* | 14,500 | 0.06 | (0.05) | 0.01 |
| Scotiabank | Pública | 1AVALEN | 38,998 | 0.22 | (0.54) | (0.32) |
| Scotiabank | Pública | 1AWBA* | 2,500 | 0.02 | (0.01) | 0.01 |
| Scotiabank | Pública | 1B-NAFTRAC-ISHRS | 561,090 | 0.39 | (0.01) | 0.38 |
| Scotiabank | Pública | 1BNAFTRACISHRS | 1,008,802 | 0.26 | (1.58) | (1.32) |
| Scotiabank | Pública | 1CEMEXCPO | 1,538,699 | 0.17 | (0.28) | (0.11) |
| Scotiabank | Pública | 1FEMSAUBD | 35,000 | 0.04 | 0.00 | 0.04 |
| Scotiabank | Pública | 1GFNORTEO | 15,000 | 0.01 | 0.00 | 0.01 |
| Scotiabank | Pública | 1I-BRZU-* | 3,299 | 0.16 | (0.01) | 0.15 |
| Scotiabank | Pública | 1I-EWZ-* | 3,300 | 0.04 | (0.02) | 0.02 |
| Scotiabank | Pública | 1I-FLOA-N | 3,005 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1I-IB1MXX-N | 985 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1I-PSQ-* | 44,846 | 0.24 | (0.39) | (0.15) |
| Scotiabank | Pública | 1I-QQQ-* | 300 | 0.02 | 0.00 | 0.02 |
| Scotiabank | Pública | 1I-SHV-* | 1,860 | 0.00 | (0.02) | (0.02) |
| Scotiabank | Pública | 1IBRZU* | 31,568 | 0.17 | (2.78) | (2.61) |
| Scotiabank | Pública | 1IEWZ* | 8,000 | 0.05 | (0.36) | (0.31) |
| Scotiabank | Pública | 1IFXE* | 4,300 | 0.29 | (0.01) | 0.28 |
| Scotiabank | Pública | 1IIB01N | 67,276 | 0.06 | (0.01) | 0.05 |
| Scotiabank | Pública | 1IPSQ* | 10,600 | 0.06 | (0.06) | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 1ISHV* | 895 | 0.05 | (0.01) | 0.04 |
| Scotiabank | Pública | 1KOFUBL | 93,825 | 0.11 | (0.38) | (0.27) |
| Scotiabank | Pública | 1LALAB | 202,991 | 0.09 | (0.02) | 0.07 |
| Scotiabank | Pública | 1MFRISCOA-1 | 55,000 | 0.01 | 0.00 | 0.01 |
| Scotiabank | Pública | 1NEMAKA | 962,675 | 0.00 | (1.38) | (1.38) |
| Scotiabank | Pública | 1PE&OLES* | 19,960 | 0.24 | 0.00 | 0.24 |
| Scotiabank | Pública | 1SITESB-1 | 221,454 | 0.16 | 0.00 | 0.16 |
| Scotiabank | Pública | 1VOLARA | 5,000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 29832--1I-SHV-* | 90 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Scotiabank | Pública | 41BSMXB | 575,431 | 0.30 | (1.15) | (0.85) |
| Scotiabank | Pública | CFFSHOP13 | 5,000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Total | | | 18,566,279 | 12.70 | (14.90) | (2.20) |

La posición accionaria de títulos Disponibles para la Venta asciende \$0 millones de pesos, con una plusvalía de \$0 millones de pesos.

| Institución | Tipo de Cotización | Emisora | Títulos | Importe Valuado | Costo | Plusvalía/ Minusvalía |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|-----------------|----------|-----------------------|
| Scotiabank | Sin cotización | EMPRESAS FRISCO, S.A. DE C.V. | 1,222 | - | - | - |
| Scotiabank | Sin cotización | BLADEX COM | 8,095 | - | - | - |
| Total | | | 9,317 | - | - | - |

Al 31 de diciembre, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$26.10 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$9.03 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$17.7 millones de pesos.

| Requerimientos de Capitalización | | | | | |
|----------------------------------|-------------|-------------|---------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| Por Riesgo General de Mercado | POSICIONES | | | Coeficiente de Riesgo de mercado | Requerimiento de capital |
| | Total Larga | Total Corta | Valor Absoluto de la posición | | |
| | 126.98 | 86.35 | 40.64 | 22.23% | 9.03 |
| Por riesgo específico | | | | | |
| Canasta de acciones, | 24.47 | - | 24.47 | 8.00% | 1.96 |
| Índices accionarios | 102.51 | 86.35 | 188.85 | 4.00% | 7.55 |
| Requerimiento por riesgos | 102.51 | 86.35 | 188.85 | 4.00% | 7.55 |
| | | | Total Requerimiento de capital | | 26.10 |

Anexo 1-O Bis Revelación de Información relativa a la Razón de Apalancamiento

TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

| REFERENCIA | RUBRO | Sep-20 | Dic-20 |
|------------|---|-----------|-----------|
| | Exposiciones dentro del balance | | |
| 1 | Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance) | 614,819 | 586,347 |
| 2 | (Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) | (6,655) | (7,315) |
| 3 | Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) | 608,164 | 579,031 |
| | Exposiciones a instrumentos financieros derivados | | |
| 4 | Costo actual de reemplazo asociado a <i>todas</i> las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible) | 6,419 | 6,835 |
| 5 | Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados | 3,329 | 3,062 |
| 6 | Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros 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 aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados) | (8,751) | (8,840) |
| 8 | (Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central) | | |
| 9 | Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos | | |
| 10 | (Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros 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) | 997 | 1,057 |
| | Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores | | |
| 12 | Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas | 28,313 | 27,835 |
| 13 | (Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) | (28,313) | (27,835) |
| 14 | Exposición Riesgo de Contraparte por SFT | 1 | 12 |
| 15 | Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros | - | - |
| 16 | Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) | 1 | 12 |
| | Otras exposiciones fuera de balance | | |
| 17 | Exposición fuera de balance (importe nocional bruto) | 274,944 | 276,490 |
| 18 | (Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) | (198,168) | (196,431) |
| 19 | Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) | 76,776 | 80,059 |
| | Capital y exposiciones totales | | |
| 20 | Capital de Nivel 1 | 51,493 | 51,587 |
| 21 | Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) | 685,937 | 660,160 |
| | Coefficiente de apalancamiento | | |
| 22 | Coefficiente de apalancamiento de Basilea III | 7.51% | 7.81% |

Cifras en millones de pesos

TABLA II.1
COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

| REFERENCIA | DESCRIPCION | Sep-20 | Dic-20 |
|------------|---|----------|----------|
| 1 | Activos totales | 666,256 | 638,178 |
| 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 | (71) | (286) |
| 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 | (22,128) | (22,939) |
| 5 | Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores | (28,312) | (27,823) |
| 6 | Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden | 76,776 | 80,059 |
| 7 | Otros ajustes | (6,584) | (7,029) |
| 8 | Exposición del coeficiente de apalancamiento | 685,937 | 660,160 |

TABLA III.1
CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

| REFERENCIA | DESCRIPCION | Sep-20 | Dic-20 |
|------------|--|----------|----------|
| 1 | Activos totales | 666,256 | 638,178 |
| 2 | Operaciones en instrumentos financieros derivados | (23,124) | (23,996) |
| 3 | Operaciones en reporto y prestamos de valores | (28,313) | (27,835) |
| 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 | 614,819 | 586,347 |

TABLA IV.1
PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS (NUMERADOR Y DENOMINADOR) DE LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

| CONCEPTO/PERIODO | Sep-20 | Dic-20 | Variación |
|---------------------------------------|---------|---------|-----------|
| Capital Básico ^{1/} | 51,493 | 51,587 | 0.18% |
| Activos Ajustados ^{2/} | 685,937 | 660,160 | -3.76% |
| Razón de Apalancamiento ^{3/} | 7.51% | 7.81% | 0.30% |

Cifras previas a la réplica de Banxico

Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la Razón de Apalancamiento por el periodo de septiembre a diciembre de 2020.

El indicador se ubicó en 7.81%, 30 pbs superior respecto al trimestre anterior, debido principalmente a la disminución de las exposiciones totales por \$25,777 millones (+29 pbs) y al incremento del Capital Nivel 1 por \$94 millones (+1 pbs).

La variación de 29 pbs en las exposiciones totales, se debe principalmente a la disminución en las exposiciones dentro del balance excluyendo los instrumentos financieros derivados (+ 33 pbs) y al incremento en las exposiciones fuera del balance (-4pbs).

Durante el trimestre el capital de nivel 1 tuvo un crecimiento de \$94 millones (+1 pbs) resultado de las deducciones que fueron compensadas con la utilidad del periodo.

TABLA I.2

NOTAS AL FORMATO DE REVELACIÓN ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

| REFERENCIA | EXPLICACIÓN |
|------------|---|
| 1 | Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico (menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores. |
| 2 | Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo. |
| 3 | Suma de las líneas 1 y 2 |
| 4 | <p>Costo actual de replazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) <i>recibidas</i>, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución. b) La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia. c) El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda. d) El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente. e) El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos. <p>En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.</p> |
| 5 | <p>Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.</p> <p>En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.</p> |
| 6 | No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral. |
| 7 | Monto de márgenes de variación en efectivo <i>entregados</i> en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo. |
| 8 | No aplica. |
| 9 | No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5. |

| REFERENCIA | EXPLICACIÓN |
|------------|--|
| 10 | No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5. |
| 11 | Suma de las líneas 4 a 10 |
| 12 | Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente) de operaciones de reporto y préstamo de valores. El importe no deberá considerar ninguna compensación conforme a los Criterios Contables. |
| 13 | <p>Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:</p> <ol style="list-style-type: none"> Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación. Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento. Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar. Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo. <p>El monto se debe registrar con signo negativo.</p> |
| 14 | Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización. |
| 15 | <p>Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado.</p> <p>Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.</p> |
| 16 | Suma de las líneas 12 a 15 |
| 17 | Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables. |
| 18 | <p>Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%.</p> <p>El monto se debe registrar con signo negativo.</p> |
| 19 | Suma de las líneas 17 y 18 |
| 20 | Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. |
| 21 | Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19 |
| 22 | Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21. |

TABLA II.2
NOTAS AL COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

| REFERENCIA | DESCRIPCIÓN |
|------------|---|
| 1 | Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico. |
| 2 | Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos b), d), e), f), g), h), i), j) y l) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo. |
| 3 | No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico. |
| 4 | Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 11 de la Tabla I.1 y la cifra presentada en operaciones con instrumentos financieros derivados contenidos en el balance de la Institución. El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo. |
| 5 | Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 16 de la Tabla I.1 y la cifra presentada por operaciones de reporto y préstamo de valores contenidos en el balance de la Institución. El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo. |
| 6 | Importe registrado en la fila 19 de la Tabla I.1. El monto se debe registrar con signo positivo. |
| 7 | Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos c), k), m), n), p), q) y r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo. |
| 8 | Suma de las líneas 1 a 7, la cual debe coincidir con la línea 21 de la Tabla I.1. |

TABLA III.2
NOTAS A LA CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

| REFERENCIA | DESCRIPCIÓN |
|------------|---|
| 1 | Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico. |
| 2 | El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados presentadas en el activo de los últimos estados financieros. El monto se debe registrar con signo negativo. |
| 3 | El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores presentadas en el activo de los últimos estados financieros. El monto se debe registrar con signo negativo. |
| 4 | No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico. |
| 5 | Suma de las líneas 1 a 4, la cual debe coincidir con la línea 1 de la Tabla I.1 |

Agencias Calificadoras

| Scotiabank Calificaciones Escala Nacional | Largo plazo | Corto plazo | Perspectiva |
|---|-------------|-------------|-------------|
| Fitch Ratings | AAA(mex) | F1+(mex) | Estable |
| Standard & Poor's | mxAAA | mxA-1+ | Estable |

La información aquí publicada ha sido preparada por Scotiabank con el único fin de informar a sus clientes las calificaciones vigentes que le han sido otorgadas por las Agencias Calificadoras (Fitch Ratings y Standard & Poor's), en su calidad de emisor a escala nacional y están sujetas a modificaciones sin previo aviso por parte de las Agencias Calificadoras.

Dividendos

Mediante sesión del Consejo de Administración del 26 de febrero del 2013, se acordó proponer a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de un dividendo en efectivo por la cantidad de \$164'795,248.00 (Ciento sesenta y cuatro millones setecientos noventa y cinco mil doscientos cuarenta y ocho pesos 00/100 M.N).

En Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 12 de abril del 2013, se aprobó decretar un dividendo en efectivo hasta por la cantidad de \$164'795,248.

Fecha de pago

23 de abril de 2013

Importe

\$ 165 millones

Asimismo, se aprobó la nueva política para el decreto y pago de dividendos para el año 2013, por medio de la cual, al término de cada trimestre, se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de un dividendo en efectivo por el 30% de las utilidades generadas en dicho trimestre por Scotiabank, con cargo a la cuenta de "Utilidad de Ejercicios Anteriores", para ser pagado en el mes inmediato posterior a la celebración de la Asamblea referida.

Mediante Asamblea General ordinaria de Accionistas de fecha 24 de mayo del 2013, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo por la cantidad de \$299'944,566.00 (Doscientos noventa y nueve millones novecientos cuarenta y cuatro mil quinientos sesenta y seis pesos 00/100) M.N. a razón de \$0.0483781558065 pesos por acción, para distribuirlo entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6'200,000,000 (Seis mil doscientas millones) de acciones de las series "F" y "B, que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank, mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta "Resultados Ejercicios Anteriores", el cual fue pagado el 31 de mayo del 2013, a través de la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V.

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 23 de agosto del 2013, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo por la cantidad de \$59'425,310.00 M.N. (Cincuenta y nueve millones cuatrocientos veinticinco mil trescientos diez 00/100) M.N. a razón de \$0.0095847274194 pesos por acción, para distribuirlo entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6'200,000,000 (Seis mil doscientas millones) de acciones de las series "F" y "B, que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank, mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta "Resultados Ejercicios Anteriores"

Asimismo se aprobó decretar y pagar en dicha asamblea un segundo dividendo en efectivo hasta por la cantidad de \$200'000,000.00 (Doscientos millones de pesos 00/100) M.N a razón de \$0.0322580645161 pesos por acción, para distribuirlo entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6,200'000,000 (Seis mil doscientas millones) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank, mediante una sola exhibición en efectivo con cargo a la cuenta de "Utilidad de Ejercicios Anteriores".

Ambos dividendos fueron pagados el 30 de agosto del 2013, a través de la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V.

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 13 de noviembre del 2013, se aprobó decretar y pagar dividendos en efectivo, el primero de ellos hasta por la cantidad de \$318'443,208.00 M.N. (Trescientos dieciocho millones cuatrocientos cuarenta y tres mil doscientos ocho pesos 00/100) M.N, a razón de \$0.0513618077419 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6,200'000,000 (Seis mil doscientas millones) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de "Utilidad de Ejercicios Anteriores" el cual fue pagado el 21 de noviembre del 2013, a través de la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V.

Asimismo, en dicha Asamblea se aprobó decretar y pagar un dividendo extraordinario hasta por la cantidad de \$490'000,000.00 (Cuatrocientos noventa millones de pesos 00/100) M.N, a razón de \$0.0790322580645 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6,200'000,000 (Seis mil doscientos millones) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo. el cual también fue pagado el 21 de noviembre del 2013, a través de la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V.

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 20 de diciembre del 2013, se aprobó decretar y pagar un dividendo extraordinario en efectivo, hasta por la cantidad de \$4,200'000,000.00 (Cuatro mil doscientos millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.6774193548387 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6,200'000,000 (Seis mil doscientas millones) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, el dividendo de referencia no fue pagado a través de la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V., se llevó a cabo a través de Scotiabank con fecha 20 de diciembre de 2013.

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 21 de marzo del 2014, se aprobó modificación a la política para el pago de dividendos, a efecto de que se decreten y paguen dividendos en un rango del 0%-30% respecto de las utilidades generadas durante el trimestre anterior.

Mediante carta instrucción los señores Enrique Zorrilla Fullaondo y/o Michael Coate, y con base a las facultades otorgadas por la Asamblea General Ordinaria de Accionistas de Scotiabank Inverlat, S.A., solicitaron llevar a cabo todas las gestiones necesarias para que el 27 de junio de 2018, se efectuaran el pago de dividendos decretado por las Asambleas de Accionistas, por un monto total de \$3,148,000,000.00 (Tres mil ciento cuarenta y ocho millones de pesos 00/100) M.N., para Scotiabank Inverlat, S.A. a razón de \$0.3555655955272 por acción para distribuirse sobre la totalidad de las acciones en circulación.

Mediante carta instrucción los señores Enrique Zorrilla Fullaondo y/o Michael Coate, con base a las facultades otorgadas por las Asambleas Generales Ordinarias de Accionistas de Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, GFSBI, celebradas el pasado 25 de mayo y 6 de junio ambas del 2018 respectivamente, solicitaron llevar a cabo todas las gestiones necesarias para que el 11 de septiembre del año en curso, se efectuaran el pago del dividendo decretado por las Asambleas de Accionistas referidas, por un monto total de \$3,547,492,638.09 (Tres mil quinientos cuarenta y siete millones cuatrocientos noventa y dos mil seiscientos treinta y ocho pesos 09/100) M.N., para Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, GFSBI, para distribuirse sobre la totalidad de las acciones en circulación.

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de diciembre del 2020, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$ 95,086 millones de pesos.
- Disponibilidades en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$ 34,135 millones de pesos.

Adicionalmente:

- Se cuenta con líneas comprometidas con Instituciones Extranjeras por USD \$150 millones de dólares.
- Se mantiene una buena calificación de crédito para asegurar acceso a préstamos a tasas y plazos competitivos.
- Se cuenta con una amplia base de depósitos tradicionales (Vista y Plazo), bien diversificada y segmentada entre los diferentes tipos de depositantes de tal forma que no se cuenta con dependencias relevantes que comprometan la liquidez de la institución.
- Adicionalmente se cuenta con préstamos de la banca de desarrollo y de fomento (Fovi, Nafin, Fira, entre otros) cuyas funciones son contar con una fuente de fondeo destinada a apoyar sectores específicos de la economía.

Inversiones relevantes en capital

Al 31 de diciembre de 2020, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



I. Información Cualitativa

a. Discusión sobre las políticas de uso de instrumentos financieros derivados

La Dirección General del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (GFSBI), al cual pertenece Scotiabank Inverlat (SBI) y un comité designado por el Consejo de Administración revisan por lo menos con periodicidad semestral y cada vez que las condiciones del mercado lo ameritan, los objetivos, metas y procedimientos de operación y control, así como los niveles de tolerancia de riesgo.

Para tales efectos, la Dirección General se apoya en las áreas u órganos apropiados (Consejo de Administración, Comité de Riesgos) para llevar a cabo las actividades específicas en los requerimientos de administración que marca la Circular 4/2012 emitida por Banco de México.

Las diferentes áreas responsables de la operación y supervisión del mercado definen los objetivos, metas y procedimientos particulares, de operación y control, así como las tolerancias máximas de riesgo aceptables por área, mismos que deberán ser congruentes con los lineamientos generales establecidos por la Dirección General.

Los productos derivados son importantes herramientas de gestión de riesgo tanto para el Banco como para sus clientes.

El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo a las políticas establecidas.

Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:

1. Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo-rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.
2. Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.
3. Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
4. Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

1. Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.
2. Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.
3. Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

La Institución cuenta con Políticas y manuales, que se enlistan a continuación, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y administración de derivados; entre estas políticas se destaca la de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas que involucra la participación de diversas áreas de la Institución, a fin de garantizar que no se incurran en riesgos operativos, legales o reputacionales.

1. Manual de Operación de Derivados.
2. Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.
3. Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).
4. Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas
5. Política de Riesgo de Contraparte
6. Política de Sobregiros

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados. Durante el cuarto trimestre de 2020, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a los Criterios Contables B-5 “derivados y operaciones de cobertura” emitido por la CNBV y aplicables a las Instituciones de Crédito, en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de operaciones de cobertura.

Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles movimientos de las tasas de interés y de tipo de cambio. Las condiciones de mercado bajo las cuales se realizan coberturas son las siguientes:

| Núm. | Tipo de Cobertura | Posición Cubierta | Tipo de posición cubierta | Condición de Mercado | Derivado |
|------|--------------------|--|---------------------------|---|--|
| 1. | Flujos de Efectivo | Pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija | Pasiva | Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés | Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante) |
| 2. | Valor Razonable | Bonos de tasa fija en moneda extranjera | Activa | Cubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente. | Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante) |
| 3. | Flujos de Efectivo | Cartera Comercial de tasa flotante | Activa | Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés | Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija) |
| 4. | Valor Razonable | Cartera Comercial de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera | Activa | Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés | Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante) |
| 5. | Flujos de Efectivo | Certificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcional | Pasiva | Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés | Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante) |
| 6. | Valor Razonable | Bonos de tasa fija en moneda funcional | Pasiva | Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés | Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija) |

| Núm. | Tipo de Cobertura | Posición Cubierta | Tipo de posición cubierta | Condición de Mercado | Derivado |
|------|--------------------|---|---------------------------|--|--|
| 7. | Flujos de Efectivo | Reportos | Pasiva | Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés | Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante) |
| 8. | Flujos de Efectivo | Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera | Activa | Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN | Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional) |
| 9. | Flujo de Efectivo | Bonos de tasa fija en moneda extranjera | Activa | Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos | Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional) |

Las operaciones de derivados de cobertura se incluirán dentro del cálculo de medidas de sensibilidad (i.e. Valor Económico y sensibilidad del margen). En adición, se monitorearán bajo los límites establecidos para ALM previamente aprobados por el Comité de Riesgos.

En lo que respecta a los productos de negociación aprobados Banco se encuentran:

| Subyacente | Futuros | | Opciones | | Swaps | |
|---|---------|----|----------|----|-------|----|
| | MR | ME | MR | ME | MR | ME |
| Acciones, un grupo o canasta de acciones, o títulos referenciados a acciones, que coticen en una bolsa de valores. | | | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ |
| Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores. | ✓ | | ✓ | ✓ | | |
| * Tasas de interés nominal, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas | ✓ | ✓ | | ✓ | ✓ | ✓ |
| Operaciones de Opción sobre futuros de índice. | | | ✓ | | | |
| Moneda nacional, Divisas y UDIS; | ✓ | ✓ | | ✓ | | ✓ |
| Oro y Plata | | ✓ | | ✓ | | |
| Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (<i>Swaps</i>) en especie y por diferenciales. | ✓ | ✓ | | | | |

*SBI solicita autorización para operar por cuenta propia, productos derivados de tasas de interés cuya característica o variación consiste principalmente en pactar/establecer una fecha futura y/o periodo determinado para fijar la tasa de interés y el inicio del intercambio de pago
(MR) Mercados reconocidos
(ME) Mercados extrabursátiles

El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algoritmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Con esta metodología se generan 300 escenarios a partir de las observaciones históricas y los principales supuestos del modelo son:

- ✓ El Modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo
- ✓ El Modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.
- ✓ El Modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados.)
- ✓ El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.

Debido a que la medida de VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución realiza diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

Adicionalmente se realizan pruebas de backtest donde se compara el P&L (teórico y real) diario vs VaR de 1 día. Este análisis es realizado mensualmente y es presentado al Comité de Riesgos del Consejo de Administración al menos trimestralmente.

Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles. Scotiabank Inverlat administra su exposición al riesgo de liquidez conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado.

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

- Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.
- Eliminar la necesidad de obtener fondos a tasas por arriba de las de mercado o a través de ventas forzadas de activos.
- Satisfacer los límites y requerimientos de liquidez exigidas por las autoridades.
- Establecer e implementar políticas de liquidez prudentes.
- Desarrollar e implementar técnicas y procedimientos efectivos para monitorear, medir y controlar los requerimientos de liquidez.

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

- Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo.
- Diversificar fuentes de fondeo.
- Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes activos líquidos para hacer frente a eventos inesperados.
- Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de diciembre 2020 y en promedio para el cuarto trimestre de 2020 es de:

| Scotiabank | Posición | Posición |
|--|-----------------------------|-------------------|
| <i>(millones de pesos)</i> | <i>(Cierre)⁸</i> | <i>(Promedio)</i> |
| Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) | (2,123) | 9,679 |

⁸ Cifras previas al cierre de diciembre 2020.

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales, incluyendo posiciones de derivados de cobertura.

Inventario de modelos de derivados

Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration – Grupo Financiero Scotiabank (México). El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los aplicativos desarrollados en casa matriz (K2 & Wall Street).

| Instrumentos a Valor Razonable | | | |
|--------------------------------|-------------|---|--|
| Clase de activo | Derivado | Tipo | Breve descripción |
| Tasas de interés | Opciones | Europea | <p>Caps, Floors:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets. $\text{Cap} = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$ <ul style="list-style-type: none"> • Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet. $\text{Floor} = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$ |
| | | Binaria | <p>La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap). • Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor). |
| | IRS | | El intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable). |
| | CCIRS | | Intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas. |
| Tipo de cambio | Opciones | Europea | En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black–Scholes–Merton. |
| | | Americana | El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976) |
| | Binaria | Se recibe un pago fijo como beneficio en caso que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción. A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing. | |
| | Barrera | Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento S_T , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t < T}$, son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente S_T alcance un umbral preestablecido H llamado barrera de la opción. | |
| Forward | Forward OTC | | Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC. |

Instrumentos a Valor Razonable

| Clase de activo | Derivado | Tipo | Breve descripción |
|------------------------------|----------------|---------|--|
| Índices, capitales y metales | Opciones | Europea | Opción Europea Call / Put: Este tipo de contratos utiliza la fórmula de Black-Scholes. Opción Europea Quanto: Una opción tipo Quanto es un derivado en el cual el subyacente se denomina en una moneda, pero el instrumento en sí se liquida en otra moneda a una tasa determinada. Tales productos son atractivos para los inversionistas que desean estar expuestos a un activo extranjero, pero sin el riesgo de tipo de cambio equivalente. |
| | | Binaria | Tipo de opción la cual al vencimiento solo tiene dos eventos pagar o no pagar un monto previamente definido. |
| Derivados listados | Mexder Futures | IR | Las Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre Contrato de Intercambio de Flujos de Tasas son acorde a metodología disponible en sitio Mexder. |
| | | FX | Las Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre el tipo de cambio son acorde a metodología disponible en sitio Mexder. |

Instrumentos valuados a costo

| Clase de activo | Nombre de producto | Metodología | Notas |
|------------------------------|--------------------|---|--|
| FI Security | Bonos | Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. | La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado. |
| EQ Cash | Acciones | Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. | La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado. |
| Fondos de inversión | ETFs | Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. | La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado. |
| Notas Estructuradas listadas | Bonos | Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. | La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado. |

Políticas de márgenes, colaterales, líneas de crédito y VaR.

i. Políticas Líneas de Crédito

Se informa a esa H. Comisión que en el Manual de Políticas de Crédito Cartera Comercial, en su “Manual de Productos y Programas Especiales de Crédito Cartera Comercial, Apartado III Mercado Financiero, 1.1 Operaciones del Banco en el Mercado Financiero” se norman las operaciones del Banco en el Mercado Financiero estableciendo:

- Tipos de Operación que son ofrecidos en función al tipo de acreditado
 - a) Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:
 - Necesidades de tesorería del Banco
 - Relación de corresponsalía
 - Límites recíprocos
 - b) Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:
 - Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.
 - c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:
 - Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

- Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco
 1. Tesorería: Call Money
 2. Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores
 3. Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles
 4. Cambios: FOREX
 5. Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)
 6. Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos
 7. Metales

- Sujetos de Crédito

Podrán ser sujetos de crédito en productos de este mercado, los siguientes:

- Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
- Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.
- Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)
- Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público

- Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

- La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al “Potential Future Exposure”.
- La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar.
- Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.
- La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.

- Idoneidad del Cliente

La celebración de operaciones de productos de Mercado Financiero implica la necesidad de que el Banco cuente con elementos razonables que le garanticen, que:

- El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar
- Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

Para tales efectos, en toda Solicitud de línea para este tipo de productos, se deben aplicar las reglas de la Política de Idoneidad del Grupo Scotiabank, que establece los procesos a seguir para la clasificación del riesgo de idoneidad, basado en la complejidad de las operaciones y en el conocimiento/ experiencia que el cliente tenga al respecto. Asimismo, en cada revisión anual se debe evaluar si la clasificación de riesgo de idoneidad del cliente es la misma o ha cambiado desde la última revisión.

ii. Políticas de VaR

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de Negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algorithmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Debido a que la medida VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución deberá realizar diariamente pruebas bajo condiciones extremas “stress testing” con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

La unidad Riesgo de Mercado (TFRM) es responsable de definir los procedimientos y cálculos necesarios para realizar el análisis de sensibilidad sobre los portafolios de Trading. Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple y eficaz, además de que se puede hacer un seguimiento de manera sencilla de Estados de resultados (P&L). Los cálculos de sensibilidad se realizan diariamente en forma automática, con procedimientos desarrollados por la Dirección de TFRM.

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

Se estima cual sería el comportamiento del valor del portafolio ante un cambio en las tasas de interés cotizadas en el mercado (curva de rendimientos).

Las sensibilidades del portafolio de instrumentos de renta fija se basan en los conceptos de duración y convexidad y su aplicación dependerá del tipo de instrumento. En todos los casos se producen 2 mediciones; i) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 1 punto base (0.01%) en la curva de rendimiento, y ii) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 100 puntos base (1%) en la curva de rendimiento.

Bonos de Tasa Flotante

En el caso de bonos de tasa flotante la unidad Riesgo de Mercado (TFRM) realiza dos tipos de sensibilidades, la sensibilidad a la tasa libre de riesgos (curva de gobierno o curva mayor) y la sensibilidad a la sobretasa o Spreads, esta metodología asume que un bono de tasa flotante se comporta como la parte flotante de un swap de tasas de interés.

Con metodología se asume que la repreciaación ocurre justamente al pago de cupón.

Bonos Cupón Cero

Para el cómputo de la sensibilidad de instrumentos cupón cero, se utiliza el mismo sistema utilizado en instrumentos de tasa fija.

Riesgo de Crédito

También se utiliza el concepto de duración, pero en el caso de los instrumentos de tasa flotante se utiliza la duración total de instrumento en lugar de la “duración al próximo cupón”.

Sensibilidad del Pasivo

Gran parte del portafolio de trading de la institución se encuentra fondeado con reportos. Para efectos de determinar cuál es la sensibilidad de la parte corta (el financiamiento) de las posiciones, se determina el cambio del valor del portafolio ante un cambio de 1 (0.01%) y 100 puntos básicos en las tasas de interés (1%).

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

Para efectos de determinar la sensibilidad a cambios en la curva de rendimiento de los Swaps de TIIE, se efectúa un cambio de 1 punto base en cada uno de los puntos relevantes de la curva de rendimientos, además de un cambio de 1 y cien puntos base de forma paralela, valuando el portafolio con las diferentes curvas y calculando cual es el cambio en el valor del portafolio con cada uno de esos cambios.

En el caso de Swaps sobre otro tipo de tasas de interés, lo cual puede incluir CETES y/o Libor, los cálculos se realizan directamente haciendo un shock de 1 y 100 puntos base sobre la curva cupón cero. Todas las transacciones realizadas sobre subyacentes distintos de TIIE están autorizados sólo en una base back to back

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

Para el cálculo de sensibilidad de estos derivados a la tasa de interés, se utilizan los conceptos de duración y convexidad.

Futuros de CETE

El tratamiento de futuros de Cete es análogo al tratamiento de futuros de TIIE.

Efectividad De la Cobertura:

Se realizan pruebas y análisis, al inicio de cada operación de cobertura y de manera continua, con base en la comparación de los cambios pasados en el valor razonable o en los flujos de efectivo del instrumento de cobertura con los cambios que hayan experimentado en el pasado el valor razonable o los flujos de efectivo de la posición primaria.

Las pruebas consideran 61 escenarios históricos y se realiza con base en un análisis de regresión.

Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios semanales históricos, es decir una ventana de observación mayor a un año.

Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos).

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios arriba descritos. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

Grado de relación entre los cambios observados: $R^2 > 80\%$.

Pendiente de la regresión entre [-1.25 y -0.80].

Significancia de la regresión: $F > 5$.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con los requerimientos del B5 para concluir cobertura efectiva. Al cierre de diciembre 2020 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son cobertura eficiente.

Durante el cuarto trimestre de 2020 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha de actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos del B5 aplicables a Instituciones de Crédito.

Cobertura de Flujos de efectivo:

La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de la cuenta de utilidad integral en el capital contable y, la porción ineffectiva, se reconoce inmediatamente en los resultados del período.

El componente del capital contable que forma parte de la utilidad integral asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre:

La ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.

Cobertura de Valor Razonable:

La ganancia o pérdida que resulte de valorar el instrumento de cobertura a su valor razonable es reconocida de forma inmediata en los resultados del período en que ocurre.

La ganancia o pérdida que resulte de valorar la posición cubierta atribuible al riesgo cubierto, debe ajustar el valor en libros de dicha posición y se reconoce inmediatamente en los resultados del período en que ocurre.

En adición a lo arriba descrito, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base sistemas especializados internos.

c. Información de Riesgos por el uso de Derivados

Scotiabank Inverlat asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que el Banco pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles, para lo cual el Banco aplica controles a las brechas de liquidez, monitorea indicadores clave de liquidez, mantiene fuentes diversificadas de fondeo, establece límites y mantiene un porcentaje mínimo de activos líquidos.

Las exposiciones al riesgo de liquidez son cubiertas desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.

Al cierre de diciembre de 2020 y promedio del cuarto trimestre 2020 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

| Scotiabank (millones de pesos) | Posición (Cierre) ⁹ | Posición (Promedio) |
|--|-----------------------------------|------------------------|
| Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) | 102,358 | 97,363 |

Se realizó un análisis de sensibilidad para las operaciones con instrumentos financieros derivados mismo que refleja requerimientos adicionales que pudieran suscitarse por eventualidades en el mercado, lo anterior podría verse reflejado en una pérdida potencial o en salidas de efectivo adicionales para Scotiabank Inverlat.

Para estos efectos el cálculo de la exposición potencial para derivados considera lo siguiente:

Considerando 3 escenarios (probable, posible y de estrés), Scotiabank Inverlat podría tener salidas de efectivo adicionales por posible baja en su calificación crediticia, dado que el colateral entregado sería mayor. Esto en conexión con instrumentos financieros derivados OTC que tengan asociados contratos marco.

La salida/pérdida potencial para los 3 escenarios dada la baja de 3 escalafones en la calificación crediticia del GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat, está dada por:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

$$SD = \sum_{i=1}^n SD_i$$

$$SD_i = (T_{ii} - T_{ij})$$

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

$$SD = \sum_{i=1}^n SD_i$$

$$SD_i = \text{Max}(|MTM| - T_{ij}, (T_{ii} - T_{ij}))$$

En donde:

| | |
|-----------|--|
| Parámetro | Descripción |
| SD | Salida de efectivo por derivados. |
| T_{ii} | Umbral con la Contraparte i en el estado i |
| T_{ij} | Umbral con la Contraparte i en el estado j |
| MTM | Mark to Market |

⁹ Cifras previas al cierre de diciembre 2020.

En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.

Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:

| Scotiabank (millones de pesos) | Normal | Escenario Posible | Escenario Probable | Escenario de Estrés |
|--|---------------|------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|
| Gap 30d Gap Acum | (2,123) | (3,610) | (3,611) | (3,612) |
| Cambios en el Gap respecto al escenario normal | | (1,487) | (1,488) | (1,489) |

Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz, y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.

El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC, se basa en el modelo de valoración de opciones sobre futuros, conocido como Black 1976.

Delta

La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.

Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. - Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.

Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes. -

Exposición Delta: Se define como el monto nocional equivalente del subyacente (en cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.

Gamma

El riesgo gamma es complementario al riesgo delta, y es otra medida de sensibilidad del valor de una opción con respecto al valor de un subyacente. Gamma mide la tasa de cambio de la delta ante un cambio en el nivel del subyacente, y análogo al cálculo de delta, puede ser interpretada de manera analítica, como la segunda derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al subyacente.

Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos de medición de riesgos no se realizan de manera analítica sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo gamma, denominadas gamma1 y gamma5.

Gamma1 mide cual es el cambio de la exposición delta del portfolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que gamma5 mide cual es el cambio de la exposición delta del portfolio ante un cambio de 5% en el valor del subyacente. Ambas mediciones cuentan con límites de riesgos.

Vega

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portfolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.

Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portfolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portfolio.

Rho

Rho es la medida de sensibilidad de un portfolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portfolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).

RHO es entonces definida como el cambio en el valor de un portfolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.

Theta

Theta es la medida de sensibilidad de un portfolio de opciones que indica el cambio en el valor del portfolio ante el paso del tiempo. Analíticamente, Theta puede ser expresado como la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al tiempo.

Theta es calculada mediante el procedimiento de valuación completa (tal como es el caso de las otras griegas) en lugar de analíticamente, sólo con fines informativos y de atribución de P&L.

Dividend Risk

La valoración de opciones sobre índices o acciones supone una tasa de dividendos compuesta continua conocida. Los dividendos, sin embargo, son una estimación y por tanto una variable desconocida, representando un factor de riesgos para la valuación y el consiguiente P&L de las operaciones con opciones.

El riesgo de dividendos no tiene una letra “griega” asociada a su sensibilidad, y en el caso de opciones sobre índices y acciones. La medición se realiza por la vía de incrementar un 1% (i.e. desde 1% a 1.01%) la tasa de dividendos.

II. Información Cuantitativa

a. Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa.

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a Diciembre 31, 2020:

| | 0-3 Months | 3 - 12 Months | 1 - 3 Years | 3 - 5 Years | 5 - 10 Years | 10 - 30 Years | Total Today |
|--------------------------|------------------|---------------------|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| Swaps | 45,072.10 | (162,815.94) | 67,045.54 | 402,226.33 | (77,188.32) | (51,807.91) | 222,531.79 |
| CCS | 14.00 | 382.00 | 1,433.00 | 249.00 | 251.00 | 12.00 | 2,341.00 |
| Caps&Floors | 7.00 | 395.00 | 55.00 | (207.00) | - | - | 250.00 |
| Binary Caps&Floors | - | - | - | - | - | - | - |
| TIIE Futures | - | - | - | - | - | - | - |
| Mbonds Futures | - | - | - | - | - | - | - |
| Total DERIVATIVES | 45,093.10 | (162,038.94) | 68,533.54 | 402,268.33 | (76,937.32) | (51,795.91) | 225,122.79 |

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIIE, Bonos M, Cap&Floor el método para calcular la sensibilidades es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.

Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de -18.67 Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de -37.35 Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable -82.12 Millones de pesos.

Los escenarios de stress stán basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de -10%,-30% y -50% para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de escenarios al alza

| Tipo Sensibilidad | Instrumento | Sensibilidad | MTM | Probable Shock(+/-) | P&L | Stress 1 Shock(+/-) | P&L | Stress 2 Shock(+/-) | P&L |
|-------------------|---------------------------|--------------|----------|---------------------|----------------|---------------------|----------------|---------------------|----------------|
| - 1pb a la tasa | Futuros de TIIIE y Bono M | - | - | 50.00 | - | 100.00 | - | 200.00 | - |
| - 1pb a la tasa | IRS & CCS & Delta Caps | 0.23 | (205.48) | 50.00 | (11.26) | 100.00 | (22.51) | 200.00 | (45.02) |
| Volatilidad al 1% | Caps & Floors | (0.00) | (0.01) | 0.10 | (0.00) | 0.40 | (0.00) | 1.00 | (0.00) |
| a FX % | Forwards | 3.73 | 74.18 | 0.10 | (7.42) | 0.20 | (14.84) | 0.50 | (37.09) |
| a FX % | Opciones Divisa | - | - | 0.10 | - | 0.20 | - | 0.50 | - |
| Total | | | | | (18.67) | | (37.35) | | (82.12) |

b. Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 31 de diciembre de 2020.

| | Delta | Vega | Gamma |
|-----------------------|---------------------|------------------|-------------------|
| Options MEXBOL.INDX | 3,899.00 | (6.00) | (710.00) |
| Options MEXMSF.INDX | 281,933.00 | 2,708.00 | - |
| Options MEXMSI.INDX | 4,207,566.00 | 32,832.00 | - |
| Options MEXSPX.INDX | (3,898.00) | 5.00 | - |
| Options MEXSR5.INDX | 1,849,689.00 | 16,756.00 | - |
| Options MEXTSX60.INDX | 67,999.00 | 198.00 | - |
| Options MXNNKY.INDX | 28,984.00 | (59.00) | (8,790.00) |
| TOTAL | 6,436,172.00 | 52,434.00 | (9,500.00) |

Análisis de Stress

Los escenarios de stress a la baja; probable -10%, poco probable -30% y muy poco probable -50% son los siguientes:

| | Escenarios a la Baja | | |
|-----------------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|
| | -0.1 | -0.3 | -0.5 |
| Options GE.USM | (389.90) | (1,169.70) | (1,949.50) |
| Options GOOGUSM | (28,193.30) | (84,579.90) | (140,966.50) |
| Options Basket IXM SX7E | (420,756.60) | (1,262,269.80) | (2,103,783.00) |
| Options IXM SX5E Mex Basket | 389.80 | 1,169.40 | 1,949.00 |
| Options FBusm | (184,968.90) | (554,906.70) | (924,844.50) |
| Options MXSXAE.INDX | (6,799.90) | (20,399.70) | (33,999.50) |
| Options HSCE.INDX | (2,898.40) | (8,695.20) | (14,492.00) |
| TOTAL | (643,617.20) | (1,930,851.60) | (3,218,086.00) |

Los escenarios de stress a la alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:

| | Escenarios a la Alza | | |
|-----------------------------|----------------------|-------------------|---------------------|
| | 0.05 | 0.15 | 0.2 |
| Options GE.USM | 194.95 | 584.85 | 779.80 |
| Options GOOGUSM | 14,096.65 | 42,289.95 | 56,386.60 |
| Options Basket IXM SX7E | 210,378.30 | 631,134.90 | 841,513.20 |
| Options IXM SX5E Mex Basket | (194.90) | (584.70) | (779.60) |
| Options FBusm | 92,484.45 | 277,453.35 | 369,937.80 |
| Options MXSXAE.INDX | 3,399.95 | 10,199.85 | 13,599.80 |
| Options HSCE.INDX | 1,449.20 | 4,347.60 | 5,796.80 |
| TOTAL | 321,808.60 | 965,425.80 | 1,287,234.40 |

Y están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de -10%, -30% y -50% para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de escenarios al alza.

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

| Del Escenario | Monto |
|-------------------|----------------|
| Probable | (643,617.20) |
| Poco Probable | (1,930,851.60) |
| Muy poco Probable | (3,218,086.00) |

Describir y numerar los Instrumentos Financieros Derivados que hayan vencido durante el trimestre y de aquéllos cuya posición haya sido cerrada.

| TransID | ProductID | MaturityDate | Buy/Sell Flag | Trans Status | Base CurID | PaySide Notional | PaySide CurID | RcvSide Notional | RcvSide CurID | Option Notional |
|---------|-----------|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| P14812 | Cap | 16/10/2020 | Sell | A | mex | | | | | 318,462,895 |
| P16255 | Cap | 16/10/2020 | Buy | A | mex | | | | | 18,000,000 |
| P16256 | Cap | 16/10/2020 | Sell | A | mex | | | | | 18,000,000 |
| P13491 | Cap | 28/10/2020 | Buy | A | mex | | | | | 200,000,000 |
| P13492 | Cap | 28/10/2020 | Buy | A | mex | | | | | 185,000,000 |
| P13494 | Cap | 28/10/2020 | Buy | A | mex | | | | | 150,000,000 |
| P12006 | Cap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | | | | | 200,000,000 |
| P13130 | Cap | 31/10/2020 | Sell | A | mex | | | | | 26,650,000 |
| P14687 | Cap | 31/10/2020 | Sell | A | mex | | | | | 21,485,000 |
| P14688 | Cap | 31/10/2020 | Buy | A | mex | | | | | 21,485,000 |
| P14695 | Cap | 08/11/2020 | Buy | A | mex | | | | | 10,285,000 |
| P14696 | Cap | 08/11/2020 | Sell | A | mex | | | | | 10,285,000 |
| P13113 | Cap | 20/11/2020 | Sell | A | mex | | | | | 522,770 |
| P13026 | Cap | 01/12/2020 | Buy | A | usm | | | | | 1,107,026 |
| P13027 | Cap | 01/12/2020 | Sell | A | usm | | | | | 1,107,026 |
| P13111 | Cap | 13/12/2020 | Buy | A | usm | | | | | 6,296,124 |
| P13220 | Cap | 13/12/2020 | Sell | A | usm | | | | | 6,296,124 |
| P11994 | Cap | 15/12/2020 | Sell | A | mex | | | | | 61,048,209 |
| P13533 | Cap | 18/12/2020 | Sell | A | mex | | | | | 300,000,000 |
| P13536 | Cap | 18/12/2020 | Buy | A | mex | | | | | 300,000,000 |
| P13112 | Cap | 20/12/2020 | Sell | A | mex | | | | | 649,510 |
| P16236 | Cap | 29/12/2020 | Sell | A | mex | | | | | 10,000,000 |
| P16237 | Cap | 29/12/2020 | Sell | A | mex | | | | | 10,000,000 |
| P16238 | Cap | 29/12/2020 | Buy | A | mex | | | | | 10,000,000 |
| P13489 | Floor | 28/10/2020 | Sell | A | mex | | | | | 220,000,000 |
| P12007 | Floor | 30/10/2020 | Buy | A | mex | | | | | 200,000,000 |
| C42977 | CC Swap | 02/10/2020 | Buy | A | usd | 200,000,000 | usd | 3,643,700,000 | mex | |
| C42978 | CC Swap | 02/10/2020 | Buy | A | usd | 3,643,700,000 | mex | 200,000,000 | usd | |
| C60234 | CC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | usd | 10,702,519 | usd | 199,420,037 | mex | |
| C60420 | CC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | usd | 199,420,037 | mex | 10,702,519 | usd | |
| SCE150 | SC Swap | 05/10/2020 | Buy | A | mex | 15,254,237 | mex | 15,254,237 | mex | |
| SCE287 | SC Swap | 05/10/2020 | Buy | A | mex | 15,254,237 | mex | 15,254,237 | mex | |
| SV8391 | SC Swap | 06/10/2020 | Buy | A | mex | 5,000,000 | mex | 5,000,000 | mex | |
| SV8402 | SC Swap | 06/10/2020 | Buy | A | mex | 5,000,000 | mex | 5,000,000 | mex | |
| SCK062 | SC Swap | 07/10/2020 | Buy | A | mex | 1,950,000,000 | mex | 1,950,000,000 | mex | |
| SBM524 | SC Swap | 08/10/2020 | Buy | A | mex | 275,000,000 | mex | 275,000,000 | mex | |
| SU7054 | SC Swap | 09/10/2020 | Buy | A | mex | 85,000,000 | mex | 85,000,000 | mex | |
| SU7068 | SC Swap | 09/10/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU9567 | SC Swap | 09/10/2020 | Buy | A | mex | 85,000,000 | mex | 85,000,000 | mex | |
| SV9998 | SC Swap | 09/10/2020 | Buy | A | mex | 2,041,708 | mex | 2,041,708 | mex | |

| TransID | ProductID | MaturityDate | Buy/Sell Flag | Trans Status | Base CurID | PaySide Notional | PaySide CurID | RcvSide Notional | RcvSide CurID | Option Notional |
|---------|-----------|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| SW1192 | SC Swap | 09/10/2020 | Buy | A | mex | 2,041,708 | mex | 2,041,708 | mex | |
| SW2001 | SC Swap | 09/10/2020 | Buy | A | mex | 3,966,178 | mex | 3,966,178 | mex | |
| SW2032 | SC Swap | 09/10/2020 | Buy | A | mex | 3,966,178 | mex | 3,966,178 | mex | |
| SCH545 | SC Swap | 09/10/2020 | Buy | A | mex | 3,000,000 | mex | 3,000,000 | mex | |
| SCH571 | SC Swap | 09/10/2020 | Buy | A | mex | 3,000,000 | mex | 3,000,000 | mex | |
| SV8690 | SC Swap | 12/10/2020 | Buy | A | mex | 3,200,000 | mex | 3,200,000 | mex | |
| SV8699 | SC Swap | 12/10/2020 | Buy | A | mex | 3,200,000 | mex | 3,200,000 | mex | |
| SCK442 | SC Swap | 12/10/2020 | Buy | A | mex | 4,000,000,000 | mex | 4,000,000,000 | mex | |
| SU7164 | SC Swap | 15/10/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SU7210 | SC Swap | 15/10/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SU7347 | SC Swap | 15/10/2020 | Buy | A | usm | 1,127,300 | usm | 1,127,300 | usm | |
| SU9718 | SC Swap | 15/10/2020 | Buy | A | usm | 1,127,300 | usm | 1,127,300 | usm | |
| SBN234 | SC Swap | 15/10/2020 | Buy | A | mex | 410,000,000 | mex | 410,000,000 | mex | |
| SU4949 | SC Swap | 16/10/2020 | Buy | A | mex | 60,000,000 | mex | 60,000,000 | mex | |
| SU7228 | SC Swap | 16/10/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU5107 | SC Swap | 20/10/2020 | Buy | A | mex | 1,267,000,000 | mex | 1,267,000,000 | mex | |
| SU6166 | SC Swap | 20/10/2020 | Buy | A | mex | 64,772,186 | mex | 64,772,186 | mex | |
| SU9676 | SC Swap | 20/10/2020 | Buy | A | mex | 64,772,186 | mex | 64,772,186 | mex | |
| SBN958 | SC Swap | 22/10/2020 | Buy | A | mex | 435,000,000 | mex | 435,000,000 | mex | |
| SCL506 | SC Swap | 23/10/2020 | Buy | A | mex | 3,800,000,000 | mex | 3,800,000,000 | mex | |
| SAB559 | SC Swap | 25/10/2020 | Buy | A | mex | 1,000,000,000 | mex | 1,000,000,000 | mex | |
| SAB592 | SC Swap | 25/10/2020 | Buy | A | mex | 1,000,000,000 | mex | 1,000,000,000 | mex | |
| SAB654 | SC Swap | 25/10/2020 | Buy | A | mex | 1,000,000,000 | mex | 1,000,000,000 | mex | |
| SW0373 | SC Swap | 26/10/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SW0546 | SC Swap | 26/10/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SCE216 | SC Swap | 26/10/2020 | Buy | A | mex | 780,000,000 | mex | 780,000,000 | mex | |
| SU7364 | SC Swap | 28/10/2020 | Buy | A | mex | 370,000,000 | mex | 370,000,000 | mex | |
| SU7376 | SC Swap | 28/10/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU8436 | SC Swap | 29/10/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU8452 | SC Swap | 29/10/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU8459 | SC Swap | 29/10/2020 | Buy | A | mex | 50,000,000 | mex | 50,000,000 | mex | |
| SU8466 | SC Swap | 29/10/2020 | Buy | A | mex | 50,000,000 | mex | 50,000,000 | mex | |
| SU8546 | SC Swap | 29/10/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SAC249 | SC Swap | 29/10/2020 | Buy | A | mex | 20,000,000 | mex | 20,000,000 | mex | |
| SAC353 | SC Swap | 29/10/2020 | Buy | A | mex | 20,000,000 | mex | 20,000,000 | mex | |
| SCL908 | SC Swap | 29/10/2020 | Buy | A | mex | 3,870,000,000 | mex | 3,870,000,000 | mex | |
| SU7318 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 15,000,000 | mex | 15,000,000 | mex | |
| SU7538 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU7559 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU8165 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU9571 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 15,000,000 | mex | 15,000,000 | mex | |
| SW0908 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 450,000,000 | mex | 450,000,000 | mex | |
| SW3500 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 3,000,000 | mex | 3,000,000 | mex | |
| SW3503 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 3,000,000 | mex | 3,000,000 | mex | |

| TransID | ProductID | MaturityDate | Buy/Sell Flag | Trans Status | Base CurID | PaySide Notional | PaySide CurID | RcvSide Notional | RcvSide CurID | Option Notional |
|---------|-----------|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| SW4030 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 10,000,000 | mex | 10,000,000 | mex | |
| SW4033 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 10,000,000 | mex | 10,000,000 | mex | |
| SW9551 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 10,000,000 | mex | 10,000,000 | mex | |
| SW9583 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 10,000,000 | mex | 10,000,000 | mex | |
| SX5047 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 9,000,000 | mex | 9,000,000 | mex | |
| SX5077 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 9,000,000 | mex | 9,000,000 | mex | |
| SY1607 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 20,604,846 | mex | 20,604,846 | mex | |
| SY1622 | SC Swap | 30/10/2020 | Buy | A | mex | 20,604,846 | mex | 20,604,846 | mex | |
| SU7617 | SC Swap | 02/11/2020 | Buy | A | mex | 180,000,000 | mex | 180,000,000 | mex | |
| SU5142 | SC Swap | 03/11/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU6448 | SC Swap | 03/11/2020 | Buy | A | mex | 180,000,000 | mex | 180,000,000 | mex | |
| SBF086 | SC Swap | 03/11/2020 | Buy | A | mex | 2,000,000,000 | mex | 2,000,000,000 | mex | |
| SAC839 | SC Swap | 05/11/2020 | Buy | A | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| SBF465 | SC Swap | 06/11/2020 | Buy | A | mex | 590,000,000 | mex | 590,000,000 | mex | |
| SBF504 | SC Swap | 06/11/2020 | Buy | A | mex | 590,000,000 | mex | 590,000,000 | mex | |
| SCG363 | SC Swap | 06/11/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SCG388 | SC Swap | 06/11/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU8868 | SC Swap | 09/11/2020 | Buy | A | mex | 29,000,000 | mex | 29,000,000 | mex | |
| SU9601 | SC Swap | 09/11/2020 | Buy | A | mex | 29,000,000 | mex | 29,000,000 | mex | |
| SV4060 | SC Swap | 09/11/2020 | Buy | A | mex | 116,000,000 | mex | 116,000,000 | mex | |
| SCE330 | SC Swap | 09/11/2020 | Buy | A | mex | 116,000,000 | mex | 116,000,000 | mex | |
| SCE416 | SC Swap | 09/11/2020 | Buy | A | mex | 116,000,000 | mex | 116,000,000 | mex | |
| SU5016 | SC Swap | 10/11/2020 | Buy | A | mex | 400,000,000 | mex | 400,000,000 | mex | |
| SU8237 | SC Swap | 10/11/2020 | Buy | A | mex | 400,000,000 | mex | 400,000,000 | mex | |
| SU8567 | SC Swap | 10/11/2020 | Buy | A | mex | 180,000,000 | mex | 180,000,000 | mex | |
| SW4966 | SC Swap | 10/11/2020 | Buy | A | mex | 4,116,593 | mex | 4,116,593 | mex | |
| SW4975 | SC Swap | 10/11/2020 | Buy | A | mex | 4,116,593 | mex | 4,116,593 | mex | |
| SBF909 | SC Swap | 11/11/2020 | Buy | A | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| SCM922 | SC Swap | 11/11/2020 | Buy | A | mex | 960,000,000 | mex | 960,000,000 | mex | |
| SW3495 | SC Swap | 12/11/2020 | Buy | A | mex | 120,000,000 | mex | 120,000,000 | mex | |
| SW8981 | SC Swap | 13/11/2020 | Buy | A | mex | 28,333,333 | mex | 28,333,333 | mex | |
| SW8982 | SC Swap | 13/11/2020 | Buy | A | mex | 28,333,333 | mex | 28,333,333 | mex | |
| SCG094 | SC Swap | 13/11/2020 | Buy | A | mex | 1,445,000,000 | mex | 1,445,000,000 | mex | |
| SAD731 | SC Swap | 17/11/2020 | Buy | A | mex | 500,000,000 | mex | 500,000,000 | mex | |
| SBU850 | SC Swap | 17/11/2020 | Buy | A | mex | 635,000,000 | mex | 635,000,000 | mex | |
| SCH521 | SC Swap | 17/11/2020 | Buy | A | mex | 500,000,000 | mex | 500,000,000 | mex | |
| SCH527 | SC Swap | 17/11/2020 | Buy | A | mex | 500,000,000 | mex | 500,000,000 | mex | |
| SCN426 | SC Swap | 18/11/2020 | Buy | A | mex | 2,900,000,000 | mex | 2,900,000,000 | mex | |
| SU8037 | SC Swap | 19/11/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU8623 | SC Swap | 20/11/2020 | Buy | A | mex | 50,000,000 | mex | 50,000,000 | mex | |
| SCF596 | SC Swap | 20/11/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SCF599 | SC Swap | 20/11/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SCU791 | SC Swap | 20/11/2020 | Buy | A | usm | 1,756,705 | usm | 1,756,705 | usm | |
| SCU794 | SC Swap | 20/11/2020 | Buy | A | usm | 1,055,846 | usm | 1,055,846 | usm | |

| TransID | ProductID | MaturityDate | Buy/Sell Flag | Trans Status | Base CurID | PaySide Notional | PaySide CurID | RcvSide Notional | RcvSide CurID | Option Notional |
|---------|-----------|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| SCU795 | SC Swap | 20/11/2020 | Buy | A | usm | 839,908 | usm | 839,908 | usm | |
| SCU875 | SC Swap | 20/11/2020 | Buy | A | usm | 1,756,705 | usm | 1,756,705 | usm | |
| SCU877 | SC Swap | 20/11/2020 | Buy | A | usm | 1,055,846 | usm | 1,055,846 | usm | |
| SCU878 | SC Swap | 20/11/2020 | Buy | A | usm | 839,908 | usm | 839,908 | usm | |
| SU8312 | SC Swap | 25/11/2020 | Buy | A | mex | 320,000,000 | mex | 320,000,000 | mex | |
| SBH203 | SC Swap | 25/11/2020 | Buy | A | mex | 400,000,000 | mex | 400,000,000 | mex | |
| SU8333 | SC Swap | 26/11/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU8361 | SC Swap | 26/11/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU9094 | SC Swap | 26/11/2020 | Buy | A | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| SW3653 | SC Swap | 26/11/2020 | Buy | A | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| SW3687 | SC Swap | 26/11/2020 | Buy | A | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| SAE451 | SC Swap | 26/11/2020 | Buy | A | mex | 160,000,000 | mex | 160,000,000 | mex | |
| SBH409 | SC Swap | 26/11/2020 | Buy | A | mex | 400,000,000 | mex | 400,000,000 | mex | |
| SW3068 | SC Swap | 27/11/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SW3078 | SC Swap | 27/11/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SW4402 | SC Swap | 27/11/2020 | Buy | A | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| SCO549 | SC Swap | 27/11/2020 | Buy | A | mex | 10,000,000 | mex | 10,000,000 | mex | |
| SU7367 | SC Swap | 29/11/2020 | Buy | A | usm | 1,527,794 | usm | 1,527,794 | usm | |
| SU9726 | SC Swap | 29/11/2020 | Buy | A | usm | 1,527,794 | usm | 1,527,794 | usm | |
| SU8419 | SC Swap | 01/12/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SU8434 | SC Swap | 01/12/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU8448 | SC Swap | 01/12/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SBH713 | SC Swap | 01/12/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SBH721 | SC Swap | 01/12/2020 | Buy | A | mex | 400,000,000 | mex | 400,000,000 | mex | |
| SU8455 | SC Swap | 02/12/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SBX404 | SC Swap | 03/12/2020 | Buy | A | mex | 890,000,000 | mex | 890,000,000 | mex | |
| SW4038 | SC Swap | 04/12/2020 | Buy | A | mex | 18,000,000 | mex | 18,000,000 | mex | |
| SW4050 | SC Swap | 04/12/2020 | Buy | A | mex | 18,000,000 | mex | 18,000,000 | mex | |
| SBI198 | SC Swap | 04/12/2020 | Buy | A | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| SU8647 | SC Swap | 07/12/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU8676 | SC Swap | 07/12/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SU9131 | SC Swap | 07/12/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SBI859 | SC Swap | 07/12/2020 | Buy | A | mex | 5,000,000 | mex | 5,000,000 | mex | |
| SBI863 | SC Swap | 07/12/2020 | Buy | A | mex | 5,000,000 | mex | 5,000,000 | mex | |
| SU8690 | SC Swap | 08/12/2020 | Buy | A | mex | 60,000,000 | mex | 60,000,000 | mex | |
| SCI452 | SC Swap | 08/12/2020 | Buy | A | mex | 490,000,000 | mex | 490,000,000 | mex | |
| SCD771 | SC Swap | 09/12/2020 | Buy | A | mex | 700,000,000 | mex | 700,000,000 | mex | |
| SU8794 | SC Swap | 10/12/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU8817 | SC Swap | 10/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU8823 | SC Swap | 10/12/2020 | Buy | A | mex | 80,000,000 | mex | 80,000,000 | mex | |
| SAF528 | SC Swap | 10/12/2020 | Buy | A | usm | 205,440 | usm | 205,440 | usm | |
| SAF529 | SC Swap | 10/12/2020 | Buy | A | usm | 141,365 | usm | 141,365 | usm | |
| SAF561 | SC Swap | 10/12/2020 | Buy | A | usm | 205,440 | usm | 205,440 | usm | |
| SAF562 | SC Swap | 10/12/2020 | Buy | A | usm | 141,365 | usm | 141,365 | usm | |

| TransID | ProductID | MaturityDate | Buy/Sell Flag | Trans Status | Base CurID | PaySide Notional | PaySide CurID | RcvSide Notional | RcvSide CurID | Option Notional |
|---------|-----------|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| SCI751 | SC Swap | 10/12/2020 | Buy | A | mex | 193,000,000 | mex | 193,000,000 | mex | |
| SU8848 | SC Swap | 11/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU9143 | SC Swap | 11/12/2020 | Buy | A | mex | 430,000,000 | mex | 430,000,000 | mex | |
| SU9160 | SC Swap | 11/12/2020 | Buy | A | mex | 330,000,000 | mex | 330,000,000 | mex | |
| SBZ662 | SC Swap | 11/12/2020 | Buy | A | usm | 7,300,000 | usm | 7,300,000 | usm | |
| SBZ666 | SC Swap | 11/12/2020 | Buy | A | usm | 7,300,000 | usm | 7,300,000 | usm | |
| SU9166 | SC Swap | 15/12/2020 | Buy | A | mex | 190,000,000 | mex | 190,000,000 | mex | |
| SU8951 | SC Swap | 16/12/2020 | Buy | A | mex | 385,000,000 | mex | 385,000,000 | mex | |
| SU8977 | SC Swap | 16/12/2020 | Buy | A | mex | 710,000,000 | mex | 710,000,000 | mex | |
| SU9190 | SC Swap | 16/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU5150 | SC Swap | 17/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU9024 | SC Swap | 17/12/2020 | Buy | A | mex | 390,000,000 | mex | 390,000,000 | mex | |
| SU9042 | SC Swap | 17/12/2020 | Buy | A | mex | 150,000,000 | mex | 150,000,000 | mex | |
| SU9065 | SC Swap | 17/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SBJ668 | SC Swap | 18/12/2020 | Buy | A | mex | 195,000,000 | mex | 195,000,000 | mex | |
| SBJ853 | SC Swap | 21/12/2020 | Buy | A | mex | 600,000,000 | mex | 600,000,000 | mex | |
| SCT096 | SC Swap | 21/12/2020 | Buy | A | mex | 32,500,000 | mex | 32,500,000 | mex | |
| SCT107 | SC Swap | 21/12/2020 | Buy | A | mex | 32,500,000 | mex | 32,500,000 | mex | |
| SW5867 | SC Swap | 22/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SW5883 | SC Swap | 22/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SCJ026 | SC Swap | 22/12/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SCJ038 | SC Swap | 22/12/2020 | Buy | A | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |
| SU8119 | SC Swap | 23/12/2020 | Buy | A | mex | 14,000,000 | mex | 14,000,000 | mex | |
| SU9777 | SC Swap | 23/12/2020 | Buy | A | mex | 14,000,000 | mex | 14,000,000 | mex | |
| SV4063 | SC Swap | 23/12/2020 | Buy | A | mex | 211,552,608 | mex | 211,552,608 | mex | |
| SCR342 | SC Swap | 23/12/2020 | Buy | A | mex | 162,732,263 | mex | 162,732,263 | mex | |
| SCR345 | SC Swap | 23/12/2020 | Buy | A | mex | 162,732,263 | mex | 162,732,263 | mex | |
| SW5921 | SC Swap | 25/12/2020 | Buy | A | mex | 180,000,000 | mex | 180,000,000 | mex | |
| SW5953 | SC Swap | 25/12/2020 | Buy | A | mex | 180,000,000 | mex | 180,000,000 | mex | |
| SAL590 | SC Swap | 29/12/2020 | Buy | A | mex | 10,433,648 | mex | 10,433,648 | mex | |
| SAL610 | SC Swap | 29/12/2020 | Buy | A | mex | 10,433,648 | mex | 10,433,648 | mex | |
| SBK057 | SC Swap | 29/12/2020 | Buy | A | mex | 194,000,000 | mex | 194,000,000 | mex | |
| SU4873 | SC Swap | 30/12/2020 | Buy | A | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| SU4896 | SC Swap | 30/12/2020 | Buy | A | mex | 150,000,000 | mex | 150,000,000 | mex | |
| SU4905 | SC Swap | 30/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU4939 | SC Swap | 30/12/2020 | Buy | A | mex | 50,000,000 | mex | 50,000,000 | mex | |
| SU5006 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU5085 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 100,000,000 | mex | 100,000,000 | mex | |
| SU5137 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | usm | 500,000 | usm | 500,000 | usm | |
| SU6060 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | usm | 2,000,000 | usm | 2,000,000 | usm | |

| TransID | ProductID | MaturityDate | Buy/Sell Flag | Trans Status | Base CurID | PaySide Notional | PaySide CurID | RcvSide Notional | RcvSide CurID | Option Notional |
|---------|--------------|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| SU6210 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 22,284,211 | mex | 22,284,211 | mex | |
| SU6261 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 3,000,000 | mex | 3,000,000 | mex | |
| SU6683 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 10,000,000 | mex | 10,000,000 | mex | |
| SU7515 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 7,000,000 | mex | 7,000,000 | mex | |
| SU9677 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | usm | 2,000,000 | usm | 2,000,000 | usm | |
| SU9678 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 22,284,211 | mex | 22,284,211 | mex | |
| SU9681 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 3,000,000 | mex | 3,000,000 | mex | |
| SU9699 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 10,000,000 | mex | 10,000,000 | mex | |
| SU9735 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | usm | 500,000 | usm | 500,000 | usm | |
| SU9761 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 7,000,000 | mex | 7,000,000 | mex | |
| SW2736 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | usm | 2,000,000 | usm | 2,000,000 | usm | |
| SW2745 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | usm | 2,000,000 | usm | 2,000,000 | usm | |
| SW9236 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | usm | 1,028,000 | usm | 1,028,000 | usm | |
| SW9270 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | usm | 1,028,000 | usm | 1,028,000 | usm | |
| SAH538 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 750,000 | mex | 750,000 | mex | |
| SAH575 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 750,000 | mex | 750,000 | mex | |
| SAV943 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 457,052 | mex | 457,052 | mex | |
| SAV972 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 457,052 | mex | 457,052 | mex | |
| SCV899 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | A | mex | 70,000,000 | mex | 70,000,000 | mex | |
| MV8684 | Term Deposit | 25/10/2020 | Buy | A | mex | 1,000,000,000 | mex | 1,000,000,000 | mex | |
| MGZ571 | Term Deposit | 09/11/2020 | Buy | A | mex | 116,000,000 | mex | 116,000,000 | mex | |
| MO1781 | Term Deposit | 26/11/2020 | Buy | A | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| MN1857 | Term Deposit | 23/12/2020 | Buy | A | mex | 211,552,608 | mex | 211,552,608 | mex | |
| MJF373 | Term Deposit | 23/12/2020 | Buy | A | mex | 211,552,608 | mex | 211,552,608 | mex | |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067342 | FX | 25,000 | 01-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067344 | FX | 25,000 | 01-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067381 | FX | 25,000 | 01-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067383 | FX | 25,000 | 01-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068264 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068265 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068282 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068283 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068300 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068301 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068302 | FX | 8,188 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068348 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068349 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068350 | FX | 8,188 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068453 | FX | 200,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068454 | FX | 200,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2068455 | FX | 8,989 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068481 | FX | 200,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068482 | FX | 200,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068483 | FX | 8,989 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068508 | FX | 200,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068509 | FX | 200,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068535 | FX | 200,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068536 | FX | 200,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068973 | FX | 250,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068974 | FX | 250,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068991 | FX | 250,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068992 | FX | 250,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069009 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069010 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069027 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069028 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069045 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069046 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069047 | FX | 10,011 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069069 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069070 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069071 | FX | 10,011 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059857 | FX | 25,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059877 | FX | 25,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062635 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062637 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062638 | FX | 5,185 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062793 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062795 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062796 | FX | 5,185 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063409 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063411 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063412 | FX | 7,286 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063481 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063483 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063484 | FX | 7,286 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065369 | FX | 50,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065371 | FX | 50,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065372 | FX | 5,306 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065417 | FX | 50,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065419 | FX | 50,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065420 | FX | 5,306 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065737 | FX | 555,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065739 | FX | 555,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065740 | FX | 66,600 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065788 | FX | 500,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065790 | FX | 500,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065791 | FX | 60,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065836 | FX | 50,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065838 | FX | 50,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2065839 | FX | 6,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065884 | FX | 5,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065886 | FX | 5,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065887 | FX | 600 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066074 | FX | 15,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066086 | FX | 15,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066898 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066918 | FX | 100,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067000 | FX | 40,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067002 | FX | 40,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067030 | FX | 40,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067032 | FX | 40,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067098 | FX | 60,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067118 | FX | 60,000 | 05-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059499 | FX | 50,000 | 06-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059611 | FX | 50,000 | 06-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066712 | FX | 50,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066713 | FX | 50,000 | 06-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066714 | FX | 50,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066751 | FX | 50,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066752 | FX | 50,000 | 06-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066753 | FX | 50,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067250 | FX | 200,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067252 | FX | 200,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067253 | FX | 11,304 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067302 | FX | 200,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067304 | FX | 200,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067305 | FX | 11,304 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067952 | FX | 250,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067953 | FX | 250,000 | 06-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067954 | FX | 250,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068046 | FX | 250,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068047 | FX | 250,000 | 06-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068048 | FX | 250,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068240 | FX | 500,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068241 | FX | 500,000 | 06-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068242 | FX | 500,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068252 | FX | 500,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068253 | FX | 500,000 | 06-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068254 | FX | 500,000 | 06-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065659 | FX | 50,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065660 | FX | 50,000 | 07-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065661 | FX | 50,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065695 | FX | 50,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065696 | FX | 50,000 | 07-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065697 | FX | 50,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066239 | FX | 2,734,281 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066241 | FX | 2,734,281 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066245 | FX | 2,734,281 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066247 | FX | 2,734,281 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067589 | FX | 20,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067661 | FX | 20,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067697 | FX | 20,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067699 | FX | 20,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067745 | FX | 20,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067747 | FX | 20,000 | 07-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060572 | FX | 1,000,000 | 08-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060620 | FX | 1,000,000 | 08-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065099 | FX | 70,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065101 | FX | 70,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065120 | FX | 70,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065122 | FX | 70,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067345 | FX | 25,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067347 | FX | 25,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067384 | FX | 25,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067386 | FX | 25,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068201 | FX | 300,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068202 | FX | 300,000 | 08-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068203 | FX | 300,000 | 08-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068204 | FX | 300,000 | 08-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2058962 | FX | 500,000 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059010 | FX | 500,000 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062639 | FX | 100,000 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062641 | FX | 100,000 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062642 | FX | 5,185 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062797 | FX | 100,000 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062799 | FX | 100,000 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062800 | FX | 5,185 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063414 | FX | 100,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063415 | FX | 100,000 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063416 | FX | 7,286 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063486 | FX | 100,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063487 | FX | 100,000 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063488 | FX | 7,286 | 09-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2064753 | FX | 200,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2064754 | FX | 200,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065373 | FX | 50,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065375 | FX | 50,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065376 | FX | 5,306 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065421 | FX | 50,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065423 | FX | 50,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065424 | FX | 5,306 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065741 | FX | 555,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065743 | FX | 555,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065744 | FX | 66,600 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065792 | FX | 500,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065794 | FX | 500,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065795 | FX | 60,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065840 | FX | 50,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065842 | FX | 50,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2065843 | FX | 6,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065888 | FX | 5,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065890 | FX | 5,000 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065891 | FX | 600 | 09-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059063 | FX | 40,285 | 13-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059087 | FX | 40,285 | 13-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065058 | FX | 50,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065060 | FX | 50,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065061 | FX | 3,646 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065078 | FX | 50,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065080 | FX | 50,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065081 | FX | 3,646 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066162 | FX | 100,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066164 | FX | 100,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066183 | FX | 100,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066185 | FX | 100,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066484 | FX | 250,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066661 | FX | 250,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066715 | FX | 50,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066717 | FX | 50,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066754 | FX | 50,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066756 | FX | 50,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067254 | FX | 200,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067256 | FX | 200,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067257 | FX | 11,304 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067306 | FX | 200,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067308 | FX | 200,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067309 | FX | 11,304 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067955 | FX | 250,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067957 | FX | 250,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068049 | FX | 250,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068051 | FX | 250,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068243 | FX | 500,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068245 | FX | 500,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068255 | FX | 500,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068257 | FX | 500,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069537 | FX | 800,000 | 13-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069538 | FX | 800,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069543 | FX | 800,000 | 13-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069544 | FX | 800,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067591 | FX | 20,000 | 14-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067663 | FX | 20,000 | 14-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067700 | FX | 20,000 | 14-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067702 | FX | 20,000 | 14-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067748 | FX | 20,000 | 14-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067750 | FX | 20,000 | 14-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067348 | FX | 25,000 | 15-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067350 | FX | 25,000 | 15-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067387 | FX | 25,000 | 15-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067389 | FX | 25,000 | 15-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2059859 | FX | 25,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059879 | FX | 25,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062643 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062645 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062646 | FX | 5,185 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062801 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062803 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062804 | FX | 5,185 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063418 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063419 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063420 | FX | 7,286 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063490 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063491 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063492 | FX | 7,286 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065377 | FX | 50,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065379 | FX | 50,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065380 | FX | 5,306 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065425 | FX | 50,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065427 | FX | 50,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065428 | FX | 5,306 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065745 | FX | 555,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065747 | FX | 555,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065748 | FX | 66,600 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065796 | FX | 500,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065798 | FX | 500,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065799 | FX | 60,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065844 | FX | 50,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065846 | FX | 50,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065847 | FX | 6,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065892 | FX | 5,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065894 | FX | 5,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065895 | FX | 600 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066033 | FX | 37,255 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066035 | FX | 37,255 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066036 | FX | 2,585 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066049 | FX | 37,255 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066051 | FX | 37,255 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066052 | FX | 2,585 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066057 | FX | 26,615 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066059 | FX | 26,615 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066060 | FX | 1,955 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066065 | FX | 26,615 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066067 | FX | 26,615 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066068 | FX | 1,955 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066075 | FX | 15,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066087 | FX | 15,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066900 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066920 | FX | 100,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067003 | FX | 40,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067005 | FX | 40,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067033 | FX | 40,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067035 | FX | 40,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067100 | FX | 60,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067120 | FX | 60,000 | 19-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059503 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059615 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060183 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060207 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065487 | FX | 200,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065489 | FX | 200,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065496 | FX | 200,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065498 | FX | 200,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066718 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066720 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066757 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066759 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067258 | FX | 200,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067260 | FX | 200,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067261 | FX | 11,304 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067310 | FX | 200,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067312 | FX | 200,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067313 | FX | 11,304 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067617 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067619 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067620 | FX | 2,729 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067637 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067639 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067640 | FX | 2,729 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067958 | FX | 250,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067960 | FX | 250,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068015 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068017 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068018 | FX | 2,882 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068052 | FX | 250,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068054 | FX | 250,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068089 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068091 | FX | 50,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068092 | FX | 2,882 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068246 | FX | 500,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068248 | FX | 500,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068258 | FX | 500,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068260 | FX | 500,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069540 | FX | 800,000 | 20-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069541 | FX | 800,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069546 | FX | 800,000 | 20-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069547 | FX | 800,000 | 20-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065662 | FX | 50,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065664 | FX | 50,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065698 | FX | 50,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065700 | FX | 50,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067593 | FX | 20,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067665 | FX | 20,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067703 | FX | 20,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067705 | FX | 20,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067751 | FX | 20,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067753 | FX | 20,000 | 21-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067351 | FX | 25,000 | 22-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067353 | FX | 25,000 | 22-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067390 | FX | 25,000 | 22-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067392 | FX | 25,000 | 22-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062647 | FX | 100,000 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062649 | FX | 100,000 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062650 | FX | 5,185 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062805 | FX | 100,000 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062807 | FX | 100,000 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062808 | FX | 5,185 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063422 | FX | 100,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063423 | FX | 100,000 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063424 | FX | 7,286 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063494 | FX | 100,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063495 | FX | 100,000 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063496 | FX | 7,286 | 26-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065381 | FX | 50,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065383 | FX | 50,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065384 | FX | 5,306 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065429 | FX | 50,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065431 | FX | 50,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065432 | FX | 5,306 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065749 | FX | 555,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065751 | FX | 555,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065752 | FX | 66,600 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065800 | FX | 500,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065802 | FX | 500,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065803 | FX | 60,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065848 | FX | 50,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065850 | FX | 50,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065851 | FX | 6,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065896 | FX | 5,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065898 | FX | 5,000 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065899 | FX | 600 | 26-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060186 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060210 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066721 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066723 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066760 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066762 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067262 | FX | 200,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067264 | FX | 200,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067265 | FX | 11,304 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067314 | FX | 200,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067316 | FX | 200,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067317 | FX | 11,304 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067445 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067447 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067448 | FX | 2,826 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067465 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067467 | FX | 50,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067468 | FX | 2,826 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067961 | FX | 250,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067963 | FX | 250,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068055 | FX | 250,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068057 | FX | 250,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069530 | FX | 1,000,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069531 | FX | 1,000,000 | 27-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069532 | FX | 1,000,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069533 | FX | 1,000,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069534 | FX | 1,000,000 | 27-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069535 | FX | 1,000,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069549 | FX | 40,000 | 27-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069550 | FX | 40,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069551 | FX | 2,262 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069573 | FX | 40,000 | 27-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069574 | FX | 40,000 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069575 | FX | 2,262 | 27-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060264 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060291 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060396 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060468 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2064555 | FX | 100,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066012 | FX | 100,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066216 | FX | 500,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066218 | FX | 500,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066225 | FX | 500,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066227 | FX | 500,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066254 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066256 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066309 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066311 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066326 | FX | 500,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066328 | FX | 500,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066329 | FX | 27,851 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066346 | FX | 500,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066348 | FX | 500,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066349 | FX | 27,851 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066392 | FX | 400,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066402 | FX | 400,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066523 | FX | 200,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066525 | FX | 200,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066538 | FX | 200,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066540 | FX | 200,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2066591 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066601 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066615 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066617 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066618 | FX | 25,840 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066635 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066637 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066638 | FX | 25,840 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067170 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067172 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067173 | FX | 14,130 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067186 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067188 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067189 | FX | 14,130 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067226 | FX | 400,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067228 | FX | 400,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067229 | FX | 24,295 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067234 | FX | 400,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067236 | FX | 400,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067237 | FX | 24,295 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067595 | FX | 20,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067667 | FX | 20,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067706 | FX | 20,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067708 | FX | 20,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067754 | FX | 20,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067756 | FX | 20,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069269 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069270 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069271 | FX | 15,837 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069285 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069286 | FX | 250,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069287 | FX | 15,837 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069899 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069901 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069902 | FX | 32,365 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069935 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069937 | FX | 300,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069938 | FX | 32,365 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065102 | FX | 70,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065104 | FX | 70,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065123 | FX | 70,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065125 | FX | 70,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067354 | FX | 25,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067356 | FX | 25,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067393 | FX | 25,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067395 | FX | 25,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068145 | FX | 50,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068147 | FX | 50,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068172 | FX | 50,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068174 | FX | 50,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2068205 | FX | 300,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068206 | FX | 300,000 | 29-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068207 | FX | 300,000 | 29-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068208 | FX | 300,000 | 29-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062651 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062653 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062654 | FX | 5,185 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062809 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062811 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062812 | FX | 5,185 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063426 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063427 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063428 | FX | 7,286 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063498 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063499 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063500 | FX | 7,286 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065385 | FX | 50,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065387 | FX | 50,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065388 | FX | 5,306 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065433 | FX | 50,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065435 | FX | 50,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065436 | FX | 5,306 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065753 | FX | 555,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065755 | FX | 555,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065756 | FX | 66,600 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065804 | FX | 500,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065806 | FX | 500,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065807 | FX | 60,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065852 | FX | 50,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065854 | FX | 50,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065855 | FX | 6,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065900 | FX | 5,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065902 | FX | 5,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065903 | FX | 600 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066902 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066922 | FX | 100,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067006 | FX | 40,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067008 | FX | 40,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067036 | FX | 40,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067038 | FX | 40,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067102 | FX | 60,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067122 | FX | 60,000 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068732 | FX | 32,500 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068734 | FX | 32,500 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068771 | FX | 32,500 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068773 | FX | 32,500 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068810 | FX | 32,500 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068812 | FX | 32,500 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068849 | FX | 32,500 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068851 | FX | 32,500 | 30-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2059507 | FX | 50,000 | 03-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059619 | FX | 50,000 | 03-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066724 | FX | 50,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066726 | FX | 50,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066763 | FX | 50,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066765 | FX | 50,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067266 | FX | 200,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067268 | FX | 200,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067269 | FX | 11,304 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067318 | FX | 200,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067320 | FX | 200,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067321 | FX | 11,304 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067781 | FX | 150,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067783 | FX | 150,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067805 | FX | 150,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067807 | FX | 150,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067964 | FX | 250,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067966 | FX | 250,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068058 | FX | 250,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068060 | FX | 250,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068912 | FX | 400,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068913 | FX | 400,000 | 03-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068914 | FX | 400,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068933 | FX | 400,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068934 | FX | 400,000 | 03-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068935 | FX | 400,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069714 | FX | 250,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069715 | FX | 250,000 | 03-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069753 | FX | 250,000 | 03-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069754 | FX | 250,000 | 03-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065665 | FX | 50,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065667 | FX | 50,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065701 | FX | 50,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065703 | FX | 50,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066076 | FX | 15,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066088 | FX | 15,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067597 | FX | 20,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067669 | FX | 20,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067709 | FX | 20,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067711 | FX | 20,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067757 | FX | 20,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067759 | FX | 20,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068266 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068268 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068284 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068286 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068303 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068305 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068306 | FX | 8,188 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068351 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2068353 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068354 | FX | 8,188 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068456 | FX | 200,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068458 | FX | 200,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068459 | FX | 8,989 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068484 | FX | 200,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068486 | FX | 200,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068487 | FX | 8,989 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068510 | FX | 200,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068512 | FX | 200,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068537 | FX | 200,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068539 | FX | 200,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068975 | FX | 250,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068976 | FX | 250,000 | 04-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068977 | FX | 250,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068993 | FX | 250,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068994 | FX | 250,000 | 04-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068995 | FX | 250,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069011 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069013 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069029 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069031 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069048 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069050 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069051 | FX | 10,011 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069072 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069074 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069075 | FX | 10,011 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067357 | FX | 25,000 | 05-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067359 | FX | 25,000 | 05-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067396 | FX | 25,000 | 05-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067398 | FX | 25,000 | 05-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070288 | FX | 30,000 | 05-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070301 | FX | 30,000 | 05-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059861 | FX | 25,000 | 06-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059881 | FX | 25,000 | 06-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066508 | FX | 1,640,608 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066510 | FX | 1,640,608 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066514 | FX | 1,640,608 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066516 | FX | 1,640,608 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066879 | FX | 400,433 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066881 | FX | 400,433 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066888 | FX | 400,433 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066890 | FX | 400,433 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067198 | FX | 816,416 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067200 | FX | 816,416 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067204 | FX | 816,416 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067206 | FX | 816,416 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068148 | FX | 50,000 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068150 | FX | 50,000 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2068175 | FX | 50,000 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068177 | FX | 50,000 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068735 | FX | 32,500 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068737 | FX | 32,500 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068774 | FX | 32,500 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068776 | FX | 32,500 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068813 | FX | 32,500 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068815 | FX | 32,500 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068852 | FX | 32,500 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068854 | FX | 32,500 | 06-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062655 | FX | 100,000 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062657 | FX | 100,000 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062658 | FX | 5,185 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062813 | FX | 100,000 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062815 | FX | 100,000 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062816 | FX | 5,185 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063430 | FX | 100,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063431 | FX | 100,000 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063432 | FX | 7,286 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063502 | FX | 100,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063503 | FX | 100,000 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063504 | FX | 7,286 | 09-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065389 | FX | 50,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065391 | FX | 50,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065392 | FX | 5,306 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065437 | FX | 50,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065439 | FX | 50,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065440 | FX | 5,306 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065757 | FX | 555,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065759 | FX | 555,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065760 | FX | 66,600 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065808 | FX | 500,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065810 | FX | 500,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065811 | FX | 60,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065856 | FX | 50,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065858 | FX | 50,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065859 | FX | 6,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065904 | FX | 5,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065906 | FX | 5,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065907 | FX | 600 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067784 | FX | 150,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067786 | FX | 150,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067808 | FX | 150,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067810 | FX | 150,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067967 | FX | 250,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067969 | FX | 250,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068061 | FX | 250,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068063 | FX | 250,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068915 | FX | 400,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068917 | FX | 400,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2068936 | FX | 400,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068938 | FX | 400,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069717 | FX | 250,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069756 | FX | 250,000 | 09-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059064 | FX | 38,309 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059065 | FX | 38,309 | 10-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059088 | FX | 38,309 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059089 | FX | 38,309 | 10-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060576 | FX | 1,000,000 | 10-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060624 | FX | 1,000,000 | 10-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066727 | FX | 50,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066729 | FX | 50,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066766 | FX | 50,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066768 | FX | 50,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067270 | FX | 200,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067272 | FX | 200,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067273 | FX | 11,304 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067322 | FX | 200,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067324 | FX | 200,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067325 | FX | 11,304 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067599 | FX | 20,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067671 | FX | 20,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067712 | FX | 20,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067714 | FX | 20,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067760 | FX | 20,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067762 | FX | 20,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2058966 | FX | 500,000 | 12-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059014 | FX | 500,000 | 12-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066486 | FX | 250,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066663 | FX | 250,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067360 | FX | 25,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067362 | FX | 25,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067399 | FX | 25,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067401 | FX | 25,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067428 | FX | 375,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067430 | FX | 375,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067434 | FX | 375,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067436 | FX | 375,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068151 | FX | 50,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068153 | FX | 50,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068178 | FX | 50,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068180 | FX | 50,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070289 | FX | 30,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070302 | FX | 30,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062659 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062661 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062662 | FX | 5,185 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062817 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062819 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062820 | FX | 5,185 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2063434 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063435 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063436 | FX | 7,286 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063506 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063507 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063508 | FX | 7,286 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065761 | FX | 555,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065763 | FX | 555,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065764 | FX | 66,600 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065812 | FX | 500,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065814 | FX | 500,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065815 | FX | 60,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065860 | FX | 50,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065862 | FX | 50,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065863 | FX | 6,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065908 | FX | 5,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065910 | FX | 5,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065911 | FX | 600 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066904 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066924 | FX | 100,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067009 | FX | 40,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067011 | FX | 40,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067039 | FX | 40,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067041 | FX | 40,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067104 | FX | 60,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067124 | FX | 60,000 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068738 | FX | 32,500 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068740 | FX | 32,500 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068777 | FX | 32,500 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068779 | FX | 32,500 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068816 | FX | 32,500 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068818 | FX | 32,500 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068855 | FX | 32,500 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068857 | FX | 32,500 | 13-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059511 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059623 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060189 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060213 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065062 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065064 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065065 | FX | 3,646 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065082 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065084 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065085 | FX | 3,646 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066165 | FX | 100,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066167 | FX | 100,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066186 | FX | 100,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066188 | FX | 100,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067274 | FX | 200,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067276 | FX | 200,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067277 | FX | 11,304 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067326 | FX | 200,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067328 | FX | 200,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067329 | FX | 11,304 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067621 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067623 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067624 | FX | 2,729 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067641 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067643 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067644 | FX | 2,729 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067787 | FX | 150,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067789 | FX | 150,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067811 | FX | 150,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067813 | FX | 150,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067970 | FX | 250,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067972 | FX | 250,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068019 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068021 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068022 | FX | 2,882 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068064 | FX | 250,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068066 | FX | 250,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068093 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068095 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068096 | FX | 2,882 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068918 | FX | 400,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068920 | FX | 400,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068939 | FX | 400,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068941 | FX | 400,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069198 | FX | 500,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069200 | FX | 500,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069201 | FX | 500,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069203 | FX | 500,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069720 | FX | 250,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069759 | FX | 250,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071809 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071811 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071812 | FX | 4,457 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071825 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071827 | FX | 50,000 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071828 | FX | 4,457 | 17-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065668 | FX | 50,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065670 | FX | 50,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065704 | FX | 50,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065706 | FX | 50,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066077 | FX | 15,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066089 | FX | 15,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067601 | FX | 20,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067673 | FX | 20,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067715 | FX | 20,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067717 | FX | 20,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067763 | FX | 20,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067765 | FX | 20,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072073 | FX | 40,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072075 | FX | 40,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072085 | FX | 40,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072087 | FX | 40,000 | 18-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067363 | FX | 25,000 | 19-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067365 | FX | 25,000 | 19-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067402 | FX | 25,000 | 19-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067404 | FX | 25,000 | 19-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070290 | FX | 30,000 | 19-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070303 | FX | 30,000 | 19-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068154 | FX | 50,000 | 20-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068156 | FX | 50,000 | 20-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068181 | FX | 50,000 | 20-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068183 | FX | 50,000 | 20-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059862 | FX | 25,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059863 | FX | 25,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059882 | FX | 25,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059883 | FX | 25,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060192 | FX | 50,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060216 | FX | 50,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062663 | FX | 100,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062665 | FX | 100,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062666 | FX | 5,185 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062821 | FX | 100,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062823 | FX | 100,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2062824 | FX | 5,185 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063438 | FX | 100,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063439 | FX | 100,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063440 | FX | 7,286 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063510 | FX | 100,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063511 | FX | 100,000 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063512 | FX | 7,286 | 23-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065765 | FX | 555,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065767 | FX | 555,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065768 | FX | 66,600 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065816 | FX | 500,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065818 | FX | 500,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065819 | FX | 60,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065864 | FX | 50,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065866 | FX | 50,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065867 | FX | 6,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065912 | FX | 5,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065914 | FX | 5,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065915 | FX | 600 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067790 | FX | 150,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067792 | FX | 150,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067814 | FX | 150,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067816 | FX | 150,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2068741 | FX | 32,500 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068743 | FX | 32,500 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068780 | FX | 32,500 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068782 | FX | 32,500 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068819 | FX | 32,500 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068821 | FX | 32,500 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068858 | FX | 32,500 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068860 | FX | 32,500 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068921 | FX | 400,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068923 | FX | 400,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068942 | FX | 400,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068944 | FX | 400,000 | 23-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065770 | FX | 200,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065771 | FX | 200,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067278 | FX | 200,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067280 | FX | 200,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067281 | FX | 11,304 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067330 | FX | 200,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067332 | FX | 200,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067333 | FX | 11,304 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067449 | FX | 50,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067451 | FX | 50,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067452 | FX | 2,826 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067469 | FX | 50,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067471 | FX | 50,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067472 | FX | 2,826 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067603 | FX | 20,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067675 | FX | 20,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067718 | FX | 20,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067720 | FX | 20,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067766 | FX | 20,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067768 | FX | 20,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067973 | FX | 250,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067975 | FX | 250,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068067 | FX | 250,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068069 | FX | 250,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069552 | FX | 40,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069554 | FX | 40,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069555 | FX | 2,262 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069576 | FX | 40,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069578 | FX | 40,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069579 | FX | 2,262 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069723 | FX | 250,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069762 | FX | 250,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071849 | FX | 50,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071851 | FX | 50,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071852 | FX | 5,342 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071869 | FX | 50,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071871 | FX | 50,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071872 | FX | 5,342 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2072103 | FX | 500,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072105 | FX | 500,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072118 | FX | 500,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072120 | FX | 500,000 | 24-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060267 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060294 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060400 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060472 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2064557 | FX | 100,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066014 | FX | 100,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066257 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066259 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066312 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066314 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066330 | FX | 500,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066332 | FX | 500,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066333 | FX | 27,851 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066350 | FX | 500,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066352 | FX | 500,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066353 | FX | 27,851 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066394 | FX | 400,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066404 | FX | 400,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066526 | FX | 200,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066528 | FX | 200,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066541 | FX | 200,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066543 | FX | 200,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066593 | FX | 250,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066603 | FX | 250,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066619 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066621 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066622 | FX | 27,500 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066639 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066641 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066642 | FX | 27,500 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067174 | FX | 250,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067176 | FX | 250,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067177 | FX | 14,100 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067190 | FX | 250,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067192 | FX | 250,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067193 | FX | 14,100 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067210 | FX | 500,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067212 | FX | 500,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067216 | FX | 500,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067218 | FX | 500,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067366 | FX | 25,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067368 | FX | 25,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067405 | FX | 25,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067407 | FX | 25,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067431 | FX | 375,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067433 | FX | 375,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067437 | FX | 375,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067439 | FX | 375,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069903 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069905 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069906 | FX | 32,365 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069939 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069941 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069942 | FX | 32,365 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070291 | FX | 30,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070304 | FX | 30,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072267 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072269 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072270 | FX | 32,609 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072715 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072717 | FX | 300,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072718 | FX | 32,609 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068157 | FX | 50,000 | 27-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068159 | FX | 50,000 | 27-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068184 | FX | 50,000 | 27-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068186 | FX | 50,000 | 27-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068209 | FX | 300,000 | 27-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068211 | FX | 300,000 | 27-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066906 | FX | 100,000 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066926 | FX | 100,000 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067012 | FX | 40,000 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067014 | FX | 40,000 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067042 | FX | 40,000 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067044 | FX | 40,000 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067106 | FX | 60,000 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067126 | FX | 60,000 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068744 | FX | 32,500 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068746 | FX | 32,500 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068783 | FX | 32,500 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068785 | FX | 32,500 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068822 | FX | 32,500 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068824 | FX | 32,500 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068861 | FX | 32,500 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068863 | FX | 32,500 | 30-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067282 | FX | 200,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067284 | FX | 200,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067285 | FX | 11,304 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067334 | FX | 200,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067336 | FX | 200,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067337 | FX | 11,304 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067793 | FX | 150,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067795 | FX | 150,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067817 | FX | 150,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067819 | FX | 150,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067976 | FX | 250,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067978 | FX | 250,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2068070 | FX | 250,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068072 | FX | 250,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068924 | FX | 400,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068926 | FX | 400,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068945 | FX | 400,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068947 | FX | 400,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069726 | FX | 250,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069765 | FX | 250,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072106 | FX | 500,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072108 | FX | 500,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072121 | FX | 500,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072123 | FX | 500,000 | 01-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065671 | FX | 50,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065673 | FX | 50,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065707 | FX | 50,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065709 | FX | 50,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067605 | FX | 20,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067677 | FX | 20,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067721 | FX | 20,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067723 | FX | 20,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067769 | FX | 20,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067771 | FX | 20,000 | 02-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066078 | FX | 15,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066090 | FX | 15,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067369 | FX | 25,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067371 | FX | 25,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067408 | FX | 25,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067410 | FX | 25,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068269 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068271 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068307 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068309 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068310 | FX | 8,024 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068355 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068357 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068358 | FX | 8,024 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068460 | FX | 200,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068462 | FX | 200,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068463 | FX | 8,539 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068488 | FX | 200,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068490 | FX | 200,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068491 | FX | 8,539 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068513 | FX | 200,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068515 | FX | 200,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068540 | FX | 200,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068542 | FX | 200,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068978 | FX | 250,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068980 | FX | 250,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068996 | FX | 250,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068998 | FX | 250,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2069014 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069016 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069032 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069034 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069052 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069054 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069055 | FX | 10,011 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069076 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069078 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069079 | FX | 10,011 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070292 | FX | 30,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070305 | FX | 30,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074749 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074751 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2063937 | FX | 100,000 | 04-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066020 | FX | 100,000 | 04-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068160 | FX | 50,000 | 04-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068162 | FX | 50,000 | 04-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068187 | FX | 50,000 | 04-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068189 | FX | 50,000 | 04-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059864 | FX | 25,000 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059865 | FX | 25,000 | 07-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059884 | FX | 25,000 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059885 | FX | 25,000 | 07-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068747 | FX | 32,500 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068749 | FX | 32,500 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068786 | FX | 32,500 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068788 | FX | 32,500 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068825 | FX | 32,500 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068827 | FX | 32,500 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068864 | FX | 32,500 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068866 | FX | 32,500 | 07-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065066 | FX | 50,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065068 | FX | 50,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065069 | FX | 3,646 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065086 | FX | 50,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065088 | FX | 50,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065089 | FX | 3,646 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066882 | FX | 1,480,078 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066884 | FX | 1,480,078 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066891 | FX | 1,480,078 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066893 | FX | 1,480,078 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067201 | FX | 592,031 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067203 | FX | 592,031 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067207 | FX | 592,031 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067209 | FX | 592,031 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067286 | FX | 200,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067288 | FX | 200,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067289 | FX | 11,304 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067338 | FX | 200,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067340 | FX | 200,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067341 | FX | 11,304 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067796 | FX | 150,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067798 | FX | 150,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067820 | FX | 150,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067822 | FX | 150,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067979 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067981 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068073 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068075 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068552 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068554 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068555 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068557 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068927 | FX | 400,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068929 | FX | 400,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068948 | FX | 400,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068950 | FX | 400,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069729 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069768 | FX | 250,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071813 | FX | 50,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071815 | FX | 50,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071816 | FX | 4,457 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071829 | FX | 50,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071831 | FX | 50,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071832 | FX | 4,457 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072109 | FX | 500,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072111 | FX | 500,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072124 | FX | 500,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072126 | FX | 500,000 | 08-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060580 | FX | 1,000,000 | 09-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060628 | FX | 1,000,000 | 09-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067607 | FX | 20,000 | 09-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067679 | FX | 20,000 | 09-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067724 | FX | 20,000 | 09-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067726 | FX | 20,000 | 09-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067772 | FX | 20,000 | 09-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067774 | FX | 20,000 | 09-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065105 | FX | 70,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065107 | FX | 70,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065126 | FX | 70,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065128 | FX | 70,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067372 | FX | 25,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067374 | FX | 25,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067411 | FX | 25,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067413 | FX | 25,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070293 | FX | 30,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070306 | FX | 30,000 | 10-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2058970 | FX | 500,000 | 11-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059018 | FX | 500,000 | 11-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2059066 | FX | 35,309 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059067 | FX | 35,309 | 11-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059090 | FX | 35,309 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059091 | FX | 35,309 | 11-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066488 | FX | 250,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066665 | FX | 250,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068163 | FX | 50,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068165 | FX | 50,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068190 | FX | 50,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068192 | FX | 50,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068906 | FX | 150,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068908 | FX | 150,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068909 | FX | 150,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068911 | FX | 150,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071905 | FX | 25,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071907 | FX | 25,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071917 | FX | 25,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071919 | FX | 25,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071929 | FX | 25,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071931 | FX | 25,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071941 | FX | 25,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071943 | FX | 25,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066908 | FX | 100,000 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066928 | FX | 100,000 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067015 | FX | 40,000 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067017 | FX | 40,000 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067045 | FX | 40,000 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067047 | FX | 40,000 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067108 | FX | 60,000 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067128 | FX | 60,000 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068750 | FX | 32,500 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068752 | FX | 32,500 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068789 | FX | 32,500 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068791 | FX | 32,500 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068828 | FX | 32,500 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068830 | FX | 32,500 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068867 | FX | 32,500 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068869 | FX | 32,500 | 14-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066168 | FX | 100,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066170 | FX | 100,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066189 | FX | 100,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066191 | FX | 100,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067799 | FX | 150,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067801 | FX | 150,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067823 | FX | 150,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067825 | FX | 150,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067982 | FX | 250,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067984 | FX | 250,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068076 | FX | 250,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068078 | FX | 250,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2068930 | FX | 400,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068932 | FX | 400,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068951 | FX | 400,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068953 | FX | 400,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069612 | FX | 100,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069621 | FX | 100,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069732 | FX | 250,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069771 | FX | 250,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072112 | FX | 500,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072114 | FX | 500,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072127 | FX | 500,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072129 | FX | 500,000 | 15-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065674 | FX | 50,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065676 | FX | 50,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065710 | FX | 50,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065712 | FX | 50,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065966 | FX | 80,573 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065968 | FX | 80,573 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067609 | FX | 20,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067681 | FX | 20,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067727 | FX | 20,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067729 | FX | 20,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067775 | FX | 20,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067777 | FX | 20,000 | 16-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059037 | FX | 13,632,620 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059039 | FX | 13,632,620 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059092 | FX | 13,632,620 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059094 | FX | 13,632,620 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066079 | FX | 15,000 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066091 | FX | 15,000 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067375 | FX | 25,000 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067377 | FX | 25,000 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067414 | FX | 25,000 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067416 | FX | 25,000 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070294 | FX | 30,000 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070307 | FX | 30,000 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072956 | FX | 96,733 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072958 | FX | 96,733 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072960 | FX | 96,733 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072962 | FX | 96,733 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068166 | FX | 50,000 | 18-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068168 | FX | 50,000 | 18-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068193 | FX | 50,000 | 18-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068195 | FX | 50,000 | 18-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059866 | FX | 25,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059867 | FX | 25,000 | 21-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059886 | FX | 25,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2059887 | FX | 25,000 | 21-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067802 | FX | 150,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067804 | FX | 150,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067826 | FX | 150,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067828 | FX | 150,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068753 | FX | 32,500 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068755 | FX | 32,500 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068792 | FX | 32,500 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068794 | FX | 32,500 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068831 | FX | 32,500 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068833 | FX | 32,500 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068870 | FX | 32,500 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068872 | FX | 32,500 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072076 | FX | 40,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072078 | FX | 40,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072088 | FX | 40,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072090 | FX | 40,000 | 21-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067611 | FX | 20,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067625 | FX | 50,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067627 | FX | 50,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067628 | FX | 2,729 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067645 | FX | 50,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067647 | FX | 50,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067648 | FX | 2,729 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067683 | FX | 20,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067730 | FX | 20,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067732 | FX | 20,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067778 | FX | 20,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067780 | FX | 20,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067985 | FX | 250,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067987 | FX | 250,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068023 | FX | 50,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068025 | FX | 50,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068026 | FX | 2,882 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068079 | FX | 250,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068081 | FX | 250,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068097 | FX | 50,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068099 | FX | 50,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068100 | FX | 2,882 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069615 | FX | 100,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069624 | FX | 100,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069735 | FX | 250,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069774 | FX | 250,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072115 | FX | 500,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072117 | FX | 500,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072130 | FX | 500,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072132 | FX | 500,000 | 22-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067378 | FX | 25,000 | 23-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067380 | FX | 25,000 | 23-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067417 | FX | 25,000 | 23-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067419 | FX | 25,000 | 23-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070295 | FX | 30,000 | 23-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070308 | FX | 30,000 | 23-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2068169 | FX | 50,000 | 24-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068171 | FX | 50,000 | 24-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068196 | FX | 50,000 | 24-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068198 | FX | 50,000 | 24-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066910 | FX | 100,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066930 | FX | 100,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067018 | FX | 40,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067020 | FX | 40,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067048 | FX | 40,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067050 | FX | 40,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067110 | FX | 60,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067130 | FX | 60,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068756 | FX | 32,500 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068758 | FX | 32,500 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068795 | FX | 32,500 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068797 | FX | 32,500 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068834 | FX | 32,500 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068836 | FX | 32,500 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068873 | FX | 32,500 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068875 | FX | 32,500 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069556 | FX | 40,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069558 | FX | 40,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069559 | FX | 2,262 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069580 | FX | 40,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069582 | FX | 40,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069583 | FX | 2,262 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072013 | FX | 100,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072015 | FX | 100,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072043 | FX | 100,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072045 | FX | 100,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072175 | FX | 50,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072177 | FX | 50,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072205 | FX | 50,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072207 | FX | 50,000 | 28-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060270 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060297 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060404 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2060476 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066315 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066317 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066334 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066336 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066337 | FX | 28,821 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066544 | FX | 200,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066546 | FX | 200,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066643 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066645 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2066646 | FX | 27,500 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067194 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067196 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2067197 | FX | 14,100 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067219 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067221 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067453 | FX | 50,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067455 | FX | 50,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067456 | FX | 2,826 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067473 | FX | 50,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067475 | FX | 50,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067476 | FX | 2,826 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067988 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2067990 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068082 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2068084 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069168 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069170 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069183 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069185 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069738 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069777 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069907 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069909 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069910 | FX | 32,365 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069943 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069945 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069946 | FX | 32,365 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071853 | FX | 50,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071855 | FX | 50,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071856 | FX | 5,342 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071873 | FX | 50,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071875 | FX | 50,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2071876 | FX | 5,342 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072271 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072273 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072274 | FX | 32,609 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072719 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072721 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2072722 | FX | 32,609 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074705 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074707 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074708 | FX | 27,500 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074709 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074711 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074712 | FX | 14,100 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074713 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074715 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074716 | FX | 200,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074718 | FX | 200,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074719 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074721 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074990 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|---------|
| 2074992 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2074993 | FX | 28,821 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070296 | FX | 30,000 | 30-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2070309 | FX | 30,000 | 30-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065108 | FX | 70,000 | 31-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065110 | FX | 70,000 | 31-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065129 | FX | 70,000 | 31-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2065131 | FX | 70,000 | 31-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069204 | FX | 50,000 | 31-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069206 | FX | 50,000 | 31-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069228 | FX | 50,000 | 31-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |
| 2069230 | FX | 50,000 | 31-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | EXPIRED |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|-------------|--------|-----------------|
| 2020072803007 | FWD | EURMXN | 01/10/2020 | 750,000 | 26.067 | (19,550,550) |
| 2020072803001 | FWD | EURMXN | 01/10/2020 | (750,000) | 26.089 | 19,566,750 |
| 2020072803010 | FWD | EURMXN | 01/10/2020 | (750,000) | 26.089 | 19,566,750 |
| 2020031103325 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (100,000) | 22.061 | 2,206,055 |
| 2020031103359 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 100,000 | 21.89 | (2,189,040) |
| 2020071303031 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (100,000) | 22.657 | 2,265,720 |
| 2020071303036 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 100,000 | 22.637 | (2,263,694) |
| 2020072903055 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (1,500,000) | 22.089 | 33,133,050 |
| 2020072903063 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 1,500,000 | 22.067 | (33,099,930) |
| 2020080503312 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (100,000) | 22.543 | 2,254,300 |
| 2020080503318 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 100,000 | 22.524 | (2,252,405) |
| 2020081303292 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (150,000) | 22.36 | 3,354,060 |
| 2020081303305 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 150,000 | 22.35 | (3,352,516) |
| 2020081703067 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (100,000) | 22.07 | 2,206,990 |
| 2020081703061 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 100,000 | 22.059 | (2,205,881) |
| 2020082803101 | FWD | MXNUSD | 01/10/2020 | 103,328,790 | 21.962 | (4,704,853) |
| 2020082803603 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 185,864 | 21.962 | (4,081,973) |
| 2020082803621 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 82,484 | 21.885 | (1,805,197) |
| 2020082803762 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 250,000 | 21.873 | (5,468,182) |
| 2020082803930 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 95,077,855 | 21.856 | (2,078,009,239) |
| 2020090103078 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 481,000 | 21.774 | (10,473,445) |
| 2020090103568 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 500 | 21.844 | (10,922) |
| 2020091503407 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (200,000) | 21.206 | 4,241,180 |
| 2020091503429 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 200,000 | 21.125 | (4,224,961) |
| 2020092303255 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (200,000) | 22.229 | 4,445,859 |
| 2020092303176 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | 200,000 | 21.206 | (4,241,180) |
| 2020092903432 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (85,612) | 22.403 | 1,917,920 |
| 2020092903434 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (83,452) | 22.399 | 1,869,208 |
| 2020092903436 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (86,561) | 22.394 | 1,938,448 |
| 2020092903438 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (83,452) | 22.398 | 1,869,187 |
| 2020092903440 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (86,561) | 22.397 | 1,938,664 |
| 2020092903444 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (86,561) | 22.4 | 1,938,967 |
| 2020092903448 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (83,452) | 22.396 | 1,869,020 |
| 2020092903452 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (86,561) | 22.398 | 1,938,816 |
| 2020092903455 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (91,045) | 22.398 | 2,039,239 |
| 2020092903457 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (95,578) | 22.398 | 2,140,756 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020092903462 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (72,489) | 22.399 | 1,623,670 |
| 2020092903464 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (88,459) | 22.399 | 1,981,379 |
| 2020093003001 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (2,389,880) | 22.333 | 53,372,425 |
| 2020093003017 | FWD | USDMXN | 01/10/2020 | (2,389,880) | 22.333 | 53,372,425 |
| 2020052803362 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | (250,000) | 22.646 | 5,661,525 |
| 2020052803437 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | 250,000 | 22.538 | (5,634,585) |
| 2020060303052 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | (75,000) | 22.16 | 1,662,008 |
| 2020060303042 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | 75,000 | 22.033 | (1,652,463) |
| 2020082503037 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | (160,000) | 22.115 | 3,538,400 |
| 2020082503348 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | (34,000) | 22.046 | 749,564 |
| 2020082503030 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | 160,000 | 22.059 | (3,529,385) |
| 2020082503334 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | 34,000 | 21.98 | (747,306) |
| 2020092103207 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | (226,000) | 21.573 | 4,875,413 |
| 2020092103171 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | 93,000 | 21.514 | (2,000,756) |
| 2020092103178 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | 79,000 | 21.514 | (1,699,567) |
| 2020092103180 | FWD | USDMXN | 02/10/2020 | 54,000 | 21.514 | (1,161,729) |
| 2020010903073 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (413,900) | 19.532 | 8,084,336 |
| 2020010903019 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 413,900 | 19.521 | (8,079,688) |
| 2020052103219 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (25,000) | 23.309 | 582,713 |
| 2020052103314 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 25,000 | 23.332 | (583,292) |
| 2020052803576 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (15,930) | 22.681 | 361,308 |
| 2020052803555 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 15,930 | 22.615 | (360,257) |
| 2020060803287 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (15,930) | 22.059 | 351,405 |
| 2020060803262 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 15,930 | 21.954 | (349,733) |
| 2020073003298 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (71,760,000) | 22.292 | 1,599,673,920 |
| 2020073003337 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 71,760,000 | 22.33 | (1,602,415,152) |
| 2020082603048 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (100,000) | 22.064 | 2,206,350 |
| 2020082603113 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 100,000 | 22.027 | (2,202,737) |
| 2020083103103 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (500,000) | 22.005 | 11,002,250 |
| 2020083103158 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 500,000 | 21.979 | (10,989,440) |
| 2020090303589 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 481,500 | 21.758 | (10,476,375) |
| 2020091403174 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (32,000) | 21.245 | 679,853 |
| 2020091403239 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 32,000 | 21.137 | (676,390) |
| 2020092103208 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (569,000) | 21.58 | 12,278,961 |
| 2020092103181 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 117,000 | 21.521 | (2,517,899) |
| 2020092103186 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 72,000 | 21.521 | (1,549,476) |
| 2020092103187 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 57,000 | 21.521 | (1,226,669) |
| 2020092103189 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 117,000 | 21.521 | (2,517,899) |
| 2020092103191 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 104,000 | 21.521 | (2,238,132) |
| 2020092103193 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 102,000 | 21.521 | (2,195,091) |
| 2020092803361 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (15,930) | 22.446 | 357,559 |
| 2020092803313 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 15,930 | 22.059 | (351,405) |
| 2020100103116 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 481,500 | 21.724 | (10,459,962) |
| 2020100103117 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 0 | 21.956 | (111,742) |
| 2020100103470 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 331,162 | 21.812 | (7,223,157) |
| 2020100503201 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 4,000,000 | 21.391 | (85,562,240) |
| 2020092103045 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 25,000,000 | 21.51 | (537,750,000) |
| 2020092803116 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (25,000,000) | 22.565 | 564,122,500 |
| 2020093003186 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | 5,000,000 | 22.104 | (110,517,500) |
| 2020100103188 | FWD | USDMXN | 05/10/2020 | (5,000,000) | 21.97 | 109,850,000 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|-------------|--------|---------------|
| 2020073103455 | FWD | EURMXN | 06/10/2020 | 3,900,000 | 26.475 | (103,253,495) |
| 2020073103458 | FWD | EURMXN | 06/10/2020 | (3,900,000) | 26.479 | 103,268,100 |
| 2020080703293 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (79,500) | 22.559 | 1,793,456 |
| 2020080703300 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 79,500 | 22.549 | (1,792,614) |
| 2020081003165 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (41,000) | 22.607 | 926,895 |
| 2020081003164 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 41,000 | 22.594 | (926,358) |
| 2020081403298 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (50,000) | 22.159 | 1,107,965 |
| 2020081403286 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 50,000 | 22.149 | (1,107,443) |
| 2020082103407 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (47,500) | 22.103 | 1,049,902 |
| 2020082103416 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 47,500 | 22.086 | (1,049,096) |
| 2020082403153 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (50,000) | 22.137 | 1,106,850 |
| 2020082403169 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 50,000 | 22.073 | (1,103,668) |
| 2020082803702 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (38,500) | 21.9 | 843,158 |
| 2020082803807 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 38,500 | 21.884 | (842,539) |
| 2020083103280 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (4,000,000) | 22.03 | 88,120,960 |
| 2020083103285 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (2,000,000) | 22.033 | 44,066,000 |
| 2020083103289 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (2,000,000) | 22.033 | 44,066,000 |
| 2020083103318 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 4,000,000 | 22.03 | (88,120,960) |
| 2020090203168 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (298,000) | 21.907 | 6,528,167 |
| 2020090203315 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 298,000 | 21.887 | (6,522,256) |
| 2020090703113 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (19,450) | 21.759 | 423,213 |
| 2020090703106 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 19,450 | 21.689 | (421,852) |
| 2020090903390 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (2,500) | 21.517 | 53,794 |
| 2020090903394 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 2,500 | 21.498 | (53,746) |
| 2020092103209 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (241,000) | 21.582 | 5,201,340 |
| 2020092103195 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 116,000 | 21.521 | (2,496,378) |
| 2020092103196 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 77,000 | 21.523 | (1,657,271) |
| 2020092103197 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 48,000 | 21.523 | (1,033,104) |
| 2020100203257 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (100,000) | 21.65 | 2,165,010 |
| 2020100203002 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 312,351 | 21.894 | (6,838,516) |
| 2020100203327 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | 100,000 | 21.644 | (2,164,430) |
| 2020100603289 | FWD | USDMXN | 06/10/2020 | (10,000) | 21.565 | 215,650 |
| 2020031903357 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | (666,667) | 24.909 | 16,606,221 |
| 2020031903322 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | 666,667 | 24.875 | (16,583,475) |
| 2020032603079 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | (666,667) | 24.875 | 16,583,475 |
| 2020032603231 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | 666,667 | 23.826 | (15,883,979) |
| 2020052603187 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | (50,000) | 22.634 | 1,131,675 |
| 2020052603298 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | (10,000) | 22.619 | 226,185 |
| 2020052603250 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | 60,000 | 22.611 | (1,356,669) |
| 2020060203310 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | (500,000) | 22.113 | 11,056,450 |
| 2020060203324 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | (50,000) | 22.113 | 1,105,645 |
| 2020060203344 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | (5,000) | 22.113 | 110,565 |
| 2020060203294 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | 555,000 | 22.075 | (12,251,826) |
| 2020061003334 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | (200,000) | 22.35 | 4,469,920 |
| 2020061003383 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | (200,000) | 22.35 | 4,469,920 |
| 2020061003344 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | 200,000 | 22.332 | (4,466,428) |
| 2020090703075 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | 453,175 | 21.67 | (9,820,184) |
| 2020090703132 | FWD | USDMXN | 07/10/2020 | 453,175 | 21.689 | (9,828,813) |
| 2020022103202 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (235,000) | 19.451 | 4,570,905 |
| 2020031103328 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (100,000) | 22.084 | 2,208,384 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|-------------|--------|---------------|
| 2020031103360 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 100,000 | 21.913 | (2,191,340) |
| 2020071303032 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (100,000) | 22.677 | 2,267,710 |
| 2020071303038 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 100,000 | 22.657 | (2,265,685) |
| 2020072903056 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (1,500,000) | 22.09 | 33,134,550 |
| 2020072903064 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 1,500,000 | 22.065 | (33,098,037) |
| 2020080503313 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (100,000) | 22.563 | 2,256,300 |
| 2020080503319 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 100,000 | 22.544 | (2,254,413) |
| 2020081303293 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (150,000) | 22.38 | 3,356,940 |
| 2020081303306 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 150,000 | 22.369 | (3,355,323) |
| 2020081703070 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (100,000) | 22.088 | 2,208,820 |
| 2020081703062 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 100,000 | 22.077 | (2,207,721) |
| 2020082803763 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 250,000 | 21.892 | (5,472,922) |
| 2020090403320 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (1,000,000) | 21.715 | 21,714,500 |
| 2020090403447 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 1,000,000 | 21.671 | (21,671,415) |
| 2020090803116 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 453,000 | 21.781 | (9,866,814) |
| 2020090803296 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 453,000 | 21.783 | (9,867,743) |
| 2020090803415 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 350 | 21.859 | (7,651) |
| 2020091503409 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (200,000) | 21.225 | 4,245,000 |
| 2020091503428 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 200,000 | 21.142 | (4,228,313) |
| 2020092303231 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (200,000) | 22.239 | 4,447,746 |
| 2020092303177 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 200,000 | 21.225 | (4,245,000) |
| 2020100603357 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (5,000,000) | 21.522 | 107,611,500 |
| 2020100603370 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (4,285,229) | 21.502 | 92,142,717 |
| 2020093003187 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (5,000,000) | 22.111 | 110,556,500 |
| 2020100103189 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | 5,000,000 | 21.978 | (109,887,500) |
| 2020100603409 | FWD | USDMXN | 08/10/2020 | (355,000) | 21.616 | 7,673,538 |
| 2020021203430 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (213,550) | 19.265 | 4,114,105 |
| 2020021203454 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 213,550 | 19.251 | (4,111,113) |
| 2020032603504 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (500,000) | 23.861 | 11,930,350 |
| 2020032603532 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 500,000 | 23.871 | (11,935,675) |
| 2020040603091 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (500,000) | 25.463 | 12,731,659 |
| 2020040603026 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 500,000 | 23.861 | (11,930,350) |
| 2020040703157 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (500,000) | 24.703 | 12,351,600 |
| 2020040703165 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 500,000 | 24.685 | (12,342,370) |
| 2020052103227 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (100,000) | 23.499 | 2,349,860 |
| 2020052103322 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 100,000 | 23.383 | (2,338,329) |
| 2020052803365 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (250,000) | 22.666 | 5,666,600 |
| 2020052803438 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 250,000 | 22.558 | (5,639,546) |
| 2020060303055 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (75,000) | 22.178 | 1,663,358 |
| 2020060303044 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 75,000 | 22.052 | (1,653,923) |
| 2020060503075 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (40,000) | 22.17 | 886,792 |
| 2020060503212 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 40,000 | 22.117 | (884,686) |
| 2020070603079 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (400,000) | 22.318 | 8,927,080 |
| 2020070603107 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 400,000 | 22.465 | (8,986,026) |
| 2020082803705 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (98,333) | 21.913 | 2,154,778 |
| 2020082803798 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 98,333 | 21.904 | (2,153,841) |
| 2020090103538 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (34,000) | 21.877 | 743,815 |
| 2020090103542 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 34,000 | 21.772 | (740,252) |
| 2020090903255 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (50,000) | 21.586 | 1,079,295 |
| 2020090903268 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 50,000 | 21.563 | (1,078,169) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020092403077 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (250,000) | 22.56 | 5,640,002 |
| 2020092403078 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (250,000) | 22.651 | 5,662,832 |
| 2020092403036 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 250,000 | 22.506 | (5,626,500) |
| 2020092403037 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 250,000 | 22.596 | (5,649,000) |
| 2020092503077 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (200,000) | 22.558 | 4,511,519 |
| 2020092503484 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (350,000) | 22.37 | 7,829,556 |
| 2020092503069 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 200,000 | 22.503 | (4,500,600) |
| 2020092503486 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 350,000 | 22.33 | (7,815,500) |
| 2020093003195 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (350,000) | 22.139 | 7,748,650 |
| 2020093003194 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | 350,000 | 22.102 | (7,735,847) |
| 2020100903484 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (490,000) | 21.16 | 10,368,400 |
| 2020100803009 | FWD | USDMXN | 09/10/2020 | (1,886,289) | 21.387 | 40,342,914 |
| 2020052103353 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (100,000) | 23.51 | 2,351,040 |
| 2020052103323 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 100,000 | 23.395 | (2,339,507) |
| 2020052803577 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (15,930) | 22.708 | 361,735 |
| 2020052803558 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 15,930 | 22.638 | (360,625) |
| 2020060803288 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (15,930) | 22.082 | 351,761 |
| 2020060803263 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 15,930 | 21.977 | (350,088) |
| 2020070903039 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (28,000,000) | 22.878 | 640,584,000 |
| 2020071603266 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 28,000,000 | 22.668 | (634,704,000) |
| 2020081703092 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (17,884) | 22.293 | 398,678 |
| 2020081703386 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (51,000) | 22.346 | 1,139,626 |
| 2020081703120 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 17,884 | 22.189 | (396,820) |
| 2020081703385 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 51,000 | 22.332 | (1,138,944) |
| 2020081803412 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (2,000,000) | 22.288 | 44,576,000 |
| 2020081803413 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 2,000,000 | 22.282 | (44,563,620) |
| 2020082103030 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (1,000,000) | 22.226 | 22,226,000 |
| 2020082103405 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (70,000) | 22.122 | 1,548,526 |
| 2020082103059 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 1,000,000 | 22.217 | (22,216,773) |
| 2020082103417 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 70,000 | 22.105 | (1,547,344) |
| 2020082403154 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (50,000) | 22.156 | 1,107,800 |
| 2020082403171 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 50,000 | 22.092 | (1,104,608) |
| 2020082603049 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (100,000) | 22.085 | 2,208,490 |
| 2020082603115 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 100,000 | 22.049 | (2,204,911) |
| 2020082803312 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (1,000,000) | 21.998 | 21,997,500 |
| 2020082803718 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (44,500) | 21.919 | 975,400 |
| 2020082803328 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 1,000,000 | 21.969 | (21,968,845) |
| 2020082803808 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 44,500 | 21.903 | (974,688) |
| 2020090203170 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (140,000) | 21.925 | 3,069,458 |
| 2020090203316 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 140,000 | 21.905 | (3,066,666) |
| 2020090403103 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (190,000) | 21.746 | 4,131,645 |
| 2020090403107 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 190,000 | 21.675 | (4,118,236) |
| 2020090703093 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (6,000,000) | 21.697 | 130,182,600 |
| 2020090703114 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (19,450) | 21.778 | 423,582 |
| 2020090703097 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 6,000,000 | 21.694 | (130,161,684) |
| 2020090703105 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 19,450 | 21.707 | (422,204) |
| 2020091003383 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 453,175 | 21.428 | (9,710,532) |
| 2020091103408 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (200,000) | 21.339 | 4,267,800 |
| 2020091103405 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 200,000 | 21.335 | (4,267,023) |
| 2020100203232 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (30,000) | 21.89 | 656,697 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020100203243 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 30,000 | 21.655 | (649,650) |
| 2020100903286 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (3,000,000) | 21.149 | 63,446,370 |
| 2020100903300 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (6,000,000) | 21.174 | 127,042,140 |
| 2020100903335 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 2,000,000 | 21.15 | (42,300,000) |
| 2020100903340 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 1,000,000 | 21.15 | (21,150,000) |
| 2020100903345 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 6,000,000 | 21.17 | (127,020,000) |
| 2020100903492 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 490,000 | 21.183 | (10,379,769) |
| 2020101303293 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (40,000) | 21.35 | 854,000 |
| 2020100803383 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (45,544,280) | 21.395 | 974,419,862 |
| 2020100803087 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 45,000,000 | 21.48 | (966,600,000) |
| 2020100803397 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 547,330 | 21.461 | (11,746,468) |
| 2020100903007 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | (8,020,202) | 21.26 | 170,509,494 |
| 2020100903003 | FWD | USDMXN | 13/10/2020 | 8,020,202 | 21.269 | (170,582,453) |
| 2020022803266 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (360,000) | 20.465 | 7,367,485 |
| 2020030503139 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (180,000) | 20.448 | 3,680,623 |
| 2020030603413 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (360,000) | 20.806 | 7,490,013 |
| 2020031903359 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (666,667) | 24.936 | 16,623,986 |
| 2020031903331 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 666,667 | 24.875 | (16,583,475) |
| 2020032603081 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (666,667) | 24.875 | 16,583,475 |
| 2020032603234 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 666,670 | 23.851 | (15,900,508) |
| 2020052603189 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (50,000) | 22.634 | 1,131,675 |
| 2020052603299 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (10,000) | 22.619 | 226,185 |
| 2020052603251 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 60,000 | 22.631 | (1,357,850) |
| 2020060203312 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (500,000) | 22.113 | 11,056,450 |
| 2020060203325 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (50,000) | 22.113 | 1,105,645 |
| 2020060203345 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (5,000) | 22.113 | 110,565 |
| 2020060203295 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 555,000 | 22.096 | (12,263,004) |
| 2020060803214 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (3) | 21.965 | 65 |
| 2020061003335 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (200,000) | 22.369 | 4,473,720 |
| 2020061003384 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (200,000) | 22.369 | 4,473,720 |
| 2020061003343 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 200,000 | 22.352 | (4,470,310) |
| 2020070903026 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (25,000,000) | 22.844 | 571,102,400 |
| 2020070903048 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (440,860) | 22.846 | 10,071,809 |
| 2020070903017 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 53,440,860 | 22.832 | (1,220,135,000) |
| 2020071603267 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (28,000,000) | 22.671 | 634,785,200 |
| 2020072803133 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (294,120) | 22.387 | 6,584,464 |
| 2020072803260 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 294,120 | 22.196 | (6,528,204) |
| 2020081703298 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 650,000 | 22.239 | (14,455,605) |
| 2020082403072 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 650,000 | 22.034 | (14,322,305) |
| 2020091103187 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 453,175 | 21.355 | (9,677,655) |
| 2020091403046 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (50,000) | 21.291 | 1,064,550 |
| 2020091403161 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 50,000 | 21.203 | (1,060,127) |
| 2020100603297 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (1,886,289) | 21.537 | 40,625,000 |
| 2020100803073 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (53,564,479) | 21.48 | 1,150,565,000 |
| 2020100803010 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 1,886,289 | 21.4 | (40,366,493) |
| 2020100803384 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 45,544,280 | 21.397 | (974,531,445) |
| 2020100903004 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | (8,020,202) | 21.272 | 170,601,727 |
| 2020100903008 | FWD | USDMXN | 14/10/2020 | 8,020,202 | 21.262 | (170,529,144) |
| 2020022803521 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (100,000) | 20.558 | 2,055,766 |
| 2020022803557 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 100,000 | 20.475 | (2,047,520) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|-------------|--------|--------------|
| 2020030903279 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (100,000) | 22.023 | 2,202,294 |
| 2020030903352 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 100,000 | 22.059 | (2,205,870) |
| 2020031103329 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (100,000) | 22.107 | 2,210,745 |
| 2020031103361 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 100,000 | 21.936 | (2,193,600) |
| 2020072103168 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (100,000) | 22.845 | 2,284,500 |
| 2020072103190 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 100,000 | 22.543 | (2,254,317) |
| 2020081303265 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (2,400,000) | 22.371 | 53,689,728 |
| 2020081303272 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (8,684) | 22.365 | 194,219 |
| 2020082703091 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (1,500,000) | 21.995 | 32,991,750 |
| 2020082703095 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 1,500,000 | 21.971 | (32,955,959) |
| 2020082803764 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 250,000 | 21.911 | (5,477,669) |
| 2020090903477 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (34,000) | 21.641 | 735,777 |
| 2020090903465 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 34,000 | 21.566 | (733,246) |
| 2020091403526 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (250) | 21.154 | 5,289 |
| 2020091403167 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 338,000 | 21.207 | (7,167,919) |
| 2020091503410 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (200,000) | 21.241 | 4,248,260 |
| 2020091503430 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 200,000 | 21.159 | (4,231,700) |
| 2020091703435 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 332,000 | 21.002 | (6,972,533) |
| 2020091703438 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 325 | 20.975 | (6,827) |
| 2020092303233 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | (200,000) | 22.256 | 4,451,218 |
| 2020092303182 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 200,000 | 21.241 | (4,248,260) |
| 2020101303320 | FWD | USDMXN | 15/10/2020 | 40,000 | 21.368 | (854,703) |
| 2020090103288 | FWD | EURMXN | 16/10/2020 | 112,709 | 26.101 | (2,941,869) |
| 2020021903356 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (1,000,000) | 19.221 | 19,221,100 |
| 2020021903341 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 1,000,000 | 19.188 | (19,188,024) |
| 2020032603506 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (500,000) | 23.861 | 11,930,350 |
| 2020032603533 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 500,000 | 23.894 | (11,946,928) |
| 2020040603093 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (500,000) | 25.513 | 12,756,418 |
| 2020040603027 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 500,000 | 23.861 | (11,930,350) |
| 2020040703158 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (500,000) | 24.703 | 12,351,600 |
| 2020040703166 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 500,000 | 24.708 | (12,354,233) |
| 2020041703393 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (1,000,000) | 24.382 | 24,381,700 |
| 2020041703402 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 1,000,000 | 24.385 | (24,384,747) |
| 2020041703423 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 1,000,000 | 24.385 | (24,384,747) |
| 2020042703068 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (29,500) | 25.436 | 750,365 |
| 2020042703075 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 29,500 | 25.35 | (747,825) |
| 2020050403094 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (2,000,000) | 24.971 | 49,941,810 |
| 2020050403070 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 1,000,000 | 24.382 | (24,381,700) |
| 2020050403088 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 1,000,000 | 24.983 | (24,983,139) |
| 2020052803368 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (50,000) | 22.687 | 1,134,345 |
| 2020052803440 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 50,000 | 22.578 | (1,128,902) |
| 2020060303060 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (75,000) | 22.2 | 1,665,008 |
| 2020060303045 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 75,000 | 22.072 | (1,655,394) |
| 2020060503076 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (40,000) | 22.19 | 887,584 |
| 2020060503222 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 40,000 | 22.137 | (885,472) |
| 2020061603066 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (200,000) | 22.407 | 4,481,440 |
| 2020061603062 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 200,000 | 22.305 | (4,460,899) |
| 2020070703220 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 3,300,000 | 22.981 | (75,836,769) |
| 2020070703221 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 91,764 | 22.988 | (2,109,469) |
| 2020072103224 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 356,000 | 22.561 | (8,031,770) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020072103244 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 497 | 22.58 | (11,228) |
| 2020080403276 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 1,000,000 | 23.001 | (23,001,026) |
| 2020080403363 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 75,480 | 22.992 | (1,735,476) |
| 2020081803336 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 2,433,000 | 22.337 | (54,346,308) |
| 2020081803382 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 75 | 22.334 | (1,669) |
| 2020090703116 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (29,500) | 25.35 | 747,825 |
| 2020090703207 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 29,500 | 21.682 | (639,630) |
| 2020091703475 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (50,000) | 21.081 | 1,054,040 |
| 2020091703477 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 50,000 | 20.97 | (1,048,520) |
| 2020100103208 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (30,000) | 21.998 | 659,952 |
| 2020100103217 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 30,000 | 21.923 | (657,677) |
| 2020100603266 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (12,000,000) | 21.534 | 258,408,000 |
| 2020100603356 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 7,000,000 | 21.53 | (150,707,263) |
| 2020100603358 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 5,000,000 | 21.543 | (107,712,689) |
| 2020101303365 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (1,000,000) | 21.386 | 21,385,890 |
| 2020101303358 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 1,000,000 | 21.36 | (21,360,000) |
| 2020101403308 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | (115,000,000) | 21.334 | 2,453,410,000 |
| 2020101403160 | FWD | USDMXN | 16/10/2020 | 229,000 | 21.351 | (4,889,265) |
| 2020052803578 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | (15,930) | 22.73 | 362,089 |
| 2020052803559 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | 15,930 | 22.655 | (360,901) |
| 2020060803289 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | (15,930) | 22.098 | 352,024 |
| 2020060803264 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | 15,930 | 21.993 | (350,351) |
| 2020081303341 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | (300,000) | 22.401 | 6,720,300 |
| 2020081303342 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | (300,000) | 22.401 | 6,720,300 |
| 2020081303344 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | (200,000) | 22.401 | 4,480,200 |
| 2020081303345 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | (200,000) | 22.401 | 4,480,200 |
| 2020081303313 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | 1,000,000 | 22.373 | (22,372,620) |
| 2020082603050 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | (100,000) | 22.098 | 2,209,840 |
| 2020082603114 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | 100,000 | 22.065 | (2,206,541) |
| 2020100203229 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | (32,000) | 21.905 | 700,963 |
| 2020100203242 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | 32,000 | 21.67 | (693,447) |
| 2020101503480 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | 1,990,300 | 21.305 | (42,403,083) |
| 2020101503290 | FWD | USDMXN | 19/10/2020 | 50,000,000 | 21.33 | (1,066,500,000) |
| 2020081703096 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | (26,847) | 22.311 | 598,987 |
| 2020081703121 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | 26,847 | 22.205 | (596,135) |
| 2020082403155 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | (50,000) | 22.175 | 1,108,740 |
| 2020082403170 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | 50,000 | 22.111 | (1,105,548) |
| 2020082803317 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | (1,800,000) | 22.017 | 39,629,880 |
| 2020082803327 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | 1,800,000 | 21.988 | (39,578,229) |
| 2020090103178 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | (250,000) | 21.9 | 5,475,000 |
| 2020090103250 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | 250,000 | 21.891 | (5,472,687) |
| 2020091403243 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | (3,000,000) | 21.207 | 63,621,000 |
| 2020091403248 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | 3,000,000 | 21.177 | (63,530,196) |
| 2020091803181 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | 337,750 | 21.02 | (7,099,392) |
| 2020092903320 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | (25,900) | 22.529 | 583,501 |
| 2020092903312 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | 25,900 | 22.441 | (581,222) |
| 2020100203328 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | (100,000) | 21.678 | 2,167,760 |
| 2020100203258 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | 100,000 | 21.685 | (2,168,540) |
| 2020101903406 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | (3,000,000) | 21.253 | 63,760,378 |
| 2020101903398 | FWD | USDMXN | 20/10/2020 | 3,000,000 | 21.26 | (63,780,000) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020031903358 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (666,666) | 24.963 | 16,641,727 |
| 2020031903334 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | 666,666 | 24.875 | (16,583,450) |
| 2020032603084 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (666,666) | 24.875 | 16,583,450 |
| 2020032603236 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | 666,666 | 23.874 | (15,916,084) |
| 2020052603190 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (50,000) | 22.634 | 1,131,675 |
| 2020052603300 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (10,000) | 22.619 | 226,185 |
| 2020052603252 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | 60,000 | 22.651 | (1,359,031) |
| 2020060203314 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (500,000) | 22.113 | 11,056,450 |
| 2020060203326 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (50,000) | 22.113 | 1,105,645 |
| 2020060203347 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (5,000) | 22.113 | 110,565 |
| 2020060203302 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | 555,000 | 22.116 | (12,274,181) |
| 2020061003336 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (200,000) | 22.388 | 4,477,520 |
| 2020061003386 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (200,000) | 22.388 | 4,477,520 |
| 2020061003342 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | 200,000 | 22.371 | (4,474,124) |
| 2020062903164 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (37,255) | 23.335 | 869,353 |
| 2020062903165 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | 7,797 | 23.444 | (182,791) |
| 2020062903167 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | 29,458 | 23.464 | (691,213) |
| 2020070103336 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | (26,615) | 23.135 | 615,727 |
| 2020070103349 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | 26,615 | 23.099 | (614,791) |
| 2020092103216 | FWD | USDMXN | 21/10/2020 | 337,750 | 21.635 | (7,307,051) |
| 2020022403277 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (354,000) | 19.716 | 6,979,472 |
| 2020031103330 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (100,000) | 22.132 | 2,213,186 |
| 2020031103362 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 100,000 | 21.961 | (2,196,080) |
| 2020050703185 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (22,110,093) | 24.475 | 541,133,471 |
| 2020050703154 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 21,623,741 | 24.526 | (530,349,615) |
| 2020050703335 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 486,352 | 24.605 | (11,966,840) |
| 2020071303033 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (100,000) | 22.715 | 2,271,510 |
| 2020071303037 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 100,000 | 22.695 | (2,269,481) |
| 2020080503314 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (100,000) | 22.603 | 2,260,250 |
| 2020080503320 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 100,000 | 22.584 | (2,258,362) |
| 2020081303303 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (150,000) | 22.418 | 3,362,655 |
| 2020081303307 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 150,000 | 22.407 | (3,360,981) |
| 2020081703074 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (100,000) | 22.125 | 2,212,530 |
| 2020081703060 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 100,000 | 22.114 | (2,211,409) |
| 2020082703092 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (1,500,000) | 21.994 | 32,990,250 |
| 2020082703096 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 1,500,000 | 21.969 | (32,954,003) |
| 2020082803250 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (1,500,000) | 21.986 | 32,978,343 |
| 2020082803262 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 1,500,000 | 21.99 | (32,985,639) |
| 2020082803765 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 250,000 | 21.93 | (5,482,433) |
| 2020091003147 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (34,000) | 21.51 | 731,347 |
| 2020091003204 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 34,000 | 21.375 | (726,752) |
| 2020091503412 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (200,000) | 21.258 | 4,251,540 |
| 2020091503431 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 200,000 | 21.176 | (4,235,151) |
| 2020092203216 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 337,750 | 21.791 | (7,360,008) |
| 2020092203272 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 337,750 | 21.748 | (7,345,491) |
| 2020092303239 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (200,000) | 22.269 | 4,453,827 |
| 2020092303183 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 200,000 | 21.258 | (4,251,540) |
| 2020093003412 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (7,000,000) | 22.212 | 155,481,956 |
| 2020093003411 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 7,312,351 | 22.209 | (162,400,000) |
| 2020100203003 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (312,351) | 21.933 | 6,850,660 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020101403146 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | (21,379,167) | 21.301 | 455,404,734 |
| 2020101403143 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 20,000,000 | 21.332 | (426,631,874) |
| 2020102003132 | FWD | USDMXN | 22/10/2020 | 74,000,000 | 21.105 | (1,561,770,000) |
| 2020032603507 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (500,000) | 23.861 | 11,930,350 |
| 2020032603534 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 500,000 | 23.916 | (11,958,181) |
| 2020040603097 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (500,000) | 25.521 | 12,760,262 |
| 2020040603028 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 500,000 | 23.861 | (11,930,350) |
| 2020040703160 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (500,000) | 24.703 | 12,351,600 |
| 2020040703167 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 500,000 | 24.729 | (12,364,550) |
| 2020060303062 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (75,000) | 22.22 | 1,666,508 |
| 2020060303047 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 75,000 | 22.092 | (1,656,864) |
| 2020060503077 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (40,000) | 22.209 | 888,376 |
| 2020060503224 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 40,000 | 22.157 | (886,260) |
| 2020061603067 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (250,000) | 22.427 | 5,606,800 |
| 2020061603064 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 250,000 | 22.324 | (5,580,977) |
| 2020070603083 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (400,000) | 22.318 | 8,927,080 |
| 2020070603108 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 400,000 | 22.503 | (9,001,014) |
| 2020082803711 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (98,333) | 21.951 | 2,158,515 |
| 2020082803799 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 98,333 | 21.942 | (2,157,589) |
| 2020090903360 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (50,000) | 21.534 | 1,076,685 |
| 2020090903362 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 50,000 | 21.507 | (1,075,344) |
| 2020092403224 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 337,750 | 22.265 | (7,519,937) |
| 2020101403299 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (30,000,000) | 21.352 | 640,552,020 |
| 2020101403267 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 86,670,000 | 21.307 | (1,846,669,023) |
| 2020101503291 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (50,000,000) | 21.34 | 1,066,977,500 |
| 2020102003133 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | (74,000,000) | 21.107 | 1,561,949,450 |
| 2020102103270 | FWD | USDMXN | 23/10/2020 | 40,000,000 | 21.07 | (842,800,000) |
| 2020052803579 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | (15,930) | 22.75 | 362,408 |
| 2020052803561 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | 15,930 | 22.678 | (361,262) |
| 2020060803290 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | (15,930) | 22.118 | 352,332 |
| 2020060803265 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | 15,930 | 22.012 | (350,657) |
| 2020082603051 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | (100,000) | 22.117 | 2,211,710 |
| 2020082603116 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | 100,000 | 22.084 | (2,208,444) |
| 2020082703392 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | (977,000) | 22.284 | 21,771,563 |
| 2020091003103 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | (50,000) | 21.482 | 1,074,080 |
| 2020091003137 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | 50,000 | 21.378 | (1,068,909) |
| 2020091703394 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | (174,535) | 21.028 | 3,670,082 |
| 2020101503449 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | 1,700,000 | 21.325 | (36,252,534) |
| 2020101503451 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | 6,918 | 21.32 | (147,488) |
| 2020102203385 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | (100,000) | 20.978 | 2,097,763 |
| 2020102203553 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | 40,000,000 | 21 | (840,000,000) |
| 2020102103271 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | (40,000,000) | 21.077 | 843,092,000 |
| 2020102203138 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | (60,790,000) | 21.005 | 1,276,893,950 |
| 2020102203020 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | 67,500,369 | 21.08 | (1,422,907,778) |
| 2020102203452 | FWD | USDMXN | 26/10/2020 | 60,000,000 | 20.985 | (1,259,100,000) |
| 2020080403349 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 1,411,880 | 23.055 | (32,550,778) |
| 2020082403156 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (50,000) | 22.194 | 1,109,675 |
| 2020082403172 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 50,000 | 22.13 | (1,106,487) |
| 2020090103191 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (250,000) | 21.918 | 5,479,500 |
| 2020090103245 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 250,000 | 21.909 | (5,477,284) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020090403426 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (11,500) | 21.705 | 249,609 |
| 2020090403453 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 11,500 | 21.677 | (249,291) |
| 2020090803286 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 1,074,998 | 21.818 | (23,453,872) |
| 2020092203301 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (11) | 21.814 | 233 |
| 2020092903404 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (5,000,000) | 22.455 | 112,275,006 |
| 2020092903409 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,000,000) | 22.454 | 22,454,192 |
| 2020092903410 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,000,000) | 22.455 | 22,455,107 |
| 2020092903411 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,000,000) | 22.455 | 22,454,684 |
| 2020092903413 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,000,000) | 22.455 | 22,455,082 |
| 2020092903414 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,000,000) | 22.455 | 22,455,062 |
| 2020092903416 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,000,000) | 22.456 | 22,456,086 |
| 2020092903418 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,000,000) | 22.455 | 22,455,185 |
| 2020092903419 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,000,000) | 22.456 | 22,455,685 |
| 2020092903425 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (6,673,458) | 22.46 | 149,885,194 |
| 2020092903426 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,000,000) | 22.458 | 22,457,962 |
| 2020100603374 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (50,000) | 21.598 | 1,079,890 |
| 2020100603377 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 50,000 | 21.576 | (1,078,789) |
| 2020101503450 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (1,700,000) | 21.327 | 36,255,679 |
| 2020101503448 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 1,700,000 | 21.355 | (36,303,322) |
| 2020102003340 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (250,000) | 21.063 | 5,265,825 |
| 2020102003350 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 250,000 | 21.055 | (5,263,863) |
| 2020102303116 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (12,000,000) | 20.898 | 250,779,480 |
| 2020101403304 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (30,000,000) | 21.358 | 640,741,977 |
| 2020101403278 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 87,130,000 | 21.317 | (1,857,306,645) |
| 2020102203021 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (67,500,369) | 21.082 | 1,423,071,466 |
| 2020102303020 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (50,000,000) | 20.875 | 1,043,750,000 |
| 2020102303146 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | (12,000,000) | 20.898 | 250,779,480 |
| 2020102303139 | FWD | USDMXN | 27/10/2020 | 12,000,000 | 20.9 | (250,800,000) |
| 2020022803210 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (360,000) | 20.515 | 7,385,477 |
| 2020030503182 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (180,000) | 20.48 | 3,686,410 |
| 2020030603422 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (360,000) | 20.841 | 7,502,671 |
| 2020052603193 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (50,000) | 22.634 | 1,131,675 |
| 2020052603302 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (10,000) | 22.619 | 226,185 |
| 2020052603253 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 60,000 | 22.67 | (1,360,212) |
| 2020060203315 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (500,000) | 22.113 | 11,056,450 |
| 2020060203327 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (50,000) | 22.113 | 1,105,645 |
| 2020060203348 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (5,000) | 22.113 | 110,565 |
| 2020060203305 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 555,000 | 22.136 | (12,285,352) |
| 2020061003337 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (200,000) | 22.407 | 4,481,320 |
| 2020061003387 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (200,000) | 22.407 | 4,481,320 |
| 2020061003345 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 200,000 | 22.39 | (4,477,939) |
| 2020082703169 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 959,086 | 22.008 | (21,107,460) |
| 2020082803756 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (959,086) | 22.001 | 21,100,851 |
| 2020082803757 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 959,086 | 21.953 | (21,054,966) |
| 2020091403047 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (50,000) | 21.275 | 1,063,745 |
| 2020091403162 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 50,000 | 21.287 | (1,064,339) |
| 2020101203146 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (450,000) | 21.248 | 9,561,375 |
| 2020101203144 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 450,000 | 21.238 | (9,557,062) |
| 2020101603611 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | (52,450) | 21.23 | 1,113,514 |
| 2020101603609 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 52,450 | 21.174 | (1,110,552) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020102603134 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 0 | 20.961 | 1,059,023 |
| 2020102603132 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 959,086 | 22.065 | (21,162,041) |
| 2020102803132 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 250,000 | 21.141 | (5,285,243) |
| 2020102803134 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 150,000 | 21.144 | (3,171,653) |
| 2020102803137 | FWD | USDMXN | 28/10/2020 | 150,000 | 21.145 | (3,171,768) |
| 2020031103331 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (100,000) | 22.156 | 2,215,628 |
| 2020031103363 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 100,000 | 21.985 | (2,198,520) |
| 2020032703009 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (1,000,000) | 24.216 | 24,215,700 |
| 2020032703033 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 1,000,000 | 24.183 | (24,183,028) |
| 2020040603099 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (1,000,000) | 25.505 | 25,504,624 |
| 2020040603029 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 1,000,000 | 24.216 | (24,215,700) |
| 2020040703161 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (1,000,000) | 24.703 | 24,703,200 |
| 2020040703168 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 1,000,000 | 24.747 | (24,746,785) |
| 2020071303035 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (100,000) | 22.733 | 2,273,330 |
| 2020071303039 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 100,000 | 22.713 | (2,271,287) |
| 2020080503316 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (100,000) | 22.622 | 2,262,230 |
| 2020080503321 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 100,000 | 22.603 | (2,260,337) |
| 2020081303312 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (150,000) | 22.437 | 3,365,520 |
| 2020081303308 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 150,000 | 22.426 | (3,363,894) |
| 2020081703075 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (100,000) | 22.144 | 2,214,390 |
| 2020081703063 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 100,000 | 22.133 | (2,213,267) |
| 2020082803835 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (1,500,000) | 21.985 | 32,976,900 |
| 2020082803766 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 250,000 | 21.949 | (5,487,198) |
| 2020082803845 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 1,500,000 | 21.965 | (32,947,586) |
| 2020091503413 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (200,000) | 21.275 | 4,255,000 |
| 2020091503432 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 200,000 | 21.193 | (4,238,674) |
| 2020092303242 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (200,000) | 22.284 | 4,456,726 |
| 2020092303184 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 200,000 | 21.275 | (4,255,000) |
| 2020101603389 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (250,000) | 21.236 | 5,308,925 |
| 2020101603432 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 250,000 | 21.132 | (5,283,067) |
| 2020102003342 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (250,000) | 21.069 | 5,267,125 |
| 2020102003349 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 250,000 | 21.06 | (5,265,082) |
| 2020102203288 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (100,000) | 21.985 | 2,198,520 |
| 2020102203386 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 100,000 | 20.985 | (2,098,507) |
| 2020102703420 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 40,000,000 | 20.98 | (839,200,000) |
| 2020102703044 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | (1,000,000) | 20.878 | 20,878,000 |
| 2020102703041 | FWD | USDMXN | 29/10/2020 | 1,000,000 | 20.879 | (20,879,300) |
| 2020031203116 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (100,000) | 23.117 | 2,311,717 |
| 2020031203137 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 100,000 | 23.01 | (2,301,000) |
| 2020031803373 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (100,000) | 24.693 | 2,469,270 |
| 2020031803344 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 100,000 | 24.612 | (2,461,220) |
| 2020060303065 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (75,000) | 22.24 | 1,668,000 |
| 2020060303048 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 75,000 | 22.111 | (1,658,335) |
| 2020060803116 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (2,900,000) | 21.961 | 63,687,480 |
| 2020060803145 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 2,900,000 | 21.913 | (63,548,112) |
| 2020061603068 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (100,000) | 22.447 | 2,244,670 |
| 2020061603063 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 100,000 | 22.343 | (2,234,332) |
| 2020070203262 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (41,900) | 22.864 | 957,981 |
| 2020070203530 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (12,500,000) | 22.855 | 285,687,500 |
| 2020070203276 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 41,900 | 22.855 | (957,641) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020070203548 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 5,000,000 | 22.813 | (114,065,430) |
| 2020070203550 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 7,500,000 | 22.809 | (171,064,845) |
| 2020070703191 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (31,916) | 22.957 | 732,691 |
| 2020070703363 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 31,916 | 23.019 | (734,679) |
| 2020072803253 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (150,000) | 22.305 | 3,345,675 |
| 2020072803340 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 150,000 | 22.219 | (3,332,823) |
| 2020082603052 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (100,000) | 22.125 | 2,212,470 |
| 2020082603117 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 100,000 | 22.095 | (2,209,517) |
| 2020082703554 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (110,636) | 22.13 | 2,448,386 |
| 2020082703564 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 110,636 | 22.11 | (2,446,123) |
| 2020090203160 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (50,000) | 22.017 | 1,100,835 |
| 2020090203165 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 50,000 | 21.921 | (1,096,070) |
| 2020091703608 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (100,000) | 21.03 | 2,103,000 |
| 2020091703604 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 100,000 | 20.957 | (2,095,706) |
| 2020092803110 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (4,000,000) | 22.598 | 90,392,000 |
| 2020092803127 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 4,000,000 | 22.579 | (90,315,932) |
| 2020100103392 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (100,000) | 21.934 | 2,193,352 |
| 2020100103397 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | 100,000 | 21.885 | (2,188,500) |
| 2020102803420 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (840,000) | 21.293 | 17,885,809 |
| 2020102803425 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (840,000) | 21.291 | 17,884,759 |
| 2020102803427 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (840,000) | 21.291 | 17,884,180 |
| 2020103003297 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (1,000,000) | 21.225 | 21,225,000 |
| 2020102803121 | FWD | USDMXN | 30/10/2020 | (50,000,000) | 21.16 | 1,058,000,000 |
| 2020102203557 | FWD | EURMXN | 03/11/2020 | 200,000 | 24.821 | (4,964,253) |
| 2020102203529 | FWD | EURMXN | 03/11/2020 | (200,000) | 24.832 | 4,966,300 |
| 2020050703323 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (37,400) | 24.577 | 919,191 |
| 2020050703329 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 37,400 | 24.568 | (918,835) |
| 2020052803582 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (15,930) | 22.78 | 362,885 |
| 2020052803562 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 15,930 | 22.704 | (361,675) |
| 2020060803291 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (15,930) | 22.14 | 352,684 |
| 2020060803266 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 15,930 | 22.034 | (351,008) |
| 2020082803322 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (1,950,000) | 22.055 | 43,006,665 |
| 2020082803266 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 1,950,000 | 22.024 | (42,946,673) |
| 2020090103194 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (100,000) | 21.936 | 2,193,600 |
| 2020090103246 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 100,000 | 21.928 | (2,192,752) |
| 2020090403429 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (30,000) | 21.724 | 651,723 |
| 2020090403451 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 30,000 | 21.703 | (651,091) |
| 2020090903375 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (250,000) | 21.595 | 5,398,725 |
| 2020090903392 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (73,000) | 21.589 | 1,576,012 |
| 2020090903377 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 250,000 | 21.585 | (5,396,314) |
| 2020090903395 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 73,000 | 21.57 | (1,574,623) |
| 2020100103385 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (19,100) | 22.026 | 420,697 |
| 2020100103380 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 19,100 | 21.97 | (419,631) |
| 2020100603446 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (25,850) | 21.797 | 563,452 |
| 2020100603448 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (25,850) | 21.797 | 563,452 |
| 2020100603445 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 25,850 | 21.725 | (561,602) |
| 2020100903493 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (490,000) | 21.232 | 10,403,779 |
| 2020100903568 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (300,000) | 21.275 | 6,382,410 |
| 2020100903594 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (24,800) | 21.277 | 527,670 |
| 2020100903485 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 490,000 | 21.179 | (10,377,710) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020100903572 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 300,000 | 21.234 | (6,370,306) |
| 2020100903590 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 24,800 | 21.201 | (525,790) |
| 2020101303321 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (40,000) | 21.412 | 856,492 |
| 2020101303294 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 40,000 | 21.364 | (854,556) |
| 2020102203126 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (300,000) | 21.024 | 6,307,110 |
| 2020102203554 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (40,000,000) | 21.019 | 840,766,000 |
| 2020102203227 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 300,000 | 21.018 | (6,305,262) |
| 2020102303032 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (40,000) | 21.364 | 854,556 |
| 2020102303045 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (490,000) | 21.179 | 10,377,710 |
| 2020102303570 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (50,000) | 20.975 | 1,048,750 |
| 2020102303576 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 50,000 | 20.891 | (1,044,564) |
| 2020102303601 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 530,000 | 20.912 | (11,083,383) |
| 2020110303034 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (5,000,000) | 21.093 | 105,464,600 |
| 2020110303000 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 30,000,000 | 21.15 | (634,500,000) |
| 2020102203453 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (60,000,000) | 21.004 | 1,260,240,000 |
| 2020102203139 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 60,790,000 | 21.024 | (1,278,055,039) |
| 2020102303021 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 50,000,000 | 20.892 | (1,044,582,500) |
| 2020110303013 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | (30,000,000) | 21.145 | 634,350,000 |
| 2020110303135 | FWD | USDMXN | 03/11/2020 | 30,000,000 | 21.15 | (634,500,000) |
| 2020052603195 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (50,000) | 22.634 | 1,131,675 |
| 2020052603303 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (10,000) | 22.619 | 226,185 |
| 2020052603254 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 60,000 | 22.69 | (1,361,424) |
| 2020060203316 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (500,000) | 22.113 | 11,056,450 |
| 2020060203329 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (50,000) | 22.113 | 1,105,645 |
| 2020060203351 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (5,000) | 22.113 | 110,565 |
| 2020060203307 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 555,000 | 22.156 | (12,296,530) |
| 2020061003338 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (200,000) | 22.426 | 4,485,120 |
| 2020061003388 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (200,000) | 22.426 | 4,485,120 |
| 2020061003346 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 200,000 | 22.409 | (4,481,753) |
| 2020082803567 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (100,000) | 22.071 | 2,207,140 |
| 2020082803586 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 100,000 | 22.041 | (2,204,138) |
| 2020100203236 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 487,600 | 21.68 | (10,571,068) |
| 2020100203238 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 487,000 | 21.794 | (10,613,771) |
| 2020100203246 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 650 | 21.72 | (14,117) |
| 2020102003407 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (250,000) | 21.17 | 5,292,500 |
| 2020102003420 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 250,000 | 21.142 | (5,285,478) |
| 2020103003524 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (500,000) | 21.178 | 10,589,000 |
| 2020110303001 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (30,000,000) | 21.152 | 634,567,500 |
| 2020110303136 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | (30,000,000) | 21.152 | 634,567,500 |
| 2020110303014 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 30,000,000 | 21.147 | (634,414,500) |
| 2020110303019 | FWD | USDMXN | 04/11/2020 | 20,000,000 | 21.15 | (423,000,000) |
| 2020031203090 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (100,000) | 23.193 | 2,319,260 |
| 2020031203163 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 100,000 | 22.554 | (2,255,380) |
| 2020051203090 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (29,000) | 24.568 | 712,462 |
| 2020051203088 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 29,000 | 24.46 | (709,340) |
| 2020082503353 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (34,000) | 22.136 | 752,638 |
| 2020082503335 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 34,000 | 22.07 | (750,388) |
| 2020082803767 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 250,000 | 21.968 | (5,491,934) |
| 2020090303254 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (1,500,000) | 21.738 | 32,606,550 |
| 2020090303262 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 1,500,000 | 21.702 | (32,553,608) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020090403144 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (150,000) | 21.752 | 3,262,725 |
| 2020090403172 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 150,000 | 21.736 | (3,260,375) |
| 2020090703171 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (29,000) | 24.46 | 709,340 |
| 2020090703209 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 29,000 | 21.735 | (630,305) |
| 2020091103352 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (100,000) | 21.402 | 2,140,150 |
| 2020091103382 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 100,000 | 21.412 | (2,141,192) |
| 2020091503414 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (200,000) | 21.292 | 4,258,460 |
| 2020091503433 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 200,000 | 21.211 | (4,242,220) |
| 2020091703332 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (100,000) | 21.112 | 2,111,200 |
| 2020091703365 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 100,000 | 21.101 | (2,110,138) |
| 2020092303244 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (200,000) | 22.31 | 4,461,915 |
| 2020092303185 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 200,000 | 21.292 | (4,258,460) |
| 2020101603390 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (250,000) | 21.261 | 5,315,275 |
| 2020101603434 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 250,000 | 21.149 | (5,287,368) |
| 2020102303658 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 100,000 | 20.892 | (2,089,175) |
| 2020110303264 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (50,000,000) | 21.209 | 1,060,455,500 |
| 2020110303276 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 50,000,000 | 21.21 | (1,060,500,000) |
| 2020110303020 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | (20,000,000) | 21.152 | 423,044,000 |
| 2020110403079 | FWD | USDMXN | 05/11/2020 | 20,000,000 | 21.02 | (420,400,000) |
| 2020010903075 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (391,506) | 19.617 | 7,680,022 |
| 2020010903316 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (1,694) | 19.659 | 33,296 |
| 2020010903020 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 393,200 | 19.605 | (7,708,557) |
| 2020050403149 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (5,050,517) | 25.007 | 126,297,107 |
| 2020050403146 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 5,047,474 | 25.022 | (126,297,107) |
| 2020050503350 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 3,043 | 24.524 | (74,623) |
| 2020060303079 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (100,000) | 22.26 | 2,226,000 |
| 2020060303049 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 100,000 | 22.131 | (2,213,077) |
| 2020071303190 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (27,354,437) | 22.796 | 623,573,169 |
| 2020071303196 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 27,350,060 | 22.8 | (623,573,169) |
| 2020071303327 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 4,377 | 22.88 | (100,140) |
| 2020072803257 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (250,000) | 22.323 | 5,580,625 |
| 2020072803343 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 250,000 | 22.236 | (5,559,103) |
| 2020102303162 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (200,000) | 20.955 | 4,191,040 |
| 2020102303238 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 200,000 | 20.92 | (4,184,047) |
| 2020110403369 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (100,000,000) | 20.912 | 2,091,190,000 |
| 2020110403417 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (100,000,000) | 20.96 | 2,096,000,000 |
| 2020110403448 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (378,000) | 20.98 | 7,930,538 |
| 2020110403452 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 250,000,000 | 21.23 | (5,307,500,000) |
| 2020110503630 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 50,000,000 | 20.89 | (1,044,500,000) |
| 2020110403080 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (20,000,000) | 21.022 | 420,445,700 |
| 2020110403141 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | (17,500,000) | 21.1 | 369,250,000 |
| 2020110503001 | FWD | USDMXN | 06/11/2020 | 20,000,000 | 20.72 | (414,400,000) |
| 2020110903162 | FWD | EURMXN | 09/11/2020 | (1,625) | 24.125 | 39,191 |
| 2020052803583 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (15,930) | 22.788 | 363,013 |
| 2020052803564 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 15,930 | 22.722 | (361,957) |
| 2020060503078 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (40,000) | 22.257 | 890,292 |
| 2020060503225 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 40,000 | 22.204 | (888,170) |
| 2020060803292 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (15,930) | 22.156 | 352,945 |
| 2020060803267 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 15,930 | 22.051 | (351,271) |
| 2020100703252 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 487,000 | 21.552 | (10,495,775) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020100703322 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 625 | 21.59 | (13,494) |
| 2020100903197 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (50,000) | 21.38 | 1,069,005 |
| 2020100903288 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 50,000 | 21.341 | (1,067,026) |
| 2020102303068 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (30,000) | 21.113 | 633,390 |
| 2020102303121 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (50,000) | 21.046 | 1,052,275 |
| 2020102303317 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (26,000) | 20.98 | 545,467 |
| 2020102303248 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 30,000 | 20.977 | (629,322) |
| 2020102303252 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 50,000 | 20.941 | (1,047,067) |
| 2020102303530 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 26,000 | 20.917 | (543,850) |
| 2020102803380 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (466,000) | 21.209 | 9,883,169 |
| 2020102803337 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 88,000 | 21.161 | (1,862,168) |
| 2020102803342 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 105,000 | 21.161 | (2,221,905) |
| 2020102803344 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 89,000 | 21.161 | (1,883,329) |
| 2020102803348 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 95,000 | 21.161 | (2,010,295) |
| 2020102803352 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 89,000 | 21.161 | (1,883,329) |
| 2020110503004 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (50,000,000) | 20.76 | 1,038,000,000 |
| 2020110503390 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (100,000) | 20.773 | 2,077,265 |
| 2020110503797 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (500,000) | 20.73 | 10,365,155 |
| 2020110903180 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (3,000,000) | 20.383 | 61,147,700 |
| 2020110503002 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (20,000,000) | 20.727 | 414,531,500 |
| 2020110503018 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (40,000,000) | 20.71 | 828,400,000 |
| 2020110503655 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 27,870,369 | 20.71 | (577,195,342) |
| 2020110603037 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | (35,000,000) | 20.665 | 723,275,000 |
| 2020110603035 | FWD | USDMXN | 09/11/2020 | 20,000,000 | 20.75 | (415,000,000) |
| 2020102703459 | FWD | EURMXN | 10/11/2020 | 50,000 | 24.887 | (1,244,355) |
| 2020102703414 | FWD | EURMXN | 10/11/2020 | (50,000) | 24.813 | 1,240,650 |
| 2020110603561 | FWD | EURMXN | 10/11/2020 | (200,000) | 24.408 | 4,881,640 |
| 2020110603563 | FWD | EURMXN | 10/11/2020 | (200,000) | 24.408 | 4,881,500 |
| 2020110603565 | FWD | EURMXN | 10/11/2020 | (200,000) | 24.409 | 4,881,700 |
| 2020022803244 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (360,000) | 20.56 | 7,401,507 |
| 2020030603438 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (360,000) | 20.889 | 7,520,177 |
| 2020052103236 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 812,000 | 23.462 | (19,051,211) |
| 2020052103325 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 276 | 23.468 | (6,483) |
| 2020060803132 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (2,800,000) | 21.992 | 61,578,160 |
| 2020060803146 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 2,800,000 | 21.944 | (61,442,038) |
| 2020082803719 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (98,333) | 22 | 2,163,284 |
| 2020082803800 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 98,333 | 21.99 | (2,162,375) |
| 2020090103199 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (250,000) | 21.954 | 5,488,575 |
| 2020090103247 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 250,000 | 21.946 | (5,486,524) |
| 2020091003104 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (50,000) | 21.47 | 1,073,485 |
| 2020091003138 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 50,000 | 21.416 | (1,070,793) |
| 2020100603452 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (23,750) | 21.828 | 518,403 |
| 2020100603451 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 23,750 | 21.755 | (516,689) |
| 2020100803460 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (91) | 21.46 | 1,946 |
| 2020100803244 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 487,716 | 21.455 | (10,463,854) |
| 2020100803253 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 487,625 | 21.514 | (10,490,801) |
| 2020100903336 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (2,000,000) | 21.221 | 42,441,600 |
| 2020100903341 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (1,000,000) | 21.221 | 21,220,800 |
| 2020100903287 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 3,000,000 | 21.217 | (63,651,258) |
| 2020101603605 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (28,450) | 21.259 | 604,819 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020101603599 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 28,450 | 21.186 | (602,736) |
| 2020101903249 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (17,500) | 21.245 | 371,779 |
| 2020101903257 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 17,500 | 21.232 | (371,558) |
| 2020102303028 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (300,000) | 20.938 | 6,281,520 |
| 2020102303211 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 300,000 | 20.928 | (6,278,384) |
| 2020102703301 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (250,000) | 20.961 | 5,240,250 |
| 2020102703373 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 250,000 | 20.947 | (5,236,666) |
| 2020102803133 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (250,000) | 21.17 | 5,292,554 |
| 2020102803382 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (240,000) | 21.211 | 5,090,608 |
| 2020102803116 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 250,000 | 21.954 | (5,488,575) |
| 2020102803360 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 78,000 | 21.163 | (1,650,730) |
| 2020102803363 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 106,000 | 21.163 | (2,243,299) |
| 2020102803369 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 56,000 | 21.163 | (1,185,139) |
| 2020110603317 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (600,000) | 20.632 | 12,379,380 |
| 2020110603319 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (1,100,000) | 20.629 | 22,691,900 |
| 2020110603577 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (25,000) | 20.571 | 514,280 |
| 2020110603579 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (50,000) | 20.571 | 1,028,565 |
| 2020110603581 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (150,000) | 20.572 | 3,085,755 |
| 2020110603583 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (300,000) | 20.578 | 6,173,280 |
| 2020110603585 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (200,000) | 20.577 | 4,115,320 |
| 2020110903139 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 2,000,000 | 20.32 | (40,640,000) |
| 2020110903143 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 1,000,000 | 20.32 | (20,320,000) |
| 2020110603036 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (20,000,000) | 20.752 | 415,042,000 |
| 2020110603038 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 35,000,000 | 20.667 | (723,343,250) |
| 2020110903032 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | (35,000,000) | 20.17 | 705,950,000 |
| 2020110903016 | FWD | USDMXN | 10/11/2020 | 20,000,000 | 20.2 | (404,000,000) |
| 2020031203092 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (100,000) | 23.223 | 2,322,316 |
| 2020031203165 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 100,000 | 22.583 | (2,258,340) |
| 2020052603196 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (50,000) | 22.634 | 1,131,675 |
| 2020052603306 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (10,000) | 22.619 | 226,185 |
| 2020052603255 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 60,000 | 22.714 | (1,362,810) |
| 2020060203317 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (500,000) | 22.113 | 11,056,450 |
| 2020060203330 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (50,000) | 22.113 | 1,105,645 |
| 2020060203352 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (5,000) | 22.113 | 110,565 |
| 2020060203309 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 555,000 | 22.179 | (12,309,540) |
| 2020061003339 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (200,000) | 22.447 | 4,489,460 |
| 2020061003389 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (200,000) | 22.447 | 4,489,460 |
| 2020061003347 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 200,000 | 22.431 | (4,486,113) |
| 2020081803338 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 358,700 | 22.409 | (8,038,221) |
| 2020081803383 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 18 | 22.404 | (414) |
| 2020082803568 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (100,000) | 22.099 | 2,209,850 |
| 2020082803587 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 100,000 | 22.063 | (2,206,272) |
| 2020082803768 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 250,000 | 21.986 | (5,496,599) |
| 2020083103258 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 350,000 | 22.12 | (7,741,888) |
| 2020090103539 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (34,000) | 21.966 | 746,854 |
| 2020090103543 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 34,000 | 21.861 | (743,268) |
| 2020090303257 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (1,500,000) | 21.736 | 32,603,550 |
| 2020090303263 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 1,500,000 | 21.74 | (32,610,644) |
| 2020090403145 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (150,000) | 21.769 | 3,265,410 |
| 2020090403321 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (1,000,000) | 21.805 | 21,804,900 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020090403174 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 150,000 | 21.754 | (3,263,059) |
| 2020090403449 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 1,000,000 | 21.762 | (21,762,084) |
| 2020090803284 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 2,830,702 | 21.86 | (61,880,022) |
| 2020091103353 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (100,000) | 21.419 | 2,141,930 |
| 2020091103384 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 100,000 | 21.433 | (2,143,265) |
| 2020091503415 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (200,000) | 21.31 | 4,261,920 |
| 2020091503216 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 1,718,135 | 21.17 | (36,373,366) |
| 2020091503434 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 200,000 | 21.229 | (4,245,769) |
| 2020091703333 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (100,000) | 21.129 | 2,112,930 |
| 2020091703366 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 100,000 | 21.119 | (2,111,856) |
| 2020092303251 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (200,000) | 22.323 | 4,464,681 |
| 2020092303187 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 200,000 | 21.31 | (4,261,920) |
| 2020101203067 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 487,000 | 21.286 | (10,366,095) |
| 2020101203068 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 625 | 21.28 | (13,300) |
| 2020101203168 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 487,000 | 21.287 | (10,366,584) |
| 2020101203169 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 625 | 21.28 | (13,300) |
| 2020101603396 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (250,000) | 21.279 | 5,319,650 |
| 2020101603433 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 250,000 | 21.166 | (5,291,612) |
| 2020102303659 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 100,000 | 20.909 | (2,090,866) |
| 2020102703450 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (90) | 21.024 | 1,892 |
| 2020102703196 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 5,000,000 | 20.924 | (104,621,895) |
| 2020102703197 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 5,000,000 | 20.926 | (104,628,395) |
| 2020102703220 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 10,731,985 | 20.924 | (224,559,526) |
| 2020102903350 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 1,000,000 | 21.375 | (21,374,735) |
| 2020102903546 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 41,205 | 21.408 | (882,112) |
| 2020110303357 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 14,585,000 | 21.217 | (309,456,815) |
| 2020110303409 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 502 | 21.274 | (10,676) |
| 2020110503090 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (100,000) | 22.583 | 2,258,340 |
| 2020110503682 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (2,815,115) | 20.711 | 58,304,134 |
| 2020110503391 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 100,000 | 20.779 | (2,077,939) |
| 2020110903189 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (300,000) | 20.369 | 6,110,700 |
| 2020110903249 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (100,000) | 20.358 | 2,035,770 |
| 2020110903252 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (100,000) | 20.36 | 2,035,990 |
| 2020110903257 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (200,000) | 20.358 | 4,071,580 |
| 2020110903262 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (144,000) | 20.355 | 2,931,091 |
| 2020110903268 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (138,000) | 20.358 | 2,809,459 |
| 2020110903271 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (1,130,000) | 20.359 | 23,005,896 |
| 2020111003210 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (300,000) | 20.389 | 6,116,820 |
| 2020111203112 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (1,000,000) | 20.504 | 20,503,916 |
| 2020110903017 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (20,000,000) | 20.204 | 404,082,000 |
| 2020110903033 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 35,000,000 | 20.174 | (706,090,000) |
| 2020110903041 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 1,000,000 | 20.235 | (20,235,000) |
| 2020111003015 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | (38,000,000) | 20.43 | 776,340,000 |
| 2020111003005 | FWD | USDMXN | 12/11/2020 | 23,000,000 | 20.42 | (469,660,000) |
| 2020010303146 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (6,600,000) | 19.726 | 130,188,300 |
| 2020010303141 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 6,600,000 | 19.725 | (130,181,687) |
| 2020021203437 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (220,000) | 19.359 | 4,258,958 |
| 2020021203455 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 220,000 | 19.346 | (4,256,057) |
| 2020022803522 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.649 | 2,064,851 |
| 2020022803558 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 100,000 | 20.475 | (2,047,520) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020030903280 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 22.121 | 2,212,124 |
| 2020030903353 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 100,000 | 22.059 | (2,205,870) |
| 2020060303080 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 22.28 | 2,228,030 |
| 2020060303050 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 100,000 | 22.151 | (2,215,066) |
| 2020072803258 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (250,000) | 22.34 | 5,585,100 |
| 2020072803341 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 250,000 | 22.254 | (5,563,501) |
| 2020081203190 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (1,000,000) | 22.595 | 22,595,300 |
| 2020081203225 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (1,000,000) | 22.595 | 22,595,300 |
| 2020081203305 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 1,000,000 | 22.592 | (22,591,532) |
| 2020082403017 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (1,000,000) | 22.15 | 22,150,000 |
| 2020082403014 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 1,000,000 | 22.14 | (22,139,842) |
| 2020101303314 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 487,625 | 21.398 | (10,434,425) |
| 2020102303167 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (200,000) | 20.973 | 4,194,600 |
| 2020102303240 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 200,000 | 20.937 | (4,187,414) |
| 2020102703421 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (40,000,000) | 21.016 | 840,632,000 |
| 2020102803381 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (169,000) | 21.218 | 3,585,825 |
| 2020102803370 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 92,000 | 21.17 | (1,947,658) |
| 2020102803374 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 77,000 | 21.17 | (1,630,105) |
| 2020103003470 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (500,000) | 21.238 | 10,618,750 |
| 2020103003525 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 500,000 | 21.199 | (10,599,563) |
| 2020110403306 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (250,000) | 20.999 | 5,249,750 |
| 2020110403329 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (50,000) | 20.999 | 1,049,950 |
| 2020110403339 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 250,000 | 20.956 | (5,239,116) |
| 2020110403344 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 50,000 | 20.946 | (1,047,318) |
| 2020111003301 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (240,000) | 20.334 | 4,880,208 |
| 2020111003303 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (214,000) | 20.336 | 4,351,925 |
| 2020111003305 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (197,000) | 20.337 | 4,006,428 |
| 2020111003483 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.347 | 2,034,700 |
| 2020111003485 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.347 | 2,034,700 |
| 2020111003487 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.347 | 2,034,700 |
| 2020111003490 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.347 | 2,034,700 |
| 2020111003492 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.347 | 2,034,700 |
| 2020111003496 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.347 | 2,034,700 |
| 2020111003498 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.348 | 2,034,750 |
| 2020111003500 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.348 | 2,034,750 |
| 2020111003502 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.348 | 2,034,800 |
| 2020111003504 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.348 | 2,034,800 |
| 2020111003507 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.348 | 2,034,800 |
| 2020111003510 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.348 | 2,034,800 |
| 2020111003512 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (100,000) | 20.347 | 2,034,725 |
| 202011103392 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 1,000,000 | 20.504 | (20,504,200) |
| 2020101403268 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (86,670,000) | 21.358 | 1,851,080,526 |
| 2020101403300 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 30,000,000 | 21.403 | (642,088,047) |
| 2020102803122 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 50,000,000 | 21.193 | (1,059,655,000) |
| 2020110503656 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (27,870,369) | 20.719 | 577,432,240 |
| 2020111003006 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (23,000,000) | 20.422 | 469,711,980 |
| 2020111003016 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 38,000,000 | 20.432 | (776,421,700) |
| 2020111003029 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 55,000,000 | 20.4 | (1,122,000,000) |
| 2020111203018 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (19,459,631) | 20.55 | 399,895,417 |
| 2020111203137 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 24,000,000 | 20.51 | (492,240,000) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020111303038 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | (55,000,000) | 20.52 | 1,128,600,000 |
| 2020111303018 | FWD | USDMXN | 13/11/2020 | 25,000,000 | 20.49 | (512,250,000) |
| 2020110903052 | FWD | EURMXN | 17/11/2020 | 330,000 | 24.006 | (7,921,850) |
| 2020110903056 | FWD | EURMXN | 17/11/2020 | (330,000) | 24.028 | 7,929,240 |
| 2020111303321 | FWD | EURMXN | 17/11/2020 | 330,000 | 24.16 | (7,972,800) |
| 2020111303315 | FWD | EURMXN | 17/11/2020 | (330,000) | 24.161 | 7,973,080 |
| 2020040603103 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (300,000) | 25.599 | 7,679,607 |
| 2020040603109 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 300,000 | 25.45 | (7,635,000) |
| 2020050703233 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (250,000) | 24.72 | 6,180,000 |
| 2020050703240 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 250,000 | 24.607 | (6,151,673) |
| 2020052103310 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (50,000) | 23.585 | 1,179,250 |
| 2020052103331 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 50,000 | 23.506 | (1,175,305) |
| 2020052803584 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (15,930) | 22.821 | 363,539 |
| 2020052803565 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 15,930 | 22.739 | (362,232) |
| 2020060503079 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (40,000) | 22.281 | 891,220 |
| 2020060503230 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 40,000 | 22.227 | (889,095) |
| 2020060803293 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (15,930) | 22.179 | 353,304 |
| 2020060803268 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 15,930 | 22.073 | (351,627) |
| 2020081403317 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (500,000) | 22.268 | 11,134,000 |
| 2020081403312 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 500,000 | 22.258 | (11,129,153) |
| 2020081703251 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (200,000) | 22.199 | 4,439,740 |
| 2020081703255 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (200,000) | 22.229 | 4,445,740 |
| 2020081703257 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 200,000 | 22.144 | (4,428,727) |
| 2020081703258 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 200,000 | 22.174 | (4,434,794) |
| 2020090103205 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (150,000) | 21.973 | 3,295,905 |
| 2020090103248 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 150,000 | 21.965 | (3,294,701) |
| 2020091703581 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (50,000) | 21.083 | 1,054,150 |
| 2020091703585 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 50,000 | 21.056 | (1,052,792) |
| 2020100903346 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (6,000,000) | 21.259 | 127,554,000 |
| 2020100903468 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (2,000,000) | 21.254 | 42,508,000 |
| 2020100903301 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 6,000,000 | 21.259 | (127,552,320) |
| 2020100903465 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 2,000,000 | 21.251 | (42,501,260) |
| 2020101403539 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (19,150) | 21.466 | 411,074 |
| 2020101403397 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 487,000 | 21.413 | (10,428,250) |
| 2020101403411 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 625 | 21.413 | (13,381) |
| 2020101403538 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 19,150 | 21.399 | (409,790) |
| 2020101503067 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (14,300) | 21.549 | 308,151 |
| 2020101503063 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 14,300 | 21.499 | (307,434) |
| 2020101603350 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (12,550) | 21.256 | 266,763 |
| 2020101603346 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 12,550 | 21.183 | (265,846) |
| 2020101903251 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (11,500) | 21.262 | 244,511 |
| 2020101903399 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (3,000,000) | 21.33 | 63,989,700 |
| 2020101903255 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 11,500 | 21.249 | (244,358) |
| 2020101903407 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 3,000,000 | 21.321 | (63,961,757) |
| 2020102303123 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (50,000) | 21.065 | 1,053,255 |
| 2020102303251 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 50,000 | 20.96 | (1,048,022) |
| 2020102803135 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (150,000) | 21.19 | 3,178,556 |
| 2020102803383 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (382,000) | 21.228 | 8,108,905 |
| 2020102803120 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 150,000 | 21.973 | (3,295,905) |
| 2020102803376 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 105,000 | 21.18 | (2,223,890) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020102803377 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 91,000 | 21.18 | (1,927,371) |
| 2020102803378 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 91,000 | 21.18 | (1,927,371) |
| 2020102803379 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 95,000 | 21.18 | (2,012,091) |
| 2020110903080 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (2,000,000) | 20.302 | 40,604,000 |
| 2020111303287 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (2,000,000) | 20.432 | 40,863,815 |
| 2020111303295 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (6,000,000) | 20.431 | 122,583,945 |
| 2020111303305 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (3,000,000) | 20.424 | 61,272,240 |
| 2020111303291 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 2,000,000 | 20.43 | (40,860,000) |
| 2020111303300 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 6,000,000 | 20.43 | (122,580,000) |
| 2020111303309 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 3,000,000 | 20.43 | (61,290,000) |
| 2020101403279 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (87,130,000) | 21.367 | 1,861,741,562 |
| 2020101403305 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 30,000,000 | 21.409 | (642,278,421) |
| 2020101403309 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 115,000,000 | 21.412 | (2,462,380,000) |
| 2020111003030 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (55,000,000) | 20.408 | 1,122,462,000 |
| 2020111203138 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (24,000,000) | 20.519 | 492,447,600 |
| 2020111203019 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 19,459,631 | 20.559 | (400,061,797) |
| 2020111203026 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 1,000,000 | 20.56 | (20,559,700) |
| 2020111303019 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (25,000,000) | 20.499 | 512,470,000 |
| 2020111303024 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | (13,329,631) | 20.485 | 273,057,491 |
| 2020111303006 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 30,000,000 | 20.5 | (615,000,000) |
| 2020111303039 | FWD | USDMXN | 17/11/2020 | 55,000,000 | 20.529 | (1,129,078,500) |
| 2020050703312 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (1) | 24.511 | 25 |
| 2020060203318 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (500,000) | 22.113 | 11,056,450 |
| 2020060203333 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (50,000) | 22.113 | 1,105,645 |
| 2020060203357 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (5,000) | 22.113 | 110,565 |
| 2020060203311 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | 555,000 | 22.197 | (12,319,298) |
| 2020061003340 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (200,000) | 22.464 | 4,492,720 |
| 2020061003390 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (200,000) | 22.464 | 4,492,720 |
| 2020061003348 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | 200,000 | 22.447 | (4,489,453) |
| 2020072803138 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (310,434) | 22.387 | 6,949,686 |
| 2020072803262 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | 310,434 | 22.287 | (6,918,638) |
| 2020082803574 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (100,000) | 22.111 | 2,211,050 |
| 2020082803588 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | 100,000 | 22.079 | (2,207,873) |
| 2020090903478 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (34,000) | 21.728 | 738,749 |
| 2020090903466 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | 34,000 | 21.653 | (736,185) |
| 2020101503207 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | 485,000 | 21.438 | (10,397,387) |
| 2020101503355 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | 2,625 | 21.381 | (56,126) |
| 2020111303007 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | (30,000,000) | 20.502 | 615,072,000 |
| 2020111303025 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | 13,329,631 | 20.487 | (273,088,816) |
| 2020111703002 | FWD | USDMXN | 18/11/2020 | 30,000,000 | 20.34 | (610,200,000) |
| 2020031203094 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (100,000) | 23.251 | 2,325,106 |
| 2020031203169 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 100,000 | 22.613 | (2,261,300) |
| 2020040103332 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (30,000,000) | 25.15 | 754,500,000 |
| 2020040103411 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 30,000,000 | 25.061 | (751,836,000) |
| 2020072103171 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (100,000) | 22.845 | 2,284,500 |
| 2020072103189 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 100,000 | 22.635 | (2,263,506) |
| 2020082803769 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 250,000 | 22.005 | (5,501,264) |
| 2020090403147 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (100,000) | 21.787 | 2,178,710 |
| 2020090403567 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (1,500,000) | 21.731 | 32,596,050 |
| 2020090403173 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 100,000 | 21.771 | (2,177,134) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020090403574 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 1,500,000 | 21.697 | (32,544,863) |
| 2020091103354 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (100,000) | 21.437 | 2,143,710 |
| 2020091103385 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 100,000 | 21.449 | (2,144,943) |
| 2020091503416 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (200,000) | 21.327 | 4,265,360 |
| 2020091503435 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 200,000 | 21.246 | (4,249,298) |
| 2020091703334 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (100,000) | 21.147 | 2,114,650 |
| 2020091703364 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 100,000 | 21.136 | (2,113,576) |
| 2020092303253 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (200,000) | 22.334 | 4,466,840 |
| 2020092303188 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 200,000 | 21.327 | (4,265,360) |
| 2020101603392 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (250,000) | 21.295 | 5,323,700 |
| 2020101603435 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 250,000 | 21.183 | (5,295,858) |
| 2020102303660 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 100,000 | 20.925 | (2,092,534) |
| 2020111703113 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (240,000) | 20.334 | 4,880,141 |
| 2020111703117 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (240,000) | 20.33 | 4,879,109 |
| 2020111703121 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (214,000) | 20.332 | 4,351,127 |
| 2020111703123 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (214,000) | 20.338 | 4,352,379 |
| 2020111703125 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (197,000) | 20.34 | 4,006,885 |
| 2020111703128 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (197,000) | 20.343 | 4,007,585 |
| 2020111703421 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (600,000) | 20.268 | 12,160,872 |
| 2020111703003 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (30,000,000) | 20.342 | 610,270,500 |
| 2020111803021 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | (28,329,631) | 20.245 | 573,533,380 |
| 2020111803017 | FWD | USDMXN | 19/11/2020 | 30,000,000 | 20.26 | (607,800,000) |
| 2020060303084 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (100,000) | 22.301 | 2,230,050 |
| 2020060303051 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 100,000 | 22.171 | (2,217,054) |
| 2020072803266 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (250,000) | 22.359 | 5,589,625 |
| 2020072803342 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 250,000 | 22.272 | (5,567,900) |
| 2020100103211 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (30,000) | 22.087 | 662,613 |
| 2020100103218 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 30,000 | 22.012 | (660,358) |
| 2020101903455 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 487,625 | 21.295 | (10,383,910) |
| 2020102103103 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (300,000) | 21.153 | 6,345,960 |
| 2020102103123 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 300,000 | 21.105 | (6,331,602) |
| 2020102303173 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (200,000) | 21 | 4,199,920 |
| 2020102303318 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (25,000) | 21.007 | 525,173 |
| 2020102303239 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 200,000 | 20.954 | (4,190,747) |
| 2020102303532 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 25,000 | 20.944 | (523,590) |
| 2020102603330 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (50,000) | 21.089 | 1,054,435 |
| 2020102603342 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 50,000 | 21.049 | (1,052,433) |
| 2020111103393 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (1,000,000) | 20.519 | 20,518,637 |
| 2020111203508 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (770,000) | 20.639 | 15,892,030 |
| 2020111203502 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 770,000 | 20.604 | (15,865,433) |
| 2020111803126 | FWD | MXNUSD | 20/11/2020 | 200,000,000 | 20.234 | (9,884,148) |
| 2020111803143 | FWD | MXNUSD | 20/11/2020 | 18,000,000 | 20.244 | (889,157) |
| 2020111803165 | FWD | MXNUSD | 20/11/2020 | 182,000,000 | 20.244 | (8,990,407) |
| 2020111803152 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 9,881,423 | 20.24 | (200,000,000) |
| 2020111803157 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 9,878,982 | 20.245 | (200,000,000) |
| 2020111903065 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 2,000,000 | 20.232 | (40,463,428) |
| 2020111903549 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 770,000 | 20.639 | (15,892,030) |
| 2020111803018 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | (30,000,000) | 20.262 | 607,869,000 |
| 2020111803022 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 28,329,631 | 20.247 | (573,595,705) |
| 2020111803289 | FWD | USDMXN | 20/11/2020 | 16,670,369 | 20.198 | (336,708,113) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020111903634 | FWD | EURMXN | 23/11/2020 | (150,000) | 23.912 | 3,586,845 |
| 2020111903639 | FWD | EURMXN | 23/11/2020 | (150,000) | 23.908 | 3,586,230 |
| 2020052703126 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | (4,000,000) | 22.995 | 91,979,600 |
| 2020052703116 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 4,000,000 | 23.023 | (92,090,000) |
| 2020060203178 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | (21,417,000) | 22.206 | 475,585,902 |
| 2020060203180 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | (3,540,000) | 22.203 | 78,598,620 |
| 2020060203189 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 24,957,000 | 22.142 | (552,597,894) |
| 2020060503080 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | (40,000) | 22.298 | 891,916 |
| 2020060503237 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 40,000 | 22.245 | (889,788) |
| 2020060803294 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | (15,930) | 22.195 | 353,573 |
| 2020060803269 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 15,930 | 22.09 | (351,895) |
| 2020102003144 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 487,000 | 21.139 | (10,294,525) |
| 2020102003282 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 625 | 21.146 | (13,216) |
| 2020102103108 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | (350,000) | 21.16 | 7,406,105 |
| 2020102103122 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 350,000 | 21.112 | (7,389,363) |
| 2020102203353 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | (30,000) | 21.068 | 632,040 |
| 2020102203355 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 30,000 | 21.034 | (631,022) |
| 2020102303050 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | (50,000) | 20.987 | 1,049,340 |
| 2020102303212 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 50,000 | 20.952 | (1,047,598) |
| 2020110503441 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | (32,000) | 21.035 | 673,117 |
| 2020110503454 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 32,000 | 20.887 | (668,399) |
| 2020112303447 | FWD | USDMXN | 23/11/2020 | 500,000 | 20.15 | (10,075,000) |
| 2020102203564 | FWD | EURMXN | 24/11/2020 | (100) | 24.869 | 2,487 |
| 2020102303543 | FWD | EURMXN | 24/11/2020 | 281,000 | 24.855 | (6,984,179) |
| 2020102303709 | FWD | EURMXN | 24/11/2020 | 270,000 | 24.85 | (6,709,558) |
| 2020102703460 | FWD | EURMXN | 24/11/2020 | (50,000) | 24.933 | 1,246,626 |
| 2020102703461 | FWD | EURMXN | 24/11/2020 | (50,000) | 24.823 | 1,241,133 |
| 2020102703463 | FWD | EURMXN | 24/11/2020 | (450,900) | 24.822 | 11,192,072 |
| 2020090103053 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (300,000) | 21.973 | 6,591,930 |
| 2020090103208 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (150,000) | 21.991 | 3,298,665 |
| 2020090103084 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 300,000 | 21.929 | (6,578,797) |
| 2020090103249 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 150,000 | 21.983 | (3,297,487) |
| 2020100803404 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (275,000) | 21.492 | 5,910,351 |
| 2020100803462 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (539) | 21.496 | 11,595 |
| 2020102103169 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 487,000 | 21.159 | (10,304,650) |
| 2020102103300 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 625 | 21.161 | (13,226) |
| 2020102103340 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 487,625 | 21.162 | (10,319,262) |
| 2020102203505 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (621,000) | 21.097 | 13,101,393 |
| 2020102203512 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (18,600) | 21.169 | 393,743 |
| 2020102203565 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (100) | 21.028 | 2,103 |
| 2020102203504 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 18,600 | 21.101 | (392,479) |
| 2020102803138 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (150,000) | 21.208 | 3,181,193 |
| 2020102803124 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 150,000 | 21.991 | (3,298,665) |
| 2020103003177 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (115,500) | 21.318 | 2,462,241 |
| 2020103003184 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 115,500 | 21.304 | (2,460,585) |
| 2020110303471 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (10,000) | 21.432 | 214,323 |
| 2020110303461 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 10,000 | 21.35 | (213,504) |
| 2020111203513 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (1,000,000) | 20.612 | 20,611,980 |
| 2020111203520 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (43,277) | 20.665 | 894,322 |
| 2020112303448 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (500,000) | 20.152 | 10,076,150 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020112403043 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 15,250,000 | 20.08 | (306,220,000) |
| 2020112403476 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 1,000,000 | 20.03 | (20,030,000) |
| 2020110403142 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 17,500,000 | 21.141 | (369,962,250) |
| 2020111803290 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (16,670,369) | 20.207 | 336,853,145 |
| 2020112303019 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | (36,000,000) | 20.03 | 721,080,000 |
| 2020112303021 | FWD | USDMXN | 24/11/2020 | 36,000,000 | 20.03 | (721,080,000) |
| 2020110403284 | FWD | CADMXN | 25/11/2020 | 500,000 | 16.015 | (8,007,270) |
| 2020110403314 | FWD | CADMXN | 25/11/2020 | (500,000) | 16.01 | 8,005,218 |
| 2020111003046 | FWD | CADUSD | 25/11/2020 | 3,000,000 | 1.302 | (2,304,138) |
| 2020111003060 | FWD | CADUSD | 25/11/2020 | (3,000,000) | 1.302 | 2,304,134 |
| 2020102003236 | FWD | EURMXN | 25/11/2020 | 126,798 | 25.04 | (3,175,063) |
| 2020022103265 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (230,000) | 19.584 | 4,504,258 |
| 2020022103337 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (1,000) | 19.602 | 19,602 |
| 2020031203096 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (100,000) | 23.272 | 2,327,249 |
| 2020031203174 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 100,000 | 22.638 | (2,263,840) |
| 2020060203319 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (500,000) | 22.113 | 11,056,450 |
| 2020060203335 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (50,000) | 22.113 | 1,105,645 |
| 2020060203360 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (5,000) | 22.113 | 110,565 |
| 2020060203313 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 555,000 | 22.217 | (12,330,682) |
| 2020060803223 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (2,500,000) | 22.032 | 55,080,000 |
| 2020060803249 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 2,500,000 | 21.98 | (54,950,585) |
| 2020061003341 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (200,000) | 22.483 | 4,496,520 |
| 2020061003391 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (200,000) | 22.483 | 4,496,520 |
| 2020061003349 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 200,000 | 22.467 | (4,493,352) |
| 2020062603346 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (2,500,000) | 23.389 | 58,471,260 |
| 2020062603217 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 2,500,000 | 22.032 | (55,080,000) |
| 2020082503227 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (200,000) | 22.198 | 4,439,600 |
| 2020082503228 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (250,000) | 22.178 | 5,544,500 |
| 2020082503233 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 200,000 | 22.142 | (4,428,372) |
| 2020082503234 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 250,000 | 22.16 | (5,539,941) |
| 2020082803579 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (100,000) | 22.133 | 2,213,300 |
| 2020082803721 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (98,333) | 22.04 | 2,167,217 |
| 2020082803589 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 100,000 | 22.097 | (2,209,741) |
| 2020082803801 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 98,333 | 22.03 | (2,166,311) |
| 2020090403150 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (100,000) | 21.802 | 2,180,170 |
| 2020090403175 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 100,000 | 21.786 | (2,178,643) |
| 2020091103355 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (200,000) | 21.452 | 4,290,420 |
| 2020091103388 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 200,000 | 21.466 | (4,293,230) |
| 2020091703335 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (100,000) | 21.161 | 2,116,110 |
| 2020091703367 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 100,000 | 21.151 | (2,115,050) |
| 2020101303191 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 763,000 | 21.448 | (16,364,855) |
| 2020101303218 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 640 | 21.447 | (13,717) |
| 2020102203364 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 487,625 | 21.035 | (10,257,209) |
| 2020102303189 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (250,000) | 21.067 | 5,266,625 |
| 2020102303196 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 250,000 | 20.966 | (5,241,427) |
| 2020110303359 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (17,800,000) | 21.247 | 378,198,701 |
| 2020110303360 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (52,654) | 21.282 | 1,120,581 |
| 2020111803113 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (104,996) | 20.258 | 2,127,023 |
| 2020111803078 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 105,000 | 20.248 | (2,126,040) |
| 2020112403044 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (15,250,000) | 20.083 | 306,258,888 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020112503091 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (9,000,000) | 20.07 | 180,625,554 |
| 2020112503212 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (15,000,000) | 20.015 | 300,225,000 |
| 2020112503230 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 15,200,000 | 20.01 | (304,152,000) |
| 2020112303022 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (36,000,000) | 20.032 | 721,166,400 |
| 2020112303392 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (101,035,230) | 20.16 | 2,036,870,227 |
| 2020112303020 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 36,000,000 | 20.032 | (721,166,400) |
| 2020112303216 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 50,000,000 | 20.123 | (1,006,150,000) |
| 2020112303368 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 100,000,000 | 20.13 | (2,013,000,000) |
| 2020112303370 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | 50,000,000 | 20.13 | (1,006,500,000) |
| 2020112403016 | FWD | USDMXN | 25/11/2020 | (100,000,000) | 20.05 | 2,005,000,000 |
| 2020051903315 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (150,000) | 24.23 | 3,634,500 |
| 2020051903319 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 150,000 | 24.177 | (3,626,517) |
| 2020060203282 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (60,000) | 22.267 | 1,335,990 |
| 2020060203332 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 60,000 | 22.231 | (1,333,840) |
| 2020060303087 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (100,000) | 22.321 | 2,232,070 |
| 2020060303053 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 100,000 | 22.19 | (2,219,042) |
| 2020071503135 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (100,000) | 22.76 | 2,276,000 |
| 2020071503170 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 100,000 | 22.666 | (2,266,632) |
| 2020072803268 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (250,000) | 22.376 | 5,594,100 |
| 2020072803344 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 250,000 | 22.289 | (5,572,298) |
| 2020082803770 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 250,000 | 22.026 | (5,506,595) |
| 2020090203161 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (50,000) | 22.089 | 1,104,470 |
| 2020090203166 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 50,000 | 21.994 | (1,099,692) |
| 2020090403571 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (1,500,000) | 21.732 | 32,597,850 |
| 2020090403575 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 1,500,000 | 21.737 | (32,604,960) |
| 2020091003148 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (34,000) | 21.601 | 734,441 |
| 2020091003206 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 34,000 | 21.466 | (729,834) |
| 2020101603549 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (2,000,000) | 21.237 | 42,474,800 |
| 2020101603578 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 2,000,000 | 21.189 | (42,378,514) |
| 2020102003383 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (2,000,000) | 21.22 | 42,439,800 |
| 2020102003402 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 2,000,000 | 21.174 | (42,348,728) |
| 2020102303178 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (200,000) | 21.016 | 4,203,260 |
| 2020102303241 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 200,000 | 20.97 | (4,194,084) |
| 2020102303661 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 100,000 | 20.944 | (2,094,443) |
| 2020102603056 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (50,000) | 21.117 | 1,055,850 |
| 2020102603149 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 50,000 | 21.06 | (1,052,990) |
| 2020102603259 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 487,625 | 21.023 | (10,251,163) |
| 2020102703258 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (25,000) | 20.989 | 524,725 |
| 2020102703381 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 25,000 | 20.952 | (523,806) |
| 2020110403403 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (150,000) | 21.033 | 3,154,890 |
| 2020110503750 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (100,000) | 20.772 | 2,077,150 |
| 2020110503796 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 100,000 | 20.747 | (2,074,670) |
| 2020111803186 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (105,000) | 20.247 | 2,125,983 |
| 2020111803375 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (675) | 20.277 | 13,690 |
| 2020111803189 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 105,675 | 20.241 | (2,138,968) |
| 2020112403477 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (1,000,000) | 20.038 | 20,038,100 |
| 2020112503192 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (115,000,000) | 20 | 2,300,000,000 |
| 2020112503197 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (115,000,000) | 20 | 2,300,000,000 |
| 2020112503231 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (15,200,000) | 20.015 | 304,226,480 |
| 2020112503237 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (500,000) | 20.01 | 10,005,000 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020112503287 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (100,000,000) | 20.09 | 2,009,000,000 |
| 2020112503447 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (100,000,000) | 20.09 | 2,009,000,000 |
| 2020112503537 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (100,000,000) | 20.09 | 2,009,000,000 |
| 2020112503206 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 15,200,000 | 20.01 | (304,152,000) |
| 2020112503213 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 15,000,000 | 20.02 | (300,294,000) |
| 2020112503245 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 100,000,000 | 20.09 | (2,009,000,000) |
| 2020112703497 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (25,000,000) | 20.07 | 501,750,000 |
| 2020112303177 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (84,148,783) | 20.105 | 1,691,811,280 |
| 2020112303393 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 101,035,230 | 20.165 | (2,037,375,403) |
| 2020112403046 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (66,886,447) | 20.085 | 1,343,414,280 |
| 2020112403333 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | (50,000,000) | 20.043 | 1,002,150,000 |
| 2020112403017 | FWD | USDMXN | 27/11/2020 | 100,000,000 | 20.055 | (2,005,490,000) |
| 2020031203117 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (100,000) | 23.241 | 2,324,062 |
| 2020031203140 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 100,000 | 23.01 | (2,301,000) |
| 2020031803374 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (100,000) | 24.794 | 2,479,442 |
| 2020031803348 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 100,000 | 24.612 | (2,461,220) |
| 2020060503119 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (10,000,000) | 22.139 | 221,390,000 |
| 2020060503177 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 10,000,000 | 22.1 | (220,999,400) |
| 2020060803295 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (15,930) | 22.215 | 353,888 |
| 2020060803270 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 15,930 | 22.11 | (352,208) |
| 2020061803351 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (10,000,000) | 23.179 | 231,789,340 |
| 2020061803310 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 10,000,000 | 22.139 | (221,390,000) |
| 2020070203258 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (41,700) | 22.943 | 956,736 |
| 2020070203280 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (200) | 22.903 | 4,581 |
| 2020070203277 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 41,900 | 22.935 | (960,993) |
| 2020070903232 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (31,490) | 23.09 | 727,093 |
| 2020070903230 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 31,490 | 23.088 | (727,046) |
| 2020082703556 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (1,300,315) | 22.213 | 28,883,646 |
| 2020082703566 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 1,300,315 | 22.191 | (28,855,935) |
| 2020082803580 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (100,000) | 22.147 | 2,214,650 |
| 2020082803590 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 100,000 | 22.111 | (2,211,076) |
| 2020090203177 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 10,000 | 22 | (220,003) |
| 2020090803343 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (10,000) | 21.915 | 219,151 |
| 2020102703372 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 475,250 | 20.968 | (9,965,182) |
| 2020110503418 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (45,000) | 20.979 | 944,055 |
| 2020110503446 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (42,000) | 21.05 | 884,096 |
| 2020110503343 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 45,000 | 20.874 | (939,331) |
| 2020110503455 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 40,000 | 20.903 | (836,126) |
| 2020110503458 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 1,999 | 20.795 | (41,579) |
| 2020111003391 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (100,000) | 20.475 | 2,047,520 |
| 2020111003400 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (100,000) | 24.612 | 2,461,220 |
| 2020111003484 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 100,000 | 20.384 | (2,038,382) |
| 2020111903122 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 1,000,000 | 20.199 | (20,198,570) |
| 2020112003000 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (1,000,000) | 20.263 | 20,262,808 |
| 2020112503207 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (15,200,000) | 20.018 | 304,270,560 |
| 2020112503246 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (100,000,000) | 20.098 | 2,009,780,000 |
| 2020112503193 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 115,000,000 | 20.008 | (2,300,874,000) |
| 2020112503198 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 115,000,000 | 20.008 | (2,300,874,000) |
| 2020112503238 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 500,000 | 20.018 | (10,008,850) |
| 2020112503288 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 100,000,000 | 20.098 | (2,009,780,000) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020112503448 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 100,000,000 | 20.098 | (2,009,780,000) |
| 2020112503515 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 235,000 | 19.977 | (4,694,604) |
| 2020112503538 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 100,000,000 | 20.098 | (2,009,780,000) |
| 2020112703498 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 25,000,000 | 20.077 | (501,930,000) |
| 2020113003358 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (1,300,000) | 20.13 | 26,169,000 |
| 2020113003360 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (500,000) | 20.13 | 10,065,000 |
| 2020112403047 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | 66,886,447 | 20.093 | (1,343,919,273) |
| 2020112703004 | FWD | USDMXN | 30/11/2020 | (66,886,447) | 20.05 | 1,341,073,255 |
| 2020102203556 | FWD | EURMXN | 01/12/2020 | 200,000 | 24.915 | (4,983,007) |
| 2020102203530 | FWD | EURMXN | 01/12/2020 | (200,000) | 24.925 | 4,985,080 |
| 2020111303316 | FWD | EURMXN | 01/12/2020 | 330,000 | 24.206 | (7,987,972) |
| 2020111303322 | FWD | EURMXN | 01/12/2020 | (330,000) | 24.209 | 7,988,970 |
| 2020113003179 | FWD | EURMXN | 01/12/2020 | 330,000 | 24.076 | (7,945,080) |
| 2020113003215 | FWD | EURMXN | 01/12/2020 | (330,000) | 24.072 | 7,943,922 |
| 2020100903571 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (300,000) | 21.275 | 6,382,410 |
| 2020100903676 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (20,500) | 21.307 | 436,794 |
| 2020100903474 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | 20,500 | 21.292 | (436,494) |
| 2020100903573 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | 300,000 | 21.301 | (6,390,265) |
| 2020101603351 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (41,500) | 21.235 | 881,248 |
| 2020101603359 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | 41,500 | 21.222 | (880,703) |
| 2020102203129 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (300,000) | 21.091 | 6,327,300 |
| 2020102203226 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | 300,000 | 21.084 | (6,325,318) |
| 2020102803419 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (20,350) | 21.43 | 436,101 |
| 2020102903083 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | 20,350 | 21.359 | (434,647) |
| 2020112703531 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (50,000) | 20.057 | 1,002,837 |
| 2020112703533 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (50,000) | 20.057 | 1,002,837 |
| 2020112703535 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (50,000) | 20.057 | 1,002,837 |
| 2020112703537 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (50,000) | 20.057 | 1,002,837 |
| 2020112703539 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (50,000) | 20.056 | 1,002,775 |
| 2020112703541 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (50,000) | 20.056 | 1,002,775 |
| 2020112303182 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (82,702,734) | 20.125 | 1,664,351,163 |
| 2020112403334 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | 50,000,000 | 20.053 | (1,002,635,000) |
| 2020112703005 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | 66,886,447 | 20.052 | (1,341,233,782) |
| 2020113003003 | FWD | USDMXN | 01/12/2020 | (34,183,713) | 20.07 | 686,067,120 |
| 2020030503332 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | (500,000) | 20.741 | 10,370,401 |
| 2020030503360 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 500,000 | 20.66 | (10,330,000) |
| 2020030603381 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | (500,000) | 21.097 | 10,548,591 |
| 2020030603380 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 500,000 | 21.002 | (10,501,000) |
| 2020090103102 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | (250,000) | 21.955 | 5,488,750 |
| 2020090103110 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | (250,000) | 21.955 | 5,488,750 |
| 2020090103117 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 250,000 | 21.934 | (5,483,486) |
| 2020110403449 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 378,000 | 21.04 | (7,953,211) |
| 2020110503608 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | (500,000) | 21.002 | 10,501,000 |
| 2020110503175 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 378,000 | 20.718 | (7,831,481) |
| 2020110503798 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 500,000 | 20.782 | (10,390,927) |
| 2020110603216 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 439,000 | 20.648 | (9,064,275) |
| 2020111003244 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 439,000 | 20.393 | (8,952,670) |
| 2020111103269 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 439,000 | 20.561 | (9,026,101) |
| 2020111203258 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 439,000 | 20.517 | (9,007,054) |
| 2020111303353 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 439,000 | 20.509 | (9,003,606) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020111303475 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 439,000 | 20.402 | (8,956,559) |
| 2020111803196 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | (138,000) | 20.246 | 2,793,957 |
| 2020111803374 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | (825) | 20.288 | 16,738 |
| 2020111803200 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 138,825 | 20.24 | (2,809,818) |
| 2020120203301 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 15,000,000 | 20.12 | (301,800,000) |
| 2020112303217 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | (50,000,000) | 20.14 | 1,006,990,000 |
| 2020113003004 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 34,183,713 | 20.072 | (686,147,451) |
| 2020120103006 | FWD | USDMXN | 02/12/2020 | 15,816,287 | 20.075 | (317,511,962) |
| 2020082503354 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (34,000) | 22.212 | 755,198 |
| 2020082503336 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 34,000 | 22.145 | (752,914) |
| 2020082803771 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 250,000 | 22.042 | (5,510,560) |
| 2020090403154 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (100,000) | 21.773 | 2,177,250 |
| 2020090403180 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 100,000 | 21.756 | (2,175,610) |
| 2020091403063 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (100,000) | 21.432 | 2,143,210 |
| 2020091403065 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (100,000) | 21.432 | 2,143,210 |
| 2020091403169 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 100,000 | 21.423 | (2,142,347) |
| 2020100203100 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (1,000,000) | 21.906 | 21,905,500 |
| 2020100203148 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 1,000,000 | 21.881 | (21,881,241) |
| 2020102303190 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (250,000) | 21.089 | 5,272,125 |
| 2020102303639 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (100,000) | 20.966 | 2,096,580 |
| 2020102303195 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 250,000 | 20.985 | (5,246,203) |
| 2020102303662 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 100,000 | 20.959 | (2,095,875) |
| 2020102303681 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 100,000 | 20.954 | (2,095,386) |
| 2020110503209 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (100,000) | 20.787 | 2,078,660 |
| 2020110503325 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 100,000 | 20.776 | (2,077,565) |
| 2020111903346 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (182,000) | 20.196 | 3,675,640 |
| 2020111903355 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 182,759 | 20.188 | (3,689,541) |
| 2020112303516 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (760) | 20.177 | 15,334 |
| 2020113003359 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 1,300,000 | 20.137 | (26,177,580) |
| 2020113003361 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 500,000 | 20.137 | (10,068,300) |
| 2020120103128 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 0 | 20.061 | 498,650 |
| 2020120103130 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 0 | 20.061 | 90,940 |
| 2020120103322 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (398,000) | 20.056 | 7,982,097 |
| 2020120103127 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 250,000 | 22.056 | (5,513,875) |
| 2020120103129 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 100,000 | 20.97 | (2,097,030) |
| 2020120203043 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (38,000,000) | 20.105 | 763,990,000 |
| 2020120203045 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 38,000,000 | 20.105 | (763,990,000) |
| 2020120303018 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (100,000,000) | 19.91 | 1,991,000,000 |
| 2020120303135 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (1,450,000) | 19.91 | 28,869,500 |
| 2020120303137 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (500,000) | 19.91 | 9,955,000 |
| 2020120303378 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 100,000,000 | 19.95 | (1,995,000,000) |
| 2020120103007 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | (15,816,287) | 20.078 | 317,551,503 |
| 2020120203025 | FWD | USDMXN | 03/12/2020 | 25,703,488 | 20.1 | (516,640,109) |
| 2020010903077 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (206,250) | 19.69 | 4,060,980 |
| 2020010903021 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 206,250 | 19.676 | (4,058,253) |
| 2020021903359 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (1,000,000) | 19.351 | 19,350,900 |
| 2020021903340 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 1,000,000 | 19.316 | (19,316,005) |
| 2020060203283 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (60,000) | 22.287 | 1,337,220 |
| 2020060203334 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 60,000 | 22.251 | (1,335,071) |
| 2020060303088 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (100,000) | 22.341 | 2,234,100 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020060303054 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 100,000 | 22.21 | (2,221,030) |
| 2020060803228 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (2,500,000) | 22.057 | 55,143,500 |
| 2020060803250 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 2,500,000 | 22.005 | (55,013,465) |
| 2020062603348 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (2,500,000) | 23.417 | 58,543,610 |
| 2020062603220 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 2,500,000 | 22.057 | (55,143,500) |
| 2020072803275 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (250,000) | 22.395 | 5,598,625 |
| 2020072803345 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 250,000 | 22.307 | (5,576,751) |
| 2020081303315 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (75,000) | 22.598 | 1,694,835 |
| 2020081303282 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 75,000 | 22.511 | (1,688,324) |
| 2020082803291 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (37,400) | 22.113 | 827,030 |
| 2020082803294 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 37,000 | 22.104 | (817,848) |
| 2020082803307 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 400 | 22.134 | (8,854) |
| 2020102303180 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (200,000) | 21.878 | 4,375,600 |
| 2020102303242 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 200,000 | 20.987 | (4,197,423) |
| 2020110403336 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (30,000) | 21.114 | 633,411 |
| 2020110403408 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (30,000) | 21.046 | 631,386 |
| 2020110403338 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 30,000 | 21.05 | (631,499) |
| 2020110403445 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 30,000 | 20.991 | (629,741) |
| 2020110603052 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (50,000) | 20.77 | 1,038,475 |
| 2020110603079 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 50,000 | 20.694 | (1,034,689) |
| 2020112303142 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (42,606) | 20.14 | 858,098 |
| 2020112303106 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 28,911 | 20.095 | (580,974) |
| 2020112303109 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 13,694 | 20.095 | (275,189) |
| 2020112503188 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 71,720 | 20.015 | (1,435,476) |
| 2020112603001 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (71,720) | 20.056 | 1,438,419 |
| 2020120203046 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (38,000,000) | 20.108 | 764,092,600 |
| 2020120203302 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (15,000,000) | 20.125 | 301,869,000 |
| 2020120203044 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 38,000,000 | 20.108 | (764,092,600) |
| 2020120303345 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (135,000,000) | 19.89 | 2,685,150,000 |
| 2020120303379 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (100,000,000) | 19.952 | 1,995,230,000 |
| 2020120303019 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 100,000,000 | 19.912 | (1,991,220,000) |
| 2020120303381 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 150,000,000 | 19.95 | (2,992,500,000) |
| 2020120203026 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (25,703,488) | 20.103 | 516,710,794 |
| 2020120203033 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 25,703,488 | 20.05 | (515,354,935) |
| 2020120303591 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 15,000,000 | 19.893 | (298,395,000) |
| 2020120403065 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | (50,000,000) | 19.812 | 990,600,000 |
| 2020120403021 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 25,000,000 | 19.83 | (495,750,000) |
| 2020120403023 | FWD | USDMXN | 04/12/2020 | 25,000,000 | 19.83 | (495,750,000) |
| 2020060503081 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (40,000) | 22.338 | 893,532 |
| 2020060503238 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 40,000 | 22.285 | (891,406) |
| 2020081303415 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (75,000) | 22.564 | 1,692,315 |
| 2020081303435 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 75,000 | 22.54 | (1,690,530) |
| 2020091503074 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (400,000) | 21.25 | 8,500,000 |
| 2020091503079 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 400,000 | 21.167 | (8,466,974) |
| 2020102303051 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (50,000) | 21.025 | 1,051,245 |
| 2020102303213 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 50,000 | 21.005 | (1,050,272) |
| 2020102603332 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (50,000) | 21.13 | 1,056,510 |
| 2020102603343 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 50,000 | 21.089 | (1,054,464) |
| 2020110603358 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (25,000) | 20.7 | 517,498 |
| 2020110603578 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 25,000 | 20.629 | (515,729) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020111203474 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (30,000) | 20.749 | 622,476 |
| 2020111203521 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 30,000 | 20.584 | (617,523) |
| 2020111903294 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (50,000) | 20.261 | 1,013,030 |
| 2020111903283 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 50,000 | 20.212 | (1,010,610) |
| 2020112603097 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (61,000) | 20.053 | 1,223,215 |
| 2020112603106 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (970) | 20.051 | 19,450 |
| 2020112603034 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 61,970 | 20.044 | (1,242,096) |
| 2020112703078 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (103,215) | 20.073 | 2,071,882 |
| 2020112703052 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 103,215 | 20.05 | (2,069,461) |
| 2020120303191 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (250,000) | 19.886 | 4,971,550 |
| 2020120303382 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (150,000,000) | 19.957 | 2,993,535,000 |
| 2020120303395 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (260,000) | 19.908 | 5,176,137 |
| 2020120303398 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (1,597,600) | 19.908 | 31,805,372 |
| 2020120303401 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (1,597,600) | 19.908 | 31,805,133 |
| 2020120303403 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (1,537,500) | 19.905 | 30,604,276 |
| 2020120303407 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (1,537,500) | 19.907 | 30,606,582 |
| 2020120303411 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (980,100) | 19.907 | 19,510,576 |
| 2020120303415 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (980,100) | 19.91 | 19,513,517 |
| 2020120303420 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (1,366,400) | 19.91 | 27,205,530 |
| 2020120303422 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (1,366,400) | 19.91 | 27,205,530 |
| 2020120303425 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (1,366,400) | 19.913 | 27,208,467 |
| 2020120303431 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (837,400) | 19.914 | 16,676,168 |
| 2020120303435 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (837,400) | 19.915 | 16,676,419 |
| 2020120303444 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (296,000) | 19.888 | 5,886,818 |
| 2020120303346 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 135,000,000 | 19.897 | (2,686,061,250) |
| 2020120303635 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 214,405 | 19.917 | (4,270,363) |
| 2020120303639 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 4,526,959 | 19.916 | (90,156,656) |
| 2020120703251 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (30,000,000) | 19.84 | 595,200,000 |
| 2020120203034 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (25,703,488) | 20.058 | 515,560,563 |
| 2020120303592 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (15,000,000) | 19.899 | 298,491,000 |
| 2020120403022 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (25,000,000) | 19.836 | 495,890,000 |
| 2020120403024 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | (25,000,000) | 19.836 | 495,890,000 |
| 2020120403014 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 30,000,000 | 19.84 | (595,200,000) |
| 2020120403066 | FWD | USDMXN | 07/12/2020 | 50,000,000 | 19.818 | (990,880,000) |
| 2020102703462 | FWD | EURMXN | 08/12/2020 | 50,000 | 24.87 | (1,243,499) |
| 2020102703415 | FWD | EURMXN | 08/12/2020 | (50,000) | 24.906 | 1,245,300 |
| 2020110903057 | FWD | EURMXN | 08/12/2020 | (100,000) | 24.057 | 2,405,700 |
| 2020111003202 | FWD | EURMXN | 08/12/2020 | 100,000 | 24.047 | (2,404,710) |
| 2020030503208 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (180,000) | 20.605 | 3,708,988 |
| 2020031203069 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (150,000) | 23.048 | 3,457,233 |
| 2020031203182 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 150,000 | 22.35 | (3,352,500) |
| 2020072703329 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (150,000) | 22.35 | 3,352,500 |
| 2020072703381 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 150,000 | 22.351 | (3,352,669) |
| 2020081303416 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (75,000) | 22.567 | 1,692,540 |
| 2020081303436 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 75,000 | 22.543 | (1,690,729) |
| 2020092903139 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (2,845,328) | 22.412 | 63,768,922 |
| 2020092903034 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 2,845,328 | 22.383 | (63,687,923) |
| 2020100903674 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (32,000) | 21.324 | 682,352 |
| 2020100903475 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 32,000 | 21.309 | (681,888) |
| 2020101603357 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (39,500) | 21.253 | 839,478 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020101603360 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 39,500 | 21.239 | (838,948) |
| 2020102303029 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (300,000) | 21.006 | 6,301,740 |
| 2020102303210 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 300,000 | 20.995 | (6,298,426) |
| 2020110303419 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (22,050) | 21.395 | 471,760 |
| 2020110303391 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 22,050 | 21.339 | (470,529) |
| 2020110503836 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (22,650) | 20.828 | 471,754 |
| 2020110503834 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 22,650 | 20.759 | (470,194) |
| 2020110903089 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (300,000) | 20.334 | 6,100,200 |
| 2020110903190 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 300,000 | 20.423 | (6,126,946) |
| 2020111003435 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (1,000,000) | 20.356 | 20,355,700 |
| 2020111003437 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 1,000,000 | 20.346 | (20,346,165) |
| 2020111303292 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (2,000,000) | 20.482 | 40,963,000 |
| 2020111303301 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (6,000,000) | 20.482 | 122,889,000 |
| 2020111303310 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (3,000,000) | 20.482 | 61,444,500 |
| 2020111303288 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 2,000,000 | 20.479 | (40,958,849) |
| 2020111303296 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 6,000,000 | 20.478 | (122,869,027) |
| 2020111303306 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 3,000,000 | 20.472 | (61,416,414) |
| 2020113003127 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (152,000) | 20.163 | 3,064,839 |
| 2020113003338 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (170) | 20.135 | 3,424 |
| 2020113003018 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 152,170 | 20.05 | (3,051,009) |
| 2020120303136 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 1,450,000 | 19.921 | (28,885,160) |
| 2020120303138 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 500,000 | 19.921 | (9,960,400) |
| 2020120403467 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (1,000,000) | 19.787 | 19,786,700 |
| 2020120403472 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (1,000,000) | 19.785 | 19,784,650 |
| 2020120403488 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (250,000) | 19.792 | 4,948,093 |
| 2020120403494 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (250,000) | 19.792 | 4,947,968 |
| 2020120403504 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (250,000) | 19.79 | 4,947,405 |
| 2020120403509 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (250,000) | 19.79 | 4,947,500 |
| 2020120703186 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 6,000,000 | 19.87 | (119,220,000) |
| 2020120703188 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 3,000,000 | 19.87 | (59,610,000) |
| 2020120703191 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 2,000,000 | 19.87 | (39,740,000) |
| 2020120803062 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (2,900,000) | 19.78 | 57,362,000 |
| 2020120803065 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (500,000) | 19.78 | 9,890,000 |
| 2020120403015 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (30,000,000) | 19.842 | 595,263,000 |
| 2020120703282 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | (11,000,000) | 19.84 | 218,240,000 |
| 2020120703007 | FWD | USDMXN | 08/12/2020 | 10,000,000 | 19.83 | (198,300,000) |
| 2020052103249 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (12,000) | 23.43 | 281,157 |
| 2020052103239 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 812,000 | 23.436 | (19,030,018) |
| 2020052103240 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 13,176 | 23.455 | (309,054) |
| 2020081303418 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (21,000) | 22.57 | 473,974 |
| 2020081303437 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 21,000 | 22.546 | (473,460) |
| 2020091503460 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (1,550,163) | 21.313 | 33,038,159 |
| 2020091503452 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 1,550,163 | 21.306 | (33,027,959) |
| 2020112003065 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 826,000 | 20.187 | (16,674,252) |
| 2020112003405 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 967 | 20.125 | (19,462) |
| 2020113003059 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (63,650) | 20.123 | 1,280,801 |
| 2020113003078 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (100,000) | 20.058 | 2,005,795 |
| 2020113003339 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (415) | 20.135 | 8,356 |
| 2020113003019 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 100,415 | 20.051 | (2,013,421) |
| 2020113003056 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 63,650 | 20.11 | (1,280,002) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020120703223 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (200,000) | 19.806 | 3,961,220 |
| 2020120703257 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (398,000) | 19.834 | 7,893,940 |
| 2020120703070 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 30,000,000 | 19.9 | (597,000,000) |
| 2020120703232 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 3,309,657 | 19.814 | (65,576,783) |
| 2020120703252 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 30,000,000 | 19.845 | (595,342,500) |
| 2020112303369 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (100,000,000) | 20.163 | 2,016,330,000 |
| 2020112303371 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (50,000,000) | 20.163 | 1,008,165,000 |
| 2020112303178 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 84,029,666 | 20.134 | (1,691,811,280) |
| 2020120703008 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (10,000,000) | 19.832 | 198,323,000 |
| 2020120703035 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | (30,000,000) | 19.83 | 594,900,000 |
| 2020120703227 | FWD | USDMXN | 09/12/2020 | 85,673,822 | 19.823 | (1,698,312,174) |
| 2020120403070 | FWD | EURMXN | 10/12/2020 | 40,000 | 24.064 | (962,563) |
| 2020082803724 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (98,333) | 22.079 | 2,171,102 |
| 2020082803772 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 250,000 | 22.06 | (5,515,109) |
| 2020082803802 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 98,333 | 22.07 | (2,170,189) |
| 2020090103540 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (34,000) | 22.039 | 749,326 |
| 2020090103544 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 34,000 | 21.933 | (745,712) |
| 2020090403156 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (100,000) | 21.79 | 2,178,990 |
| 2020090403322 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (1,000,000) | 21.875 | 21,875,300 |
| 2020090403179 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 100,000 | 21.774 | (2,177,350) |
| 2020090403448 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 1,000,000 | 21.832 | (21,832,164) |
| 2020091403066 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (100,000) | 21.45 | 2,144,960 |
| 2020091403171 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 100,000 | 21.441 | (2,144,073) |
| 2020100203107 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (1,000,000) | 21.913 | 21,912,600 |
| 2020100203149 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 1,000,000 | 21.909 | (21,909,090) |
| 2020102303191 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (250,000) | 21.105 | 5,276,275 |
| 2020102303648 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (100,000) | 20.984 | 2,098,360 |
| 2020102303194 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 250,000 | 21.002 | (5,250,449) |
| 2020102303663 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 100,000 | 20.976 | (2,097,550) |
| 2020102303680 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 100,000 | 20.971 | (2,097,061) |
| 2020110503213 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (100,000) | 20.802 | 2,080,200 |
| 2020110503327 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 100,000 | 20.791 | (2,079,103) |
| 2020111303498 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (100,000) | 20.532 | 2,053,190 |
| 2020111303511 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 100,000 | 20.46 | (2,045,961) |
| 2020112003079 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 102,000 | 20.144 | (2,054,645) |
| 2020112003406 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 746 | 20.128 | (15,023) |
| 2020113003017 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (152,000) | 20.06 | 3,049,087 |
| 2020113003128 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 152,000 | 20.168 | (3,065,595) |
| 2020120303171 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (48,000) | 19.908 | 955,573 |
| 2020120303287 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (610) | 19.914 | 12,147 |
| 2020120303175 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 48,610 | 19.898 | (967,242) |
| 2020120803212 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (100,000) | 19.732 | 1,973,190 |
| 2020120903379 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (50,000,000) | 19.925 | 996,250,000 |
| 2020121003054 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (15,000,000) | 20 | 300,000,000 |
| 2020112303183 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | 82,616,113 | 20.146 | (1,664,351,163) |
| 2020120703228 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (85,673,822) | 19.825 | 1,698,500,657 |
| 2020120903000 | FWD | USDMXN | 10/12/2020 | (14,943,097) | 19.745 | 295,051,451 |
| 2020011003370 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (5,972,000) | 19.688 | 117,576,736 |
| 2020011003381 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 5,900,000 | 19.682 | (116,120,897) |
| 2020011003382 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 72,000 | 19.68 | (1,416,964) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020021203438 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (210,306) | 19.432 | 4,086,664 |
| 2020021203456 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 210,306 | 19.418 | (4,083,628) |
| 2020060203297 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (120,000) | 22.306 | 2,676,744 |
| 2020060203331 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 120,000 | 22.271 | (2,672,461) |
| 2020060303090 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (100,000) | 22.36 | 2,236,030 |
| 2020060303056 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 100,000 | 22.23 | (2,222,961) |
| 2020072803281 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (250,000) | 22.413 | 5,603,200 |
| 2020072803346 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 250,000 | 22.325 | (5,581,246) |
| 2020081303317 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (75,000) | 22.598 | 1,694,835 |
| 2020081303421 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (203,000) | 22.576 | 4,582,827 |
| 2020081303283 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 75,000 | 22.525 | (1,689,358) |
| 2020081303438 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 203,000 | 22.551 | (4,577,851) |
| 2020091703399 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (122,750) | 21.146 | 2,595,630 |
| 2020100803410 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 105,000 | 21.546 | (2,262,280) |
| 2020100803463 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 399 | 21.544 | (8,605) |
| 2020101503481 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (1,990,300) | 21.432 | 42,655,636 |
| 2020102303181 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (200,000) | 21.06 | 4,211,980 |
| 2020102303243 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 200,000 | 21.004 | (4,200,842) |
| 2020102903345 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (613,000) | 21.429 | 13,136,160 |
| 2020102903497 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (781) | 21.471 | 16,760 |
| 2020102903380 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 613,782 | 21.425 | (13,150,270) |
| 2020110303378 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (59,730) | 21.35 | 1,275,230 |
| 2020110303396 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 59,730 | 21.283 | (1,271,261) |
| 2020110503639 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 534,000 | 20.784 | (11,098,526) |
| 2020110503694 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 796 | 20.779 | (16,544) |
| 2020110603061 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (50,000) | 20.77 | 1,038,475 |
| 2020110603080 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 50,000 | 20.709 | (1,035,441) |
| 2020111003443 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (250,000) | 20.44 | 5,110,000 |
| 2020111003442 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 250,000 | 20.408 | (5,102,110) |
| 2020111203496 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (115,000) | 20.643 | 2,373,943 |
| 2020111203522 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (181) | 20.694 | 3,749 |
| 2020111903412 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 165,103 | 20.194 | (3,334,082) |
| 2020120803063 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 2,900,000 | 19.786 | (57,380,270) |
| 2020120803066 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 500,000 | 19.786 | (9,893,150) |
| 2020120903380 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 50,000,000 | 19.927 | (996,367,500) |
| 2020120903558 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 175,000 | 19.892 | (3,481,101) |
| 2020120903560 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 115,000 | 19.893 | (2,287,723) |
| 2020120903562 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 93,000 | 19.886 | (1,849,375) |
| 2020121003055 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 15,000,000 | 20.002 | (300,035,250) |
| 2020121103073 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (2,670,000) | 20.12 | 53,720,400 |
| 2020121103075 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (500,000) | 20.12 | 10,060,000 |
| 2020120903001 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | 14,943,097 | 19.747 | (295,085,820) |
| 2020121003005 | FWD | USDMXN | 11/12/2020 | (14,943,097) | 19.865 | 296,844,622 |
| 2020102703192 | FWD | EURMXN | 14/12/2020 | 84,500 | 24.863 | (2,100,901) |
| 2020102703465 | FWD | EURMXN | 14/12/2020 | 32 | 24.998 | (805) |
| 2020060503083 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (40,000) | 22.358 | 894,300 |
| 2020060503239 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 40,000 | 22.304 | (892,179) |
| 2020081303422 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (39,000) | 22.583 | 880,753 |
| 2020081303439 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 39,000 | 22.559 | (879,798) |
| 2020091503075 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (400,000) | 21.25 | 8,500,000 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020091503080 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 400,000 | 21.185 | (8,473,809) |
| 2020100603253 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 310,000 | 21.675 | (6,719,401) |
| 2020100603432 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 566 | 21.802 | (12,346) |
| 2020101303219 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (50,616) | 21.484 | 1,087,422 |
| 2020101303194 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 2,200,000 | 21.493 | (47,284,122) |
| 2020102703466 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (32) | 21.086 | 679 |
| 2020102703464 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 32 | 21.169 | (682) |
| 2020112403370 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 5,530,625 | 20.09 | (111,107,731) |
| 2020112603117 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 27 | 20.075 | (542) |
| 2020121003151 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (398,000) | 19.964 | 7,945,752 |
| 2020121003242 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (1,971,491) | 19.956 | 39,343,666 |
| 2020121003501 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (398,000) | 19.98 | 7,952,199 |
| 2020121003613 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (1,500,000) | 20.006 | 30,008,805 |
| 2020121003257 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 854,160 | 19.962 | (17,050,571) |
| 2020121103081 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (500,000) | 20.12 | 10,060,000 |
| 2020121403000 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (3,400,000) | 20.04 | 68,136,000 |
| 2020121003335 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (9,644,661) | 19.97 | 192,603,871 |
| 2020121003357 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | (25,000,000) | 19.967 | 499,175,000 |
| 2020121003006 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 14,943,097 | 19.873 | (296,956,696) |
| 2020121103007 | FWD | USDMXN | 14/12/2020 | 25,000,000 | 20.144 | (503,588,188) |
| 2020022803523 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (100,000) | 20.743 | 2,074,349 |
| 2020022803561 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 100,000 | 20.475 | (2,047,520) |
| 2020030903282 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (100,000) | 22.229 | 2,222,905 |
| 2020030903354 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 100,000 | 22.059 | (2,205,850) |
| 2020032303224 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (250,000) | 26.016 | 6,504,115 |
| 2020032303211 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 250,000 | 25.403 | (6,350,750) |
| 2020032603341 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (150,000) | 23.835 | 3,575,189 |
| 2020032603364 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 150,000 | 23.778 | (3,566,685) |
| 2020033003202 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (150,000) | 25.388 | 3,808,190 |
| 2020033003190 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 150,000 | 25.317 | (3,797,550) |
| 2020040603190 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (400,000) | 25.531 | 10,212,537 |
| 2020040603191 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 400,000 | 25.44 | (10,176,000) |
| 2020042303325 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (200,000) | 25.44 | 5,088,088 |
| 2020042303392 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (100,000) | 25.565 | 2,556,493 |
| 2020042303322 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 200,000 | 25.403 | (5,080,600) |
| 2020042303393 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 100,000 | 25.494 | (2,549,400) |
| 2020042403058 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (100,000) | 25.625 | 2,562,548 |
| 2020042403235 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (200,000) | 25.839 | 5,167,778 |
| 2020042403063 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 100,000 | 25.602 | (2,560,150) |
| 2020042403237 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 200,000 | 25.757 | (5,151,460) |
| 2020052203185 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (200,000) | 23.47 | 4,694,000 |
| 2020052203224 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 200,000 | 23.378 | (4,675,619) |
| 2020060303141 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (200,000) | 22.31 | 4,462,000 |
| 2020060303173 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 200,000 | 22.201 | (4,440,174) |
| 2020081403301 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (500,000) | 22.336 | 11,168,000 |
| 2020081403303 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (500,000) | 22.336 | 11,168,000 |
| 2020081403296 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 500,000 | 22.327 | (11,163,608) |
| 2020082403018 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (1,000,000) | 22.232 | 22,231,500 |
| 2020082403015 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 1,000,000 | 22.221 | (22,220,662) |
| 2020082603227 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (150,000) | 23.778 | 3,566,685 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020082603230 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (200,000) | 25.757 | 5,151,460 |
| 2020082603270 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 350,000 | 22.236 | (7,782,663) |
| 2020090103397 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (150,000) | 25.317 | 3,797,550 |
| 2020090103400 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (100,000) | 25.494 | 2,549,400 |
| 2020090103401 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (100,000) | 25.602 | 2,560,150 |
| 2020090103458 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 350,000 | 22.09 | (7,731,341) |
| 2020090303131 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (200,000) | 25.403 | 5,080,600 |
| 2020090303195 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 200,000 | 21.886 | (4,377,168) |
| 2020090403063 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (250,000) | 25.403 | 6,350,750 |
| 2020090403183 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 250,000 | 21.856 | (5,463,932) |
| 2020091503190 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (50,000) | 21.215 | 1,060,745 |
| 2020091503212 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 50,000 | 21.185 | (1,059,240) |
| 2020101903254 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (23,000) | 21.331 | 490,611 |
| 2020101903256 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 23,000 | 21.317 | (490,292) |
| 2020102603334 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (50,000) | 21.15 | 1,057,490 |
| 2020102603344 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 50,000 | 21.109 | (1,055,448) |
| 2020102703067 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (2,000,000) | 21.009 | 42,017,000 |
| 2020102703077 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 2,000,000 | 20.997 | (41,994,228) |
| 2020102803080 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (500,000) | 21.274 | 10,637,000 |
| 2020102803206 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 500,000 | 21.266 | (10,632,885) |
| 2020103003155 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (1,000,000) | 21.372 | 21,372,200 |
| 2020103003161 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 1,000,000 | 21.36 | (21,360,376) |
| 2020110303139 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (98,500) | 21.229 | 2,091,027 |
| 2020110303155 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 98,500 | 21.217 | (2,089,889) |
| 2020110403221 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (2,000,000) | 21.031 | 42,062,000 |
| 2020110403229 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (2,000,000) | 21.08 | 42,159,000 |
| 2020110403240 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (2,500,000) | 21.082 | 52,705,000 |
| 2020110403420 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (300,000) | 21.098 | 6,329,400 |
| 2020110403219 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 2,000,000 | 21.027 | (42,054,726) |
| 2020110403225 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 2,000,000 | 21.072 | (42,143,111) |
| 2020110403237 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 2,500,000 | 21.08 | (52,700,394) |
| 2020110403416 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 300,000 | 21.052 | (6,315,539) |
| 2020111003393 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (100,000) | 20.475 | 2,047,520 |
| 2020111003486 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 100,000 | 20.416 | (2,041,590) |
| 2020120803222 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (156,000) | 19.745 | 3,080,261 |
| 2020120803456 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (345) | 19.802 | 6,833 |
| 2020120803223 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 156,345 | 19.74 | (3,086,250) |
| 2020121103588 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 74,000 | 20.124 | (1,489,209) |
| 2020121103590 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 151,000 | 20.129 | (3,039,470) |
| 2020121403609 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 2,000,000 | 20.21 | (40,420,000) |
| 2020121403611 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 2,500,000 | 20.21 | (50,525,000) |
| 2020091103125 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 25,000,000 | 21.524 | (538,087,500) |
| 2020121003336 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 9,644,661 | 19.972 | (192,627,018) |
| 2020121103008 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (25,000,000) | 20.146 | 503,645,000 |
| 2020121103193 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (9,644,661) | 20.13 | 194,147,017 |
| 2020121503003 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | (9,000,000) | 20.156 | 181,405,859 |
| 2020121503000 | FWD | USDMXN | 15/12/2020 | 4,500,000 | 20.174 | (90,782,179) |
| 2020072803140 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | (351,130) | 22.387 | 7,860,747 |
| 2020072803263 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 351,130 | 22.358 | (7,850,617) |
| 2020081303424 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | (175,000) | 22.589 | 3,953,040 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020081303440 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 167,000 | 22.564 | (3,768,225) |
| 2020081303441 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 8,000 | 22.577 | (180,620) |
| 2020120903559 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | (175,000) | 19.902 | 3,482,847 |
| 2020120903448 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 175,000 | 22.589 | (3,953,040) |
| 2020121103074 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 2,670,000 | 20.131 | (53,748,435) |
| 2020121103076 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 500,000 | 20.131 | (10,065,250) |
| 2020121103082 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 500,000 | 20.124 | (10,062,100) |
| 2020121403410 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 200,000 | 20.204 | (4,040,896) |
| 2020121403419 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 350,000 | 20.21 | (7,073,668) |
| 2020121403425 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 200,000 | 20.222 | (4,044,428) |
| 2020121603102 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | (2,650,000) | 19.91 | 52,761,500 |
| 2020121603111 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | (1,000,000) | 19.91 | 19,910,000 |
| 2020090103186 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 100,000,000 | 22.027 | (2,202,650,000) |
| 2020090103193 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 30,000,000 | 21.983 | (659,491,164) |
| 2020090103292 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 20,000,000 | 22.006 | (440,118,560) |
| 2020090703041 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | (150,000,000) | 21.818 | 3,272,700,000 |
| 2020110503019 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 40,000,000 | 20.792 | (831,680,000) |
| 2020111803190 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | (40,000,000) | 20.291 | 811,632,000 |
| 2020121103194 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 9,644,661 | 20.132 | (194,169,682) |
| 2020121503001 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | (4,500,000) | 20.176 | 90,791,273 |
| 2020121503005 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | (14,144,661) | 20.192 | 285,608,426 |
| 2020121503004 | FWD | USDMXN | 16/12/2020 | 9,000,000 | 20.158 | (181,424,898) |
| 2020022103276 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (220,000) | 19.658 | 4,324,834 |
| 2020072103172 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (100,000) | 22.845 | 2,284,500 |
| 2020072103188 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 100,000 | 22.706 | (2,270,645) |
| 2020081303180 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (50,000,000) | 22.584 | 1,129,220,000 |
| 2020081303184 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (50,000,000) | 22.584 | 1,129,220,000 |
| 2020081303195 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 50,000,000 | 22.563 | (1,128,135,000) |
| 2020081403464 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (74,000) | 22.399 | 1,657,541 |
| 2020081403483 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (115,000) | 22.399 | 2,575,908 |
| 2020081403377 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 74,000 | 22.363 | (1,654,883) |
| 2020081403385 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 115,000 | 22.363 | (2,571,778) |
| 2020082803773 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 250,000 | 22.079 | (5,519,707) |
| 2020090403157 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (100,000) | 21.807 | 2,180,670 |
| 2020090403181 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 100,000 | 21.79 | (2,179,035) |
| 2020090903479 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (34,000) | 21.799 | 741,152 |
| 2020090903467 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 34,000 | 21.723 | (738,594) |
| 2020091403067 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (100,000) | 21.467 | 2,146,710 |
| 2020091403170 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 100,000 | 21.458 | (2,145,800) |
| 2020100203144 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (500,000) | 21.868 | 10,934,150 |
| 2020100203191 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (500,000) | 21.848 | 10,924,150 |
| 2020100203150 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 500,000 | 21.853 | (10,926,449) |
| 2020100203240 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 500,000 | 21.832 | (10,916,188) |
| 2020102303193 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (250,000) | 21.122 | 5,280,425 |
| 2020102303197 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 250,000 | 21.019 | (5,254,862) |
| 2020102303664 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 100,000 | 20.993 | (2,099,250) |
| 2020110303379 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (36,200) | 21.363 | 773,341 |
| 2020110303395 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 35,270 | 21.296 | (751,126) |
| 2020110303397 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 930 | 21.348 | (19,852) |
| 2020112003087 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 118,000 | 20.175 | (2,380,647) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|---------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020112003412 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 80 | 20.146 | (1,615) |
| 2020120403042 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (1,000,000) | 19.853 | 19,852,600 |
| 2020120403468 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 1,000,000 | 19.807 | (19,806,497) |
| 2020120903407 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (400,000) | 19.955 | 7,982,065 |
| 2020120903561 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (115,000) | 19.905 | 2,289,089 |
| 2020120903391 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 400,000 | 19.944 | (7,977,600) |
| 2020120903419 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 115,000 | 22.399 | (2,575,908) |
| 2020121003140 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (72,000) | 19.976 | 1,438,262 |
| 2020121003506 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (155) | 19.989 | 3,098 |
| 2020121003141 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 72,155 | 19.965 | (1,440,575) |
| 2020121103589 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (74,000) | 20.128 | 1,489,501 |
| 2020121403001 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 3,400,000 | 20.046 | (68,156,400) |
| 2020121503068 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (2,000,000) | 20.177 | 40,354,200 |
| 2020121503272 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 0 | 20.168 | 1,854 |
| 2020121503310 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (11,000,000) | 19.942 | 219,365,300 |
| 2020121503271 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 118,080 | 20.184 | (2,383,271) |
| 2020121503451 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 74,000 | 19.917 | (1,473,831) |
| 2020121503454 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 30,000 | 19.916 | (597,491) |
| 2020121603104 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (6,150,000) | 19.91 | 122,446,500 |
| 2020121603103 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 2,650,000 | 19.912 | (52,767,065) |
| 2020121703054 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (10,000,000) | 19.825 | 198,250,000 |
| 2020121703057 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (30,000,000) | 19.824 | 594,720,000 |
| 2020090303455 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | (50,340,000) | 21.912 | 1,103,050,080 |
| 2020090303530 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 50,000,000 | 21.971 | (1,098,550,000) |
| 2020121503006 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 14,144,661 | 20.194 | (285,642,933) |
| 2020121703015 | FWD | USDMXN | 17/12/2020 | 25,500,000 | 19.81 | (505,155,000) |
| 2020121703361 | FWD | CHF MXN | 18/12/2020 | 500,000 | 22.425 | (11,212,680) |
| 2020010303295 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (7,100,000) | 19.884 | 141,172,850 |
| 2020010303289 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 7,100,000 | 19.881 | (141,155,128) |
| 2020060203306 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (120,000) | 22.326 | 2,679,060 |
| 2020060203328 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 120,000 | 22.29 | (2,674,779) |
| 2020060303320 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (100,000) | 22.379 | 2,237,930 |
| 2020060303057 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 100,000 | 22.249 | (2,224,850) |
| 2020072803285 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (250,000) | 22.431 | 5,607,750 |
| 2020072803347 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 250,000 | 22.343 | (5,585,742) |
| 2020081303319 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (75,000) | 22.598 | 1,694,835 |
| 2020081303285 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 75,000 | 22.541 | (1,690,591) |
| 2020081403471 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (68,000) | 22.402 | 1,523,329 |
| 2020081403489 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (25,000) | 22.402 | 560,048 |
| 2020081403380 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 78,000 | 22.366 | (1,744,542) |
| 2020081403384 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 15,000 | 22.366 | (335,489) |
| 2020081703133 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (2,000,000) | 22.388 | 44,776,487 |
| 2020081703326 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (3,000,000) | 22.47 | 67,408,825 |
| 2020081703156 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 2,000,000 | 22.361 | (44,722,000) |
| 2020081703361 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 2,735,000 | 22.404 | (61,274,940) |
| 2020081703372 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 265,000 | 22.461 | (5,952,208) |
| 2020090203162 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (50,000) | 22.144 | 1,107,220 |
| 2020090203167 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 50,000 | 22.05 | (1,102,484) |
| 2020090403309 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 20,000,000 | 21.846 | (436,925,040) |
| 2020090403314 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 20,000,000 | 21.852 | (437,045,240) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020090403318 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 11,660,000 | 21.858 | (254,863,720) |
| 2020110603065 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (50,000) | 20.77 | 1,038,475 |
| 2020110603081 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 50,000 | 20.724 | (1,036,190) |
| 2020111003045 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (3,000,000) | 20.57 | 61,710,000 |
| 2020111003436 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (2,000,000) | 20.377 | 40,753,800 |
| 2020111003040 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 3,000,000 | 20.512 | (61,537,140) |
| 2020111003438 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 2,000,000 | 20.368 | (40,736,622) |
| 2020120903563 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (93,000) | 19.9 | 1,850,656 |
| 2020120903377 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 25,000 | 22.402 | (560,048) |
| 2020120903475 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 68,000 | 22.402 | (1,523,329) |
| 2020121103144 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (57,000) | 20.12 | 1,146,865 |
| 2020121103501 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (141,750) | 20.098 | 2,848,915 |
| 2020121103592 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (50) | 20.139 | 1,007 |
| 2020121103146 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 57,050 | 20.11 | (1,147,276) |
| 2020121103502 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 141,750 | 20.083 | (2,846,765) |
| 2020121603592 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (250,000) | 19.865 | 4,966,150 |
| 2020121603595 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (250,000) | 19.864 | 4,965,900 |
| 2020121603597 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (250,000) | 19.864 | 4,965,950 |
| 2020121703055 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 10,000,000 | 19.827 | (198,272,000) |
| 2020121703058 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 30,000,000 | 19.826 | (594,789,000) |
| 2020121803004 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (7,000,000) | 19.818 | 138,726,924 |
| 2020121803046 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (50,000,000) | 19.84 | 992,000,000 |
| 2020121803273 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (20,000,000) | 19.98 | 399,600,000 |
| 2020090403421 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (51,660,000) | 21.85 | 1,128,771,000 |
| 2020090403427 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 20,000,000 | 21.846 | (436,925,040) |
| 2020090403430 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 20,000,000 | 21.852 | (437,045,240) |
| 2020090403432 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | 11,660,000 | 21.858 | (254,863,720) |
| 2020121703016 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (25,500,000) | 19.812 | 505,216,200 |
| 2020121803012 | FWD | USDMXN | 18/12/2020 | (13,804,661) | 19.82 | 273,608,372 |
| 2020060503084 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (40,000) | 22.376 | 895,048 |
| 2020060503240 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 40,000 | 22.323 | (892,936) |
| 2020081403459 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (151,000) | 22.41 | 3,383,850 |
| 2020081403493 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (47,000) | 22.41 | 1,053,251 |
| 2020081403378 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 151,000 | 22.374 | (3,378,420) |
| 2020081403386 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 47,000 | 22.374 | (1,051,562) |
| 2020091503076 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (400,000) | 21.25 | 8,500,000 |
| 2020091503081 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 400,000 | 21.202 | (8,480,884) |
| 2020102603337 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (50,000) | 21.165 | 1,058,240 |
| 2020102603345 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 50,000 | 21.124 | (1,056,196) |
| 2020110603571 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (50,000) | 20.662 | 1,033,090 |
| 2020110603580 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 50,000 | 20.664 | (1,033,177) |
| 2020110903050 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (1,130,000) | 20.309 | 22,949,170 |
| 2020110903272 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 1,130,000 | 20.445 | (23,102,737) |
| 2020112603098 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 180,000 | 20.074 | (3,613,303) |
| 2020112603107 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 340 | 20.089 | (6,840) |
| 2020120303158 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (94,000) | 20.153 | 1,894,420 |
| 2020120303189 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (250,000) | 19.977 | 4,994,325 |
| 2020120303249 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 250,000 | 19.92 | (4,979,973) |
| 2020120303275 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 94,000 | 19.925 | (1,872,944) |
| 2020121103591 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (151,000) | 20.142 | 3,041,368 |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020121103494 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 151,000 | 22.41 | (3,383,850) |
| 2020121403085 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (151,000) | 20.156 | 3,043,617 |
| 2020121403184 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (24,000) | 20.234 | 485,618 |
| 2020121403524 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (417,000) | 20.194 | 8,420,827 |
| 2020121403527 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (835) | 20.21 | 16,876 |
| 2020121403086 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 151,100 | 20.15 | (3,044,665) |
| 2020121403186 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 24,735 | 20.229 | (500,364) |
| 2020121403398 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 119,000 | 20.091 | (2,390,829) |
| 2020121403486 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 119,000 | 20.091 | (2,390,829) |
| 2020121403491 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 61,000 | 20.091 | (1,225,551) |
| 2020121403492 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 118,000 | 20.091 | (2,370,738) |
| 2020121603105 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 6,150,000 | 19.918 | (122,498,160) |
| 2020121603112 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 1,000,000 | 19.921 | (19,920,500) |
| 2020121703234 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (200,000) | 19.791 | 3,958,260 |
| 2020121703236 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (200,000) | 19.792 | 3,958,300 |
| 2020121703238 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (200,000) | 19.792 | 3,958,300 |
| 2020121703240 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (200,000) | 19.793 | 3,958,580 |
| 2020121703724 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 478,000 | 19.832 | (9,479,457) |
| 2020121803053 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (39,700,000) | 19.84 | 787,648,000 |
| 2020121803285 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (50,000,000) | 19.95 | 997,500,000 |
| 2020121803047 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 50,000,000 | 19.847 | (992,370,000) |
| 2020121803274 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | 20,000,000 | 19.987 | (399,746,000) |
| 2020122103006 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (5,000,000) | 20.348 | 101,739,615 |
| 2020122103031 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (1,000,000) | 20.34 | 20,340,000 |
| 2020122103045 | FWD | USDMXN | 21/12/2020 | (35,000,000) | 20.24 | 708,400,000 |
| 2020081403494 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (74,000) | 22.412 | 1,658,503 |
| 2020081403382 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 74,000 | 22.376 | (1,655,840) |
| 2020102303652 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (100,000) | 21.014 | 2,101,360 |
| 2020102303682 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 100,000 | 21.001 | (2,100,062) |
| 2020110303142 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (27,500) | 21.244 | 584,216 |
| 2020110303156 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 27,500 | 21.233 | (583,897) |
| 2020110503218 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (100,000) | 20.829 | 2,082,870 |
| 2020110503396 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (100,000) | 20.969 | 2,096,930 |
| 2020110503438 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (45,000) | 21.027 | 946,224 |
| 2020110503328 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 100,000 | 20.817 | (2,081,695) |
| 2020110503345 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 45,000 | 20.923 | (941,513) |
| 2020110503392 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 100,000 | 20.943 | (2,094,339) |
| 2020110903164 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (72,500) | 20.542 | 1,489,259 |
| 2020110903231 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 72,500 | 20.455 | (1,482,996) |
| 2020120703233 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (3,309,657) | 19.838 | 65,657,350 |
| 2020120703190 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 3,309,657 | 19.851 | (65,700,000) |
| 2020121403089 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (143,000) | 20.155 | 2,882,221 |
| 2020121403190 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (31,000) | 20.228 | 627,054 |
| 2020121403411 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (200,000) | 20.216 | 4,043,257 |
| 2020121403525 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (60,000) | 20.196 | 1,211,749 |
| 2020121403528 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (935) | 20.213 | 18,899 |
| 2020121403075 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 100,000 | 21.014 | (2,101,360) |
| 2020121403078 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 100,000 | 20.829 | (2,082,870) |
| 2020121403091 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 143,625 | 20.148 | (2,893,757) |
| 2020121403194 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 31,310 | 20.221 | (633,120) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020121403518 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 60,000 | 20.093 | (1,205,568) |
| 2020121503125 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (50,000) | 20.11 | 1,005,479 |
| 2020121503452 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (74,000) | 19.927 | 1,474,593 |
| 2020121503129 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 50,000 | 20.1 | (1,005,000) |
| 2020121503144 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 74,000 | 22.412 | (1,658,503) |
| 2020121803430 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (4,074,040) | 19.953 | 81,287,287 |
| 2020121803054 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 39,700,000 | 19.842 | (787,743,280) |
| 2020121803286 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 50,000,000 | 19.953 | (997,625,000) |
| 2020122103028 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (38,600,000) | 20.34 | 785,124,000 |
| 2020122103046 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 35,000,000 | 20.242 | (708,482,250) |
| 2020122203018 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (30,000,000) | 20.01 | 600,300,000 |
| 2020122203021 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (7,800,000) | 20.01 | 156,078,000 |
| 2020122203192 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | (15,000,000) | 20.07 | 301,050,000 |
| 2020121803013 | FWD | USDMXN | 22/12/2020 | 13,804,661 | 19.83 | (273,740,897) |
| 2020030603461 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (360,000) | 21.024 | 7,568,729 |
| 2020060303321 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (100,000) | 22.393 | 2,239,270 |
| 2020060303225 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 100,000 | 22.262 | (2,226,199) |
| 2020081403479 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (30,000) | 22.466 | 673,992 |
| 2020081403510 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (478,000) | 22.342 | 10,679,329 |
| 2020081403383 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 508,000 | 22.429 | (11,394,106) |
| 2020082803729 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (98,333) | 22.114 | 2,174,563 |
| 2020082803803 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 98,335 | 22.105 | (2,173,695) |
| 2020091403068 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (150,000) | 21.483 | 3,222,420 |
| 2020091403172 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 150,000 | 21.474 | (3,221,027) |
| 2020092103032 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (50,000,000) | 21.715 | 1,085,742,750 |
| 2020092103041 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (50,000,000) | 21.733 | 1,086,625,000 |
| 2020092103053 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (100,000,000) | 21.697 | 2,169,650,000 |
| 2020092103262 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (100,000,000) | 21.733 | 2,173,250,000 |
| 2020092103280 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 300,000,000 | 21.657 | (6,496,950,000) |
| 2020100903021 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (300,000) | 21.455 | 6,436,350 |
| 2020100903023 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (200,000) | 21.455 | 4,290,900 |
| 2020100903024 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (300,000) | 21.455 | 6,436,350 |
| 2020100903017 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 500,000 | 21.389 | (10,694,653) |
| 2020100903019 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 300,000 | 21.387 | (6,416,063) |
| 2020102303319 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (63,000) | 21.089 | 1,328,582 |
| 2020102303572 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (50,000) | 21.051 | 1,052,545 |
| 2020102303656 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (100,000) | 21.016 | 2,101,620 |
| 2020102303529 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 63,000 | 21.024 | (1,324,515) |
| 2020102303575 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 50,000 | 21.017 | (1,050,863) |
| 2020102303683 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 100,000 | 21.003 | (2,100,322) |
| 2020110403453 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (250,000,000) | 21.344 | 5,336,000,000 |
| 2020110403370 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 100,000,000 | 21.023 | (2,102,299,510) |
| 2020110403418 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 100,000,000 | 21.071 | (2,107,050,000) |
| 2020110503222 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (100,000) | 20.841 | 2,084,100 |
| 2020110503631 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (50,000,000) | 21.004 | 1,050,175,000 |
| 2020110503005 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 50,000,000 | 20.86 | (1,042,975,000) |
| 2020110503329 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 100,000 | 20.819 | (2,081,919) |
| 2020120103055 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (2,112,799) | 20.089 | 42,442,963 |
| 2020121003111 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (21,400) | 19.999 | 427,979 |
| 2020121003106 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 21,400 | 19.941 | (426,741) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020121403093 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (134,000) | 20.161 | 2,701,578 |
| 2020121403235 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (49,000) | 20.228 | 991,155 |
| 2020121403420 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (350,000) | 20.224 | 7,078,498 |
| 2020121403529 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (657) | 20.222 | 13,281 |
| 2020121403081 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 150,000 | 21.483 | (3,222,420) |
| 2020121403084 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 100,000 | 21.016 | (2,101,620) |
| 2020121403087 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 100,000 | 20.841 | (2,084,100) |
| 2020121403094 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 134,620 | 20.15 | (2,712,593) |
| 2020121403211 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 49,035 | 20.235 | (992,223) |
| 2020121503455 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (30,000) | 19.929 | 597,865 |
| 2020121503152 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 30,000 | 22.466 | (673,992) |
| 2020122103033 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (1,500,000) | 20.34 | 30,510,000 |
| 2020122103029 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 38,600,000 | 20.342 | (785,211,815) |
| 2020122103032 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 1,000,000 | 20.344 | (20,344,400) |
| 2020122103575 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 478,000 | 19.938 | (9,530,125) |
| 2020122103577 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 478,000 | 19.938 | (9,530,125) |
| 2020122203023 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (47,100,000) | 20.01 | 942,471,000 |
| 2020122203492 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | (30,000,000) | 20.13 | 603,900,000 |
| 2020122203019 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 30,000,000 | 20.012 | (600,373,500) |
| 2020122203022 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 7,800,000 | 20.012 | (156,095,940) |
| 2020122203095 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 30,000,000 | 20.057 | (601,710,000) |
| 2020122203193 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 15,000,000 | 20.073 | (301,087,500) |
| 2020111803191 | FWD | USDMXN | 23/12/2020 | 40,000,000 | 20.306 | (812,256,000) |
| 2020072803290 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (250,000) | 22.447 | 5,611,650 |
| 2020072803348 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 250,000 | 22.358 | (5,589,595) |
| 2020082003117 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 50,000,000 | 22.47 | (1,123,500,000) |
| 2020082803774 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 250,000 | 22.098 | (5,524,606) |
| 2020091103085 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (50,000,000) | 21.578 | 1,078,900,000 |
| 2020100103214 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (30,000) | 22.17 | 665,091 |
| 2020100103219 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 30,000 | 22.098 | (662,937) |
| 2020100203193 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (500,000) | 21.843 | 10,921,450 |
| 2020100203194 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (500,000) | 21.823 | 10,911,450 |
| 2020100203292 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 500,000 | 21.829 | (10,914,595) |
| 2020100203293 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 500,000 | 21.81 | (10,905,004) |
| 2020102303665 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 100,000 | 21.011 | (2,101,073) |
| 2020102603338 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (50,000) | 21.172 | 1,058,615 |
| 2020102603346 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 50,000 | 21.131 | (1,056,570) |
| 2020110603063 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (50,000) | 20.77 | 1,038,475 |
| 2020110603082 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 50,000 | 20.737 | (1,036,838) |
| 2020120403043 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (1,000,000) | 19.868 | 19,868,000 |
| 2020120403473 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 1,000,000 | 19.82 | (19,820,294) |
| 2020121403212 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (187,000) | 20.227 | 3,782,489 |
| 2020121403531 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (690) | 20.223 | 13,955 |
| 2020121403216 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 187,690 | 20.22 | (3,795,092) |
| 2020121703264 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (100,000) | 19.828 | 1,982,800 |
| 2020121703260 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 100,000 | 19.807 | (1,980,745) |
| 2020122103034 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 1,500,000 | 20.342 | (30,513,300) |
| 2020122203096 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (30,000,000) | 20.059 | 601,783,500 |
| 2020122203240 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (14,841,141) | 20.053 | 297,610,885 |
| 2020122203024 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 47,100,000 | 20.012 | (942,581,685) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|-----------------|
| 2020122203493 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 30,000,000 | 20.133 | (603,976,500) |
| 2020122303066 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (1,500,000) | 20.07 | 30,105,000 |
| 2020122303069 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (47,100,000) | 20.07 | 945,297,000 |
| 2020122303226 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 50,000,000 | 20.085 | (1,004,250,000) |
| 2020122403036 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 10,000,000 | 19.909 | (199,087,401) |
| 2020082003140 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (30,000,000) | 22.525 | 675,741,000 |
| 2020082003142 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (20,000,000) | 22.525 | 450,494,000 |
| 2020091103064 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 25,000,000 | 21.533 | (538,320,335) |
| 2020121003358 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 25,000,000 | 19.989 | (499,712,500) |
| 2020122203379 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | (15,000,000) | 20.1 | 301,500,000 |
| 2020122203395 | FWD | USDMXN | 24/12/2020 | 13,388,142 | 20.115 | (269,302,485) |
| 2020073103209 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (478,000) | 22.421 | 10,717,238 |
| 2020073103247 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 478,000 | 22.382 | (10,698,581) |
| 2020081303321 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (75,000) | 22.598 | 1,694,835 |
| 2020081303287 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 75,000 | 22.568 | (1,692,583) |
| 2020090903460 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (1,000,000) | 21.711 | 21,710,600 |
| 2020090903455 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 1,000,000 | 21.672 | (21,671,892) |
| 2020091003150 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (34,000) | 21.68 | 737,110 |
| 2020091003207 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 34,000 | 21.545 | (732,533) |
| 2020091503077 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (400,000) | 21.25 | 8,500,000 |
| 2020091503082 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 400,000 | 21.221 | (8,488,281) |
| 2020102003381 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (1,000,000) | 21.307 | 21,307,400 |
| 2020102003400 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 1,000,000 | 21.262 | (21,261,836) |
| 2020120703162 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (200,000) | 19.91 | 3,982,000 |
| 2020120703224 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 200,000 | 19.846 | (3,969,273) |
| 2020121403526 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (120,000) | 20.203 | 2,424,418 |
| 2020121403520 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 120,000 | 20.1 | (2,412,000) |
| 2020121703725 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (478,000) | 19.843 | 9,484,978 |
| 2020121703530 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 478,000 | 22.421 | (10,717,238) |
| 2020122103220 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (300,000) | 20.166 | 6,049,852 |
| 2020122103136 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 119,000 | 20.051 | (2,386,010) |
| 2020122103142 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 61,000 | 20.051 | (1,223,081) |
| 2020122103143 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 120,000 | 20.051 | (2,406,060) |
| 2020122303227 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (50,000,000) | 20.095 | 1,004,740,000 |
| 2020122303070 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 47,100,000 | 20.08 | (945,760,935) |
| 2020122403028 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | (47,150,000) | 19.91 | 938,756,500 |
| 2020122403116 | FWD | USDMXN | 28/12/2020 | 47,000,000 | 19.904 | (935,488,000) |
| 2020040303278 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (40,000) | 25.678 | 1,027,113 |
| 2020040303427 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 40,000 | 25.69 | (1,027,604) |
| 2020050803181 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (40,000) | 25.69 | 1,027,604 |
| 2020050803297 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 40,000 | 24.411 | (976,455) |
| 2020060103152 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 30,000 | 22.711 | (681,319) |
| 2020081403414 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (478,000) | 22.482 | 10,746,396 |
| 2020081403511 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 478,000 | 22.363 | (10,689,422) |
| 2020090103465 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (1,084,819) | 22.084 | 23,956,926 |
| 2020090103500 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 1,084,819 | 22.073 | (23,945,133) |
| 2020102203507 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (183,000) | 21.177 | 3,875,431 |
| 2020102203566 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (829) | 21.11 | 17,503 |
| 2020102303677 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (100,000) | 21.032 | 2,103,150 |
| 2020102303684 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 100,000 | 21.018 | (2,101,849) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|--------------|--------|---------------|
| 2020102903356 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (2,366,000) | 21.469 | 50,794,999 |
| 2020102903357 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (20,447) | 21.474 | 439,091 |
| 2020110303146 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (29,000) | 21.261 | 616,560 |
| 2020110303157 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 29,000 | 21.249 | (616,220) |
| 2020110503224 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (100,000) | 20.845 | 2,084,480 |
| 2020110503326 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 100,000 | 20.833 | (2,083,266) |
| 2020111303481 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (70,000) | 20.529 | 1,437,044 |
| 2020111303489 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 70,000 | 20.504 | (1,435,295) |
| 2020120303110 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (42,600) | 19.999 | 851,957 |
| 2020120303194 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 42,000 | 19.967 | (838,601) |
| 2020120303195 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 600 | 19.935 | (11,961) |
| 2020121403426 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (200,000) | 20.242 | 4,048,465 |
| 2020121403088 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 100,000 | 21.032 | (2,103,150) |
| 2020121403090 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 100,000 | 20.845 | (2,084,480) |
| 2020122103221 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (291,000) | 20.168 | 5,868,800 |
| 2020122103576 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (478,000) | 19.947 | 9,534,768 |
| 2020122103578 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (478,000) | 19.947 | 9,534,768 |
| 2020122103163 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 61,000 | 20.052 | (1,223,172) |
| 2020122103339 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 118,000 | 20.052 | (2,366,136) |
| 2020122103349 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 112,000 | 20.052 | (2,245,824) |
| 2020122103361 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 478,000 | 22.482 | (10,746,396) |
| 2020122303067 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 1,500,000 | 20.082 | (30,123,000) |
| 2020122403117 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | (47,000,000) | 19.906 | 935,600,800 |
| 2020122403029 | FWD | USDMXN | 29/12/2020 | 47,150,000 | 19.912 | (938,867,303) |
| 2020031203118 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (100,000) | 23.355 | 2,335,465 |
| 2020031203143 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 100,000 | 23.01 | (2,301,000) |
| 2020031803375 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (100,000) | 24.883 | 2,488,315 |
| 2020031803349 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 100,000 | 24.612 | (2,461,220) |
| 2020060203524 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 4,990,957 | 22.405 | (111,823,026) |
| 2020070203263 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (41,600) | 23.019 | 957,586 |
| 2020070203278 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 41,600 | 23.011 | (957,259) |
| 2020090703067 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (288,000) | 21.894 | 6,305,530 |
| 2020090703076 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 288,000 | 21.885 | (6,302,741) |
| 2020092203220 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 183,800 | 21.936 | (4,031,871) |
| 2020092203300 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 25 | 21.99 | (540) |
| 2020100603196 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (25,209) | 21.768 | 548,750 |
| 2020100603433 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 25,209 | 21.858 | (551,030) |
| 2020101503361 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (181,000) | 21.49 | 3,889,690 |
| 2020101503371 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 181,000 | 21.478 | (3,887,475) |
| 2020102603339 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (50,000) | 21.187 | 1,059,340 |
| 2020102603347 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 50,000 | 21.146 | (1,057,298) |
| 2020110903240 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (144,000) | 20.478 | 2,948,890 |
| 2020110903427 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (300,000) | 20.443 | 6,132,900 |
| 2020110903263 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 144,000 | 20.46 | (2,946,309) |
| 2020111003401 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (100,000) | 24.612 | 2,461,220 |
| 2020111003211 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 300,000 | 20.497 | (6,149,080) |
| 2020111003488 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 100,000 | 20.452 | (2,045,171) |
| 2020111903295 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (150,000) | 20.314 | 3,047,040 |
| 2020111903284 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 150,000 | 20.27 | (3,040,566) |
| 2020121503311 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 11,000,000 | 19.973 | (219,702,868) |

| External Deal Number | ProductID | Cross | Value | Amount 1 | Rate | Amount 2 |
|----------------------|-----------|--------|------------|---------------|--------|-----------------|
| 2020121503333 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 453,902 | 19.995 | (9,075,669) |
| 2020121603553 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (250,000) | 20.055 | 5,013,700 |
| 2020121603593 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 250,000 | 19.894 | (4,973,401) |
| 2020122203241 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 14,841,141 | 20.068 | (297,827,298) |
| 2020122203396 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | (13,388,142) | 20.13 | 269,496,613 |
| 2020122903003 | FWD | USDMXN | 30/12/2020 | 5,304,607 | 19.91 | (105,613,705) |
| 2020102703210 | FWD | EURMXN | 31/12/2020 | 75,000 | 24.92 | (1,868,974) |
| 2020102703132 | FWD | EURMXN | 31/12/2020 | (25,000) | 24.967 | 624,183 |
| 2020102703145 | FWD | EURMXN | 31/12/2020 | (50,000) | 24.967 | 1,248,365 |
| 2020082703007 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (50,000,000) | 22.25 | 1,112,491,480 |
| 2020082703014 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (20,000,000) | 22.238 | 444,753,918 |
| 2020082703016 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (30,000,000) | 22.243 | 667,284,000 |
| 2020082703560 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (1,986,337) | 22.299 | 44,293,923 |
| 2020082703071 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 100,000,000 | 22.261 | (2,226,100,000) |
| 2020082703567 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 1,986,337 | 22.277 | (44,249,735) |
| 2020082803775 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 250,000 | 22.118 | (5,529,506) |
| 2020091103099 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (100,000,000) | 21.593 | 2,159,300,000 |
| 2020091103029 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 50,000,000 | 21.519 | (1,075,935,165) |
| 2020091103083 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 50,000,000 | 21.602 | (1,080,090,165) |
| 2020100203249 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (500,000) | 21.822 | 10,910,750 |
| 2020100203294 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 500,000 | 21.807 | (10,903,569) |
| 2020100503050 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (500,000) | 21.796 | 10,897,750 |
| 2020100503330 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 500,000 | 21.784 | (10,891,902) |
| 2020101603300 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (250,000) | 21.397 | 5,349,325 |
| 2020101603352 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 250,000 | 21.314 | (5,328,452) |
| 2020102303666 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 100,000 | 21.028 | (2,102,791) |
| 2020110603057 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (50,000) | 20.77 | 1,038,475 |
| 2020110603083 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 50,000 | 20.752 | (1,037,616) |
| 2020111903385 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 439,000 | 20.262 | (8,894,883) |
| 2020112003402 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 440,000 | 20.2 | (8,887,903) |
| 2020112303513 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (1,000) | 20.241 | 20,241 |
| 2020112303398 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 439,000 | 20.213 | (8,873,413) |
| 2020112403321 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 439,000 | 20.095 | (8,821,657) |
| 2020112403397 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 439,000 | 20.106 | (8,826,578) |
| 2020112503258 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 439,000 | 20.143 | (8,842,572) |
| 2020112503259 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 439,000 | 20.067 | (8,809,531) |
| 2020112603301 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 439,000 | 20.131 | (8,837,724) |
| 2020112603302 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 439,000 | 20.111 | (8,828,913) |
| 2020112703160 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 439,000 | 20.117 | (8,831,278) |
| 2020120403044 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (1,000,000) | 19.876 | 19,876,000 |
| 2020122103222 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (180,000) | 20.17 | 3,630,661 |
| 2020122103165 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 80,000 | 20.055 | (1,604,360) |
| 2020122103176 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 100,000 | 20.055 | (2,005,450) |
| 2020122403037 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (10,000,000) | 19.922 | 199,223,200 |
| 2020122903044 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (200,000) | 19.956 | 3,991,100 |
| 2020122903046 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (200,000) | 19.95 | 3,990,040 |
| 2020122903049 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (200,000) | 19.951 | 3,990,180 |
| 2020122903051 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (200,000) | 19.951 | 3,990,220 |
| 2020122903129 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (796,000) | 19.896 | 15,837,057 |
| 2020122903405 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (3,386,331) | 19.942 | 67,529,870 |
| 2020122903459 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (750,000) | 19.912 | 14,934,225 |
| 2020122903421 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 345,536 | 19.929 | (6,886,337) |
| 2020122903004 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | (5,304,607) | 19.912 | 105,626,391 |
| 2020122903006 | FWD | USDMXN | 31/12/2020 | 6,304,607 | 19.896 | (125,437,717) |

Liquidados anticipadamente

| TransID | ProductID | MaturityDate | Buy/Sell Flag | Trans Status | Base CurID | PaySide Notional | PaySide CurID | RcvSide Notional | RcvSide CurID | Option Notional |
|---------|-----------|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| C59551 | CC Swap | 15/03/2022 | Buy | U | usd | 20,000,000 | usd | 466,600,000 | mex | |
| C60018 | CC Swap | 27/04/2025 | Buy | U | usd | 10,000,000 | usd | 245,900,000 | mex | |
| C38368 | CC Swap | 21/01/2026 | Buy | U | usd | 86,362,980 | mex | 4,686,000 | usd | |
| C53920 | CC Swap | 21/01/2026 | Buy | U | usd | 4,686,000 | usd | 86,362,980 | mex | |
| E58346 | Eq Option | 13/10/2020 | Sell | U | mex | | | | | 209,012,230 |
| E58347 | Eq Option | 13/10/2020 | Buy | U | mex | | | | | 209,012,230 |
| E58348 | Eq Option | 13/10/2020 | Sell | U | mex | | | | | 209,012,230 |
| E58358 | Eq Option | 13/10/2020 | Buy | U | mex | | | | | 209,012,230 |
| E61003 | Eq Option | 19/05/2021 | Buy | U | mex | | | | | 10,270,000 |
| E61014 | Eq Option | 19/05/2021 | Sell | U | mex | | | | | 10,270,000 |
| E63951 | Eq Option | 08/05/2023 | Buy | U | mex | | | | | 804,040,000 |
| E63952 | Eq Option | 08/05/2023 | Sell | U | mex | | | | | 804,040,000 |
| E63953 | Eq Option | 08/05/2023 | Sell | U | mex | | | | | 804,040,000 |
| E63954 | Eq Option | 08/05/2023 | Buy | U | mex | | | | | 804,040,000 |
| E64104 | Eq Option | 18/05/2021 | Sell | U | mex | | | | | 96,860,000 |
| E64105 | Eq Option | 18/05/2021 | Buy | U | mex | | | | | 96,860,000 |
| E64106 | Eq Option | 18/05/2021 | Sell | U | mex | | | | | 96,860,000 |
| E64107 | Eq Option | 18/05/2021 | Buy | U | mex | | | | | 96,860,000 |
| E63419 | Eq Option | 21/03/2023 | Buy | U | mex | | | | | 658,991,000 |
| E65267 | Eq Option | 21/03/2023 | Buy | U | mex | | | | | 658,591,000 |
| E65268 | Eq Option | 21/03/2023 | Sell | U | mex | | | | | 658,591,000 |
| E65269 | Eq Option | 21/03/2023 | Sell | U | mex | | | | | 658,591,000 |
| SX5669 | SC Swap | 10/03/2022 | Buy | U | mex | 14,255,324 | mex | 14,255,324 | mex | |
| SX5684 | SC Swap | 10/03/2022 | Buy | U | mex | 14,255,324 | mex | 14,255,324 | mex | |
| SV3951 | SC Swap | 30/09/2021 | Buy | U | mex | 105,000,000 | mex | 105,000,000 | mex | |
| SV4011 | SC Swap | 30/09/2021 | Buy | U | mex | 105,000,000 | mex | 105,000,000 | mex | |
| SV4071 | SC Swap | 30/09/2021 | Buy | U | mex | 105,000,000 | mex | 105,000,000 | mex | |
| SBC028 | SC Swap | 14/09/2023 | Buy | U | mex | 8,735,360 | mex | 8,735,360 | mex | |
| SZ7889 | SC Swap | 14/09/2023 | Buy | U | mex | 9,800,000 | mex | 9,800,000 | mex | |
| SAN920 | SC Swap | 01/04/2021 | Buy | U | mex | 12,857,144 | mex | 12,857,144 | mex | |
| SAN924 | SC Swap | 01/04/2021 | Buy | U | mex | 12,857,144 | mex | 12,857,144 | mex | |
| SCK678 | SC Swap | 31/07/2021 | Buy | U | usm | 5,879,780 | usm | 5,879,780 | usm | |
| SCD030 | SC Swap | 27/07/2022 | Buy | U | usm | 11,167,546 | usm | 11,167,546 | usm | |
| SCK731 | SC Swap | 31/07/2021 | Buy | U | usm | 5,879,780 | usm | 5,879,780 | usm | |
| SCD126 | SC Swap | 27/07/2022 | Buy | U | usm | 11,167,546 | usm | 11,167,546 | usm | |
| SX6215 | SC Swap | 22/04/2022 | Buy | U | mex | 722,858,500 | mex | 722,858,500 | mex | |
| SCD054 | SC Swap | 21/02/2023 | Buy | U | mex | 21,463,898 | mex | 21,463,898 | mex | |
| SCD061 | SC Swap | 21/02/2023 | Buy | U | mex | 4,536,102 | mex | 4,536,102 | mex | |
| SCE092 | SC Swap | 04/05/2023 | Buy | U | mex | 2,907,102 | mex | 2,907,102 | mex | |
| SCD056 | SC Swap | 21/02/2023 | Buy | U | mex | 21,463,898 | mex | 21,463,898 | mex | |

| TransID | ProductID | MaturityDate | Buy/Sell Flag | Trans Status | Base CurID | PaySide Notional | PaySide CurID | RcvSide Notional | RcvSide CurID | Option Notional |
|---------|-----------|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| SCD062 | SC Swap | 21/02/2023 | Buy | U | mex | 4,536,102 | mex | 4,536,102 | mex | |
| SBD004 | SC Swap | 22/05/2023 | Buy | U | mex | 236,888,896 | mex | 236,888,896 | mex | |
| SBY527 | SC Swap | 22/05/2023 | Buy | U | mex | 158,479,852 | mex | 158,479,852 | mex | |
| SCF581 | SC Swap | 22/05/2023 | Buy | U | mex | 236,888,896 | mex | 236,888,896 | mex | |
| SCF584 | SC Swap | 22/05/2023 | Buy | U | mex | 158,479,852 | mex | 158,479,852 | mex | |
| SAV437 | SC Swap | 03/07/2024 | Buy | U | mex | 1,300,000,000 | mex | 1,300,000,000 | mex | |
| SCT727 | SC Swap | 03/07/2024 | Buy | U | mex | 1,300,000,000 | mex | 1,300,000,000 | mex | |
| SU5332 | SC Swap | 15/12/2020 | Buy | U | usm | 21,000,000 | usm | 21,000,000 | usm | |
| SU6298 | SC Swap | 15/12/2020 | Buy | U | usm | 21,000,000 | usm | 21,000,000 | usm | |
| SU7248 | SC Swap | 15/12/2020 | Buy | U | usm | 10,000,000 | usm | 10,000,000 | usm | |
| SU7294 | SC Swap | 15/12/2020 | Buy | U | usm | 10,000,000 | usm | 10,000,000 | usm | |
| SU5422 | SC Swap | 16/11/2021 | Buy | U | mex | 5,032,000 | mex | 5,032,000 | mex | |
| SU7201 | SC Swap | 16/11/2021 | Buy | U | mex | 2,765,000 | mex | 2,765,000 | mex | |
| SU9655 | SC Swap | 16/11/2021 | Buy | U | mex | 2,765,000 | mex | 2,765,000 | mex | |
| SU9656 | SC Swap | 16/11/2021 | Buy | U | mex | 5,032,000 | mex | 5,032,000 | mex | |
| SY3825 | SC Swap | 15/06/2022 | Buy | U | usm | 45,043,872 | usm | 45,043,872 | usm | |
| SY3829 | SC Swap | 15/06/2022 | Buy | U | usm | 45,043,872 | usm | 45,043,872 | usm | |
| SY3821 | SC Swap | 15/12/2023 | Buy | U | usm | 45,043,872 | usm | 45,043,872 | usm | |
| SY3835 | SC Swap | 15/12/2023 | Buy | U | usm | 45,043,872 | usm | 45,043,872 | usm | |
| SCD517 | SC Swap | 03/05/2024 | Buy | U | usm | 40,000,000 | usm | 40,000,000 | usm | |
| SCU438 | SC Swap | 03/11/2025 | Buy | U | mex | 29,751,120 | mex | 29,751,120 | mex | |
| SCU009 | SC Swap | 18/10/2030 | Buy | U | mex | 15,000,000 | mex | 15,000,000 | mex | |
| SW3679 | SC Swap | 27/11/2020 | Buy | U | mex | 1,851,280,000 | mex | 1,851,280,000 | mex | |
| SW3680 | SC Swap | 27/11/2020 | Buy | U | mex | 1,851,280,000 | mex | 1,851,280,000 | mex | |
| SCT816 | SC Swap | 17/10/2030 | Buy | U | mex | 15,000,000 | mex | 15,000,000 | mex | |
| SY2726 | SC Swap | 24/10/2022 | Buy | U | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| SAL507 | SC Swap | 01/02/2024 | Buy | U | mex | 220,000,000 | mex | 220,000,000 | mex | |
| SAL508 | SC Swap | 01/02/2024 | Buy | U | mex | 220,000,000 | mex | 220,000,000 | mex | |
| SAO211 | SC Swap | 01/02/2024 | Buy | U | mex | 130,000,000 | mex | 130,000,000 | mex | |
| SAO217 | SC Swap | 01/02/2024 | Buy | U | mex | 130,000,000 | mex | 130,000,000 | mex | |
| SV3944 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | U | mex | 70,000,000 | mex | 70,000,000 | mex | |
| SV4004 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | U | mex | 70,000,000 | mex | 70,000,000 | mex | |
| SV4064 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | U | mex | 70,000,000 | mex | 70,000,000 | mex | |
| SCK221 | SC Swap | 31/10/2022 | Buy | U | usm | 5,592,086 | usm | 5,592,086 | usm | |
| SCK222 | SC Swap | 31/10/2022 | Buy | U | usm | 5,592,086 | usm | 5,592,086 | usm | |
| SCM249 | SC Swap | 31/10/2022 | Buy | U | usm | 5,592,086 | usm | 5,592,086 | usm | |
| SAG775 | SC Swap | 30/11/2023 | Buy | U | usm | 10,000,000 | usm | 10,000,000 | usm | |
| SCE687 | SC Swap | 30/11/2023 | Buy | U | usm | 10,000,000 | usm | 10,000,000 | usm | |
| SCE688 | SC Swap | 30/11/2023 | Buy | U | usm | 10,000,000 | usm | 10,000,000 | usm | |
| SY6428 | SC Swap | 16/06/2022 | Buy | U | mex | 30,000,000 | mex | 30,000,000 | mex | |

| TransID | ProductID | MaturityDate | Buy/Sell Flag | Trans Status | Base CurID | PaySide Notional | PaySide CurID | RcvSide Notional | RcvSide CurID | Option Notional |
|---------|--------------|--------------|---------------|--------------|------------|------------------|---------------|------------------|---------------|-----------------|
| SX6188 | SC Swap | 26/06/2022 | Buy | U | mex | 144,700,000 | mex | 144,700,000 | mex | |
| SX6181 | SC Swap | 26/06/2022 | Buy | U | mex | 5,300,000 | mex | 5,300,000 | mex | |
| SU6729 | SC Swap | 30/01/2026 | Buy | U | mex | 2,075,000,000 | mex | 2,075,000,000 | mex | |
| SV3958 | SC Swap | 27/07/2023 | Buy | U | mex | 500,000,000 | mex | 500,000,000 | mex | |
| SV4018 | SC Swap | 27/07/2023 | Buy | U | mex | 500,000,000 | mex | 500,000,000 | mex | |
| SCJ823 | SC Swap | 14/04/2023 | Buy | U | usm | 20,000,000 | usm | 20,000,000 | usm | |
| SY2246 | SC Swap | 14/04/2023 | Buy | U | usm | 20,000,000 | usm | 20,000,000 | usm | |
| SBQ904 | SC Swap | 27/03/2027 | Buy | U | usm | 14,500,000 | usm | 14,500,000 | usm | |
| SBQ905 | SC Swap | 27/03/2027 | Buy | U | usm | 14,500,000 | usm | 14,500,000 | usm | |
| SAG356 | SC Swap | 30/11/2028 | Buy | U | usm | 11,000,000 | usm | 11,000,000 | usm | |
| SAG643 | SC Swap | 30/11/2028 | Buy | U | usm | 11,000,000 | usm | 11,000,000 | usm | |
| SAH551 | SC Swap | 21/06/2022 | Buy | U | mex | 12,700,000 | mex | 12,700,000 | mex | |
| SAH584 | SC Swap | 21/06/2022 | Buy | U | mex | 12,700,000 | mex | 12,700,000 | mex | |
| SCC987 | SC Swap | 21/06/2022 | Buy | U | mex | 25,300,000 | mex | 25,300,000 | mex | |
| SCD069 | SC Swap | 21/06/2022 | Buy | U | mex | 25,300,000 | mex | 25,300,000 | mex | |
| SZ3377 | SC Swap | 21/06/2022 | Buy | U | mex | 20,000,000 | mex | 20,000,000 | mex | |
| SZ3379 | SC Swap | 21/06/2022 | Buy | U | mex | 20,000,000 | mex | 20,000,000 | mex | |
| SAS862 | SC Swap | 07/06/2023 | Buy | U | mex | 122,577,117 | mex | 122,577,117 | mex | |
| SAS863 | SC Swap | 07/06/2023 | Buy | U | mex | 122,577,117 | mex | 122,577,117 | mex | |
| SAS870 | SC Swap | 07/06/2023 | Buy | U | mex | 122,577,117 | mex | 122,577,117 | mex | |
| SAV496 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | U | usm | 6,500,000 | usm | 6,500,000 | usm | |
| SAV506 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | U | usm | 6,500,000 | usm | 6,500,000 | usm | |
| SAV200 | SC Swap | 24/12/2020 | Buy | U | usm | 5,000,000 | usm | 5,000,000 | usm | |
| SAV250 | SC Swap | 24/12/2020 | Buy | U | usm | 5,000,000 | usm | 5,000,000 | usm | |
| SCE799 | SC Swap | 22/11/2024 | Buy | U | usm | 14,000,000 | usm | 14,000,000 | usm | |
| SCR867 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | U | mex | 64,277,775 | mex | 64,277,775 | mex | |
| SCR868 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | U | mex | 64,277,775 | mex | 64,277,775 | mex | |
| SCS070 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | U | mex | 18,788,890 | mex | 18,788,890 | mex | |
| SCS071 | SC Swap | 31/12/2020 | Buy | U | mex | 18,788,890 | mex | 18,788,890 | mex | |
| SCJ029 | SC Swap | 30/04/2025 | Buy | U | mex | 200,000,000 | mex | 200,000,000 | mex | |
| MN4917 | Term Deposit | 30/09/2021 | Buy | U | mex | 105,000,000 | mex | 105,000,000 | mex | |
| MP7819 | Term Deposit | 24/10/2022 | Buy | U | mex | 300,000,000 | mex | 300,000,000 | mex | |
| MAH132 | Term Deposit | 01/02/2024 | Buy | U | mex | 220,000,000 | mex | 220,000,000 | mex | |
| MAU630 | Term Deposit | 01/02/2024 | Buy | U | mex | 130,000,000 | mex | 130,000,000 | mex | |
| MHZ317 | Term Deposit | 31/10/2022 | Buy | U | usm | 5,592,086 | usm | 5,592,086 | usm | |
| MGU805 | Term Deposit | 30/11/2023 | Buy | U | usm | 10,000,000 | usm | 10,000,000 | usm | |
| MN1833 | Term Deposit | 31/12/2020 | Buy | U | mex | 70,000,000 | mex | 70,000,000 | mex | |
| MN1854 | Term Deposit | 27/07/2023 | Buy | U | mex | 500,000,000 | mex | 500,000,000 | mex | |
| MBU510 | Term Deposit | 07/06/2023 | Buy | U | mex | 122,577,117 | mex | 122,577,117 | mex | |
| MGF645 | Term Deposit | 15/03/2022 | Buy | U | usd | 20,000,000 | usd | 20,000,000 | usd | |
| MGR208 | Term Deposit | 27/04/2025 | Buy | U | usd | 10,000,000 | usd | 10,000,000 | usd | |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|----------|
| 2068323 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068324 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068325 | FX | 125,000 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068326 | FX | 8,188 | 02-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068580 | FX | 60,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068590 | FX | 60,000 | 05-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2054125 | FX | 100,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2054126 | FX | 100,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2057245 | FX | 100,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2057246 | FX | 100,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066474 | FX | 250,000 | 13-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066475 | FX | 250,000 | 13-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068581 | FX | 60,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068591 | FX | 60,000 | 19-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2064546 | FX | 100,000 | 28-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2064547 | FX | 100,000 | 28-oct-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068582 | FX | 60,000 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068592 | FX | 60,000 | 30-oct-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068327 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068328 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068329 | FX | 125,000 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068330 | FX | 8,188 | 04-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2057247 | FX | 100,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2057248 | FX | 100,000 | 10-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2054127 | FX | 100,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2054128 | FX | 100,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066476 | FX | 250,000 | 12-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066477 | FX | 250,000 | 12-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068583 | FX | 60,000 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068593 | FX | 60,000 | 13-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2064548 | FX | 100,000 | 25-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2064549 | FX | 100,000 | 25-nov-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068584 | FX | 60,000 | 30-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068594 | FX | 60,000 | 30-nov-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068287 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068288 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068289 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068331 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068332 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068333 | FX | 125,000 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068334 | FX | 8,188 | 03-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2063928 | FX | 100,000 | 04-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |

| Deal No | OTC type | Prin. Amt. | Expiration Date | CCY | P/C | CTR | Style | Portfolio | Status |
|---------|----------|------------|-----------------|-----|------|-----|-------|-----------|----------|
| 2063929 | FX | 100,000 | 04-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2057249 | FX | 100,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2057250 | FX | 100,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066478 | FX | 250,000 | 11-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066479 | FX | 250,000 | 11-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068585 | FX | 60,000 | 14-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068595 | FX | 60,000 | 14-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2059041 | FX | 13,632,620 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2059042 | FX | 13,632,620 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2059043 | FX | 13,632,620 | 17-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068586 | FX | 60,000 | 28-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2068596 | FX | 60,000 | 28-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066260 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066261 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066262 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066354 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066355 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066356 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066357 | FX | 28,821 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066396 | FX | 400,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066406 | FX | 400,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066529 | FX | 200,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066530 | FX | 200,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066531 | FX | 200,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066595 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066605 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066623 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066624 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066625 | FX | 300,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2066626 | FX | 27,500 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2067178 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2067179 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2067180 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2067181 | FX | 14,100 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2067213 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2067214 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2067215 | FX | 500,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2069139 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2069140 | FX | 250,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2069141 | FX | 400,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2069143 | FX | 400,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2074722 | FX | 125,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2074723 | FX | 125,000 | 29-dic-20 | USD | PUT | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |
| 2074724 | FX | 125,000 | 29-dic-20 | USD | CALL | MXN | EURO | NEGO | REVERSED |

Describir y numerar las llamadas de margen que se hayan presentado durante el trimestre

Respecto a las llamadas de margen, al 31 de diciembre de 2020 se tienen los siguientes saldos:

| CONTRAPARTE | Moneda | Colateral Recibido | Colateral Enviado |
|--------------|--------|----------------------|-------------------------|
| CLIENTE 1 | USD | - | (15,710,000) |
| CLIENTE 2 | USD | 1,774,962 | 0 |
| CLIENTE 3 | MXN | 0 | (465,600,000) |
| CLIENTE 4 | MXN | 136,300,000.00 | (54,000,000) |
| CLIENTE 5 | MXN | - | (8,548,703,574) |
| CLIENTE 6 | MXN | 1,000,000 | - |
| CLIENTE 7 | MXN | 87,500,000 | (75,800,000) |
| CLIENTE 8 | MXN | 3,600,000 | (18,300,000) |
| CLIENTE 9 | MXN | 917,500,051 | (1,022,900,000) |
| CLIENTE 10 | USD | 45,320,000 | (77,460,000) |
| CLIENTE 11 | MXN | 626,900,000 | (1,151,200,000) |
| CLIENTE 12 | USD | 8,940,000 | (9,130,000) |
| CLIENTE 13 | USD | 582,970,000 | - 56,400,000.00 |
| CLIENTE 14 | USD | 520,000 | 0 |
| CLIENTE 15 | USD | 3,800,000 | (1,210,000) |
| CLIENTE 16 | MXN | 57,300,000 | (446,400,000) |
| CLIENTE 17 | MXN | 0 | (65,400,000) |
| CLIENTE 18 | USD | 342,190 | 0 |
| CLIENTE 19 | MXN | 0 | (47,200,000) |
| CLIENTE 20 | USD | 0 | (150,000) |
| CLIENTE 21 | MXN | 0 | (2,801,810,847) |
| CLIENTE 22 | USD | 29,160,000 | (35,290,000) |
| CLIENTE 23 | MXN | 0 | (8,815,807,303) |
| CLIENTE 24 | MXN | 162,300,000 | - 85,200,000.00 |
| CLIENTE 25 | USD | 300,000 | (5,880,000) |
| CLIENTE 26 | USD | 630,000 | (130,000) |
| TOTAL | | 2,666,157,203 | (23,799,681,725) |

Revelación de cualquier incumplimiento que se haya presentado en los contratos respectivos

| Deal | Fecha de evento | Contraparte/ Cliente | Divisa | Monto a liquidar | Motivo del incumplimiento | Producto |
|---------------|-----------------|-------------------------|--------|---------------------|---|----------------------|
| SAK055 | 28/10/2020 | Cliente 1 | MXN | 1,339,765 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| 2065797 | 21/10/2020 | Cliente 2 | MXN | 10,780,000 | SE EQUIVOCARON DE BANCO AL ENVIAR LOS FONDOS | FX Options (Vanilla) |
| SX6539 | 29/10/2020 | Cliente 3 | MXN | 1,557,259 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| 2020040703161 | 29/10/2020 | Cliente 4 | MXN | 3,409,200 | NO FONDEO SU CUENTA | Forwards FX |
| SAR958 | 30/10/2020 | Cliente 5 | MXN | 102,098 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SBA823 | 30/10/2020 | Cliente 6 | MXN | 22,054 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SAI085 | 30/10/2020 | Cliente 6 | MXN | 618,075 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SAR594 | 03/11/2020 | Cliente 7 | MXN | 1,378,906 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| C63726 | 03/11/2020 | Cliente 8 | USD | 13,167 | NO FONDEO SU CUENTA | Cross Currency Swaps |
| P16586 | 03/11/2020 | Cliente 9 | MXN | 2,150,000 | NO FONDEO SU CUENTA | Caps & Floors |
| 2074211 | 09/11/2020 | Cliente 10 | MXN | 650,000 | NO FONDEO SU CUENTA | FX Options (Vanilla) |
| 2074003 | 09/11/2020 | Cliente 11 | MXN | 9,972 | NO FONDEO SU CUENTA | FX Options (Vanilla) |
| E63419 | 10/11/2020 | Cliente 12 | MXN | 1,021,200 | NO ENCONTRABAN LA OPERACIÓN PARA PODERLA CONFIRMAR | Equity Options |
| 2068149 | 10/11/2020 | Cliente 13 | MXN | 1,086,500 | NO FONDEO SU CUENTA | FX Options (Vanilla) |
| SX6242 | 23/11/2020 | Cliente 14 | MXN | 110,661 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SX6539 | 30/11/2020 | Cliente 15 | MXN | 1,667,365 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SAK055 | 30/11/2020 | Cliente 16 | MXN | 1,488,185 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| P15698 | 30/11/2020 | Cliente 17 | MXN | 8,544 | NO FONDEO SU CUENTA | Caps & Floors |
| SAR958 | 30/11/2020 | Cliente 18 | MXN | 106,526 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SBA823 | 30/11/2020 | Cliente 19 | MXN | 23,052 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| 2068158 | 01/12/2020 | Cliente 20 | MXN | 1,086,500 | NO FONDEO SU CUENTA | FX Options (Vanilla) |
| 2059036 | 21/12/2020 | Cliente 20 | MXN | 12,291,170 | NO ENVIO LOS FONDOS | FX Options (Vanilla) |
| SAK055 | 28/12/2020 | Cliente 21 | MXN | 1,274,014 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SX6539 | 29/12/2020 | Cliente 22 | MXN | 1,515,238 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SAI085 | 30/12/2020 | Cliente 23 | MXN | 627,675 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SAR958 | 30/12/2020 | Cliente 24 | MXN | 103,965 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |
| SBA823 | 30/12/2020 | Cliente 25 | MXN | 22,534 | NO FONDEO SU CUENTA | Interest Rate Swap |

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte

Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados

| Tipo de derivado, valor o contrato | Cobertura o Negociación | Nocional | Posición | ACTIVO SUBYACENTE | | VALOR RAZONABLE | | MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO | | | Colateral/ Línea de crédito/Valores dados en garantía |
|------------------------------------|-------------------------|-----------------|-------------|------------------------|------------------------|------------------|------------------|--------------------------------|----------------|-----------------|---|
| | | | | VP Trim Anterior | VP Trim Actual | VP Trim Anterior | VP Trim Actual | 0 A 1 AÑO | 1 A 5 AÑOS | 5 A 10 AÑOS | |
| Forwards | Nego | 1,261,718,252 | Compra | Divisas | Divisas | 88,929,635,098 | 51,636,848,749 | 1,115,347,264 | 146,370,988 | - | LINEA DE CREDITO |
| Forwards | Nego | 1,227,421,082 | Venta | Divisas | Divisas | (88,514,772,729) | (51,523,786,407) | 1,106,327,533 | 121,093,549 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 95,360,000 | Compra | Acción | Acción | 47,408,914 | 6,500,304 | - | 95,360,000 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 95,360,000 | Venta | Acción | Acción | (24,568,326) | (6,500,304) | - | 95,360,000 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 419,460,914 | Compra | Divisas | Divisas | 260,769,638 | 264,215,888 | 394,288,757 | 25,172,157 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 419,460,914 | Venta | Divisas | Divisas | (240,911,544) | (256,381,088) | 394,288,757 | 25,172,157 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 3,276,652,700 | Compra | Índice | Índice | 208,914,259 | 266,743,187 | 209,960,000 | 3,066,692,700 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 1,804,581,700 | Venta | Índice | Índice | (52,214,876) | (32,643,866) | 419,920,000 | 1,384,661,700 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 25,849,612,049 | Compra | Tasas | Tasas | 123,065,507 | 123,303,755 | 1,375,700,000 | 20,716,817,547 | 3,757,094,502 | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 26,220,297,970 | Venta | Tasas | Tasas | (122,289,742) | (123,311,568) | 1,375,700,000 | 20,996,734,670 | 3,847,863,300 | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | - | Compra | Acción NE | Acción NE | 1,510,025 | - | - | - | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | - | Venta | Acción NE | Acción NE | (24,348,095) | - | - | - | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 1,005,671,700 | Compra | Índice | Índice NE | 18,127,829 | 24,153,161 | 419,920,000 | 585,751,700 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 2,477,742,700 | Venta | Índice | Índice NE | (174,078,543) | (257,867,029) | 209,960,000 | 2,267,782,700 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 12,452,949 | Compra | Divisas NE | Divisas NE | 57,181,757 | 7,263,122 | 8,618,459 | 3,834,490.00 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 12,452,949 | Venta | Divisas NE | Divisas NE | (77,039,851) | (15,097,928) | 8,618,459 | 3,834,490.00 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 1,309,933 | Compra | Tasas NE | Tasas NE | 0.1 | 1.9 | - | 1,309,933 | - | LINEA DE CREDITO |
| Opción | Nego | 1,309,933 | Venta | Tasas NE | Tasas NE | (1) | (51.82) | - | 1,309,933 | - | LINEA DE CREDITO |
| Swaps | Cobe | 470,542,645 | CCIRS / IRS | FIJA USD / LIBOR USD | FIJA USD / LIBOR USD | 11,638,241 | 332,176,211 | - | 252,930,088 | 217,612,558 | LINEA DE CREDITO |
| Swaps | Cobe | 4,518,000 | CCIRS | LIBOR USD / TASA DE | LIBOR USD / TASA DE | (16,438,238) | (6,031,610) | - | 4,518,000 | - | LINEA DE CREDITO |
| Swaps | Cobe | 44,313,996,029 | CCIRS / IRS | FIJA MXN /TASA DE | FIJA MXN /TASA DE | (2,378,785,081) | (2,541,801,082) | - | 26,974,329,421 | 17,339,666,608 | LINEA DE CREDITO |
| Swaps | Cobe | 4,000,000 | CCIRS | FIJA EUR / LIBOR USD | FIJA EUR / LIBOR USD | (6,756,266) | (10,262,586) | - | 4,000,000 | - | LINEA DE CREDITO |
| Swaps | Nego | 24,996,781 | CCIRS | FIJA EUR / LIBOR USD / | FIJA EUR / LIBOR USD / | (53,068,112) | (57,971,957) | - | 7,046,683 | 17,950,099 | LINEA DE CREDITO |
| Swaps | Nego | 1,239,121,474 | CCIRS / IRS | FIJA USD / LIBOR USD | FIJA USD / LIBOR USD | (2,196,812,308) | (1,233,742,389) | - | 471,289,490 | 767,831,983 | LINEA DE CREDITO |
| Swaps | Nego | 294,172,445,561 | CCIRS / IRS | FIJA MXN /TASA DE | FIJA MXN /TASA DE | (8,761,570,030) | (11,511,542,902) | 57,449,499,121 | 96,049,572,110 | 140,673,374,329 | LINEA DE CREDITO |
| Swaps | Nego | 1,646,820,439 | CCIRS / IRS | LIBOR USD / FIJA USD | LIBOR USD / FIJA USD | 726,059,512 | 1,693,497,264 | 144,671,610 | 633,014,757 | 869,134,072 | LINEA DE CREDITO |
| Swaps | Nego | 293,206,085,994 | CCIRS / IRS | TASA DE INTERES TIIE | TASA DE INTERES TIIE | 9,894,092,430 | 10,828,451,280 | 60,488,481,388 | 83,500,998,538 | 149,216,606,068 | LINEA DE CREDITO |

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2020

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

| CUENTA | SUB-CUENTA | SUB-SUBCUENTA | CUENTA / SUBCUENTA | CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE | TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE |
|-------------|-------------|---------------|--|-------------------------------|--------------------------------|
| 10000000000 | | | A C T I V O | 637,762,866,158 | 584,028,028,584 |
| 11000000000 | | | DISPONIBILIDADES | 29,954,562,605 | 37,943,486,324 |
| 11500000000 | | | CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS) | 2,730,032,047 | 1,016,678,942 |
| 12000000000 | | | INVERSIONES EN VALORES | 125,870,405,599 | 93,714,511,017 |
| | 12010000000 | | Títulos para negociar | 56,214,184,797 | 48,400,505,418 |
| | 12020000000 | | Títulos disponibles para la venta | 64,607,979,399 | 40,370,863,178 |
| | 12030000000 | | Títulos conservados a vencimiento | 5,048,241,403 | 4,943,142,421 |
| 12080000000 | | | DEUDORES POR REPORTO (SALDO DEUDOR) | 27,858,851,334 | 2,574,439,348 |
| 12070000000 | | | PRÉSTAMO DE VALORES | 0 | 0 |
| 12140000000 | | | DERIVADOS | 23,996,194,388 | 13,959,257,636 |
| | 12140600000 | | Con fines de negociación | 19,989,897,087 | 9,907,477,772 |
| | 12140700000 | | Con fines de cobertura | 4,006,297,301 | 4,051,779,864 |
| 12170000000 | | | AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS | 575,843,531 | 168,311,305 |
| 12800000000 | | | TOTAL DE CARTERA DE CRÉDITO NETO | 398,142,828,901 | 402,125,105,974 |
| 12900000000 | | | CARTERA DE CRÉDITO NETA | 398,142,828,901 | 402,125,105,974 |
| 12950000000 | | | Cartera de crédito | 415,205,784,593 | 413,730,763,577 |
| 13000000000 | | | CARTERA DE CRÉDITO VIGENTE | 402,544,696,301 | 403,945,684,216 |
| | 13010000000 | | Créditos comerciales | 217,298,849,541 | 225,718,412,299 |
| | | 130107010000 | Actividad empresarial o comercial | 179,409,438,544 | 176,384,850,107 |
| | | 130107020000 | Entidades financieras | 28,878,120,544 | 35,281,555,391 |
| | | 130107030000 | Entidades gubernamentales | 9,011,290,453 | 14,052,006,801 |
| | 13110000000 | | Créditos de consumo | 39,036,322,426 | 44,600,516,283 |
| | 13210000000 | | Créditos a la vivienda | 146,209,524,334 | 133,626,755,634 |
| | | 132107010000 | Media y residencial | 140,985,501,752 | 129,054,662,263 |
| | | 132107020000 | De interés social | 6,542,168 | 80,772,365 |
| | | 132107030000 | Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE | 5,217,480,414 | 4,491,321,006 |
| | | 132107040000 | Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos | 0 | 0 |
| | 13310000000 | | Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal | 0 | 0 |
| 13500000000 | | | CARTERA DE CRÉDITO VENCIDA | 12,661,088,292 | 9,785,079,361 |
| | 13505100000 | | Créditos comerciales | 4,851,665,561 | 4,163,326,983 |
| | | 135051010000 | Actividad empresarial o comercial | 4,770,150,298 | 4,081,811,720 |
| | | 135051020000 | Entidades financieras | 81,515,263 | 81,515,263 |
| | | 135051030000 | Entidades gubernamentales | 0 | 0 |
| | 13506100000 | | Créditos de consumo | 2,526,460,973 | 1,904,464,504 |
| | 13507100000 | | Créditos a la vivienda | 5,282,961,758 | 3,717,287,874 |
| | | 135071010000 | Media y residencial | 5,173,589,902 | 3,702,592,182 |
| | | 135071020000 | De interés social | 18,579,587 | 13,570,491 |
| | | 135071030000 | Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE | 90,792,269 | 1,125,201 |
| | | 135071040000 | Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos | 0 | 0 |
| 13900000000 | | | ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS | -17,062,955,692 | -11,605,657,603 |
| 13970000000 | | | Derechos de cobro (neto) | 0 | 0 |
| | 13979800000 | | DERECHOS DE COBRO ADQUIRIDOS | 0 | 0 |
| | 13979900000 | | ESTIMACIÓN POR IRRECUPERABILIDAD O DIFÍCIL COBRO | 0 | 0 |
| 17970000000 | | | BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN | 0 | 0 |
| 14000000000 | | | Otras cuentas por cobrar | 12,564,288,665 | 18,280,864,102 |
| 15000000000 | | | Bienes adjudicados | 200,835,068 | 120,151,605 |
| 16000000000 | | | Propiedades, mobiliario y equipo | 3,380,337,417 | 3,408,589,760 |
| 17000000000 | | | INVERSIONES PERMANENTES | 51,751,125 | 51,472,031 |
| 17950000000 | | | ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA | 21,650,131 | 23,544,331 |
| 18000000000 | | | Impuestos y ptu diferidos (a favor) | 6,661,601,932 | 4,660,669,792 |
| 19000000000 | | | OTROS ACTIVOS | 5,753,683,415 | 5,980,946,417 |
| | 19030000000 | | Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles | 5,753,683,415 | 5,980,926,712 |
| | 19160000000 | | Otros activos a corto y largo plazo | 0 | 19,705 |
| 20000000000 | | | P A S I V O | 582,441,526,280 | 530,832,104,865 |
| 21000000000 | | | CAPTACIÓN TRADICIONAL | 406,124,766,835 | 364,871,084,345 |
| | 21010000000 | | Depósitos de exigibilidad inmediata | 202,353,589,121 | 167,239,959,322 |
| | 21110000000 | | Depósitos a plazo | 170,157,324,774 | 155,867,319,232 |
| | | 211101000000 | Del público en general | 154,621,122,712 | 109,087,372,747 |
| | | 211102000000 | Mercado de dinero | 15,536,202,062 | 46,779,946,485 |
| | | 211103000000 | Fondos especiales | 0 | 0 |

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2020

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

| CUENTA | SUB-CUENTA | SUB-SUBCUENTA | CUENTA / SUBCUENTA | CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE | TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE |
|--------------|--------------|---------------|--|----------------------------------|-----------------------------------|
| | 212500000000 | | Títulos de crédito emitidos | 33,000,148,489 | 41,152,345,662 |
| | 216100000000 | | Cuenta global de captación sin movimientos | 613,704,451 | 611,460,129 |
| 230000000000 | | | PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS | 66,611,979,486 | 55,642,163,718 |
| | 230100000000 | | De exigibilidad inmediata | 0 | 0 |
| | 230200000000 | | De corto plazo | 33,145,852,918 | 23,226,041,412 |
| | 230300000000 | | De largo plazo | 33,466,126,568 | 32,416,122,306 |
| 203000000000 | | | VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR | 3,193,367,188 | 8,163,096,968 |
| 220800000000 | | | ACREEDORES POR REPORTE | 42,891,327,912 | 49,134,964,282 |
| 220700000000 | | | PRÉSTAMO DE VALORES | 15,923 | 0 |
| 220900000000 | | | COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA | 522,783,630 | 0 |
| | 220901000000 | | Reportos | 0 | 0 |
| | 220902000000 | | Préstamo de valores | 522,783,630 | 0 |
| | 220903000000 | | Derivados | 0 | 0 |
| | 220990000000 | | Otros colaterales vendidos | 0 | 0 |
| 221400000000 | | | DERIVADOS | 26,298,455,153 | 14,285,840,327 |
| | 221406000000 | | Con fines de negociación | 20,065,818,213 | 9,696,574,733 |
| | 221407000000 | | Con fines de cobertura | 6,232,636,940 | 4,589,265,594 |
| 221700000000 | | | AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS | 12,937,388 | 18,210,310 |
| 221900000000 | | | OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN | 0 | 0 |
| 225000000000 | | | Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal | 0 | 0 |
| 240000000000 | | | OTRAS CUENTAS POR PAGAR | 26,083,586,627 | 28,197,407,147 |
| | 240200000000 | | Impuestos a la utilidad por pagar | 1,570,673,699 | 792,000,273 |
| | 240800000000 | | Participación de los trabajadores en las utilidades por pagar | 0 | 0 |
| | 240300000000 | | Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno | 0 | 0 |
| | 240900000000 | | Acreedores por liquidación de operaciones | 11,931,459,473 | 17,151,670,505 |
| | 241000000000 | | Acreedores por cuentas de margen | 0 | 0 |
| | 241300000000 | | Acreedores por colaterales recibidos en efectivo | 886,912,330 | 1,034,195,488 |
| | 240100000000 | | Acreedores diversos y otras cuentas por pagar | 11,694,541,125 | 9,219,540,881 |
| 270000000000 | | | OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN | 9,051,585,647 | 9,045,826,155 |
| 280000000000 | | | Impuestos y ptu diferidos (a cargo) | 0 | 0 |
| 290000000000 | | | CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS | 1,650,720,491 | 1,473,511,613 |
| 400000000000 | | | CAPITAL CONTABLE | 55,321,339,878 | 53,195,923,719 |
| 450000000000 | | | Participación controladora | 55,321,125,241 | 53,195,720,153 |
| 410000000000 | | | CAPITAL CONTRIBUIDO | 10,876,764,482 | 10,876,764,482 |
| | 410100000000 | | Capital social | 10,404,165,369 | 10,404,165,369 |
| | 410700000000 | | Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno | 0 | 0 |
| | 410400000000 | | Prima en venta de acciones | 472,599,113 | 472,599,113 |
| | 411100000000 | | Obligaciones subordinadas en circulación | 0 | 0 |
| 420000000000 | | | CAPITAL GANADO | 44,444,360,759 | 42,318,955,671 |
| | 420100000000 | | Reservas de capital | 6,757,848,750 | 6,263,000,124 |
| | 420300000000 | | Resultado de ejercicios anteriores | 36,432,175,039 | 31,961,340,428 |
| | 420500000000 | | Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta | 416,755,619 | 60,504,632 |
| | 421500000000 | | Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo | -1,161,122,172 | -103,919,874 |
| | 421700000000 | | Efecto acumulado por conversión | 0 | 0 |
| | 422300000000 | | Remediones por beneficios definidos a los empleados | -1,019,973,949 | -810,455,900 |
| | 420900000000 | | Resultado por tenencia de activos no monetarios | 0 | 0 |
| | 421100000000 | | Resultado neto | 3,018,677,472 | 4,948,486,261 |
| 430000000000 | | | PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA | 214,637 | 203,566 |
| | 431000000000 | | Resultado neto correspondiente a la participación no controladora | 11,071 | 20,864 |
| | 439000000000 | | Otra participación no controladora | 203,566 | 182,702 |
| 700000000000 | | | CUENTAS DE ORDEN | 2,936,803,659,677 | 2,808,687,231,912 |
| 710000000000 | | | Avales otorgados | 0 | 0 |
| 790000000000 | | | Activos y pasivos contingentes | 0 | 2,977,405 |
| 730000000000 | | | Compromisos crediticios | 276,490,161,364 | 247,831,271,705 |
| 740000000000 | | | Bienes en fideicomiso o mandato | 426,700,819,947 | 231,487,238,625 |
| | 740100000000 | | Fideicomisos | 397,695,238,077 | 202,190,791,427 |
| | 740200000000 | | Mandatos | 29,005,581,870 | 29,296,447,198 |
| 770300000000 | | | Agente financiero del Gobierno Federal | 0 | 0 |
| 750000000000 | | | Bienes en custodia o en administración | 593,803,041,594 | 696,902,158,036 |
| 773100000000 | | | Colaterales recibidos por la entidad | 36,720,848,230 | 32,557,709,578 |

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

| | | | | CIERRE PERIODO ACTUAL | TRIMESTRE AÑO ANTERIOR |
|--------------|------------|---------------|--|--------------------------|---------------------------|
| CUENTA | SUB-CUENTA | SUB-SUBCUENTA | CUENTA / SUBCUENTA | IMPORTE | IMPORTE |
| 773200000000 | | | Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad | 522,783,630 | 0 |
| 760000000000 | | | Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros | 135,627,969,117 | 99,712,683,187 |
| 771000000000 | | | Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida | 643,524,781 | 474,321,498 |
| 780000000000 | | | Otras cuentas de registro | 1,466,294,511,014 | 1,499,718,871,878 |

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

ESTADO DE RESULTADOS DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 31 DE DICIEMBRE DE 2020 Y 2019

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

| CUENTA | CUENTA / SUBCUENTA | TRIMESTRE AÑO ACTUAL | TRIMESTRE AÑO ANTERIOR |
|--------------|---|----------------------|------------------------|
| | | IMPORTE | IMPORTE |
| 510000000000 | Ingresos por intereses | 48,275,303,849 | 50,720,147,997 |
| 610000000000 | Gastos por intereses | 23,082,830,670 | 27,457,967,203 |
| 520000000000 | Resultado por posición monetaria neto (margen financiero) | 0 | 0 |
| 670100000000 | MARGEN FINANCIERO | 25,192,473,179 | 23,262,180,794 |
| 620000000000 | Estimación preventiva para riesgos crediticios | 10,163,814,901 | 5,884,972,813 |
| 670200000000 | MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS | 15,028,658,278 | 17,377,207,981 |
| 530000000000 | Comisiones y tarifas cobradas | 4,844,766,296 | 5,136,230,595 |
| 630000000000 | Comisiones y tarifas pagadas | 1,020,615,076 | 878,376,825 |
| 540000000000 | Resultado por intermediación | 2,333,806,823 | 640,510,773 |
| 505000000000 | Otros ingresos (egresos) de la operación | 1,732,048,278 | 2,230,334,455 |
| 590000000000 | Subsidios | 0 | 0 |
| 640000000000 | Gastos de administración y promoción | 18,919,873,865 | 17,716,506,522 |
| 670400000000 | RESULTADO DE LA OPERACIÓN | 3,998,790,734 | 6,789,400,457 |
| 570000000000 | Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos | 1,323,586 | 950,694 |
| 672500000000 | RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD | 4,000,114,320 | 6,790,351,151 |
| 660000000000 | Impuestos a la utilidad causados | 2,677,689,207 | 1,846,752,721 |
| 560000000000 | Impuestos a la utilidad diferidos | 1,696,263,430 | 4,908,695 |
| 670700000000 | RESULTADO ANTES DE OPERACIONES DISCONTINUADAS | 3,018,688,543 | 4,948,507,125 |
| 580000000000 | Operaciones discontinuadas | 0 | 0 |
| 671100000000 | RESULTADO NETO | 3,018,677,472 | 4,948,486,261 |
| 670900000000 | Participación controladora | 3,018,677,472 | 4,948,486,261 |
| 671300000000 | Participación no controladora | 11,071 | 20,864 |

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2020

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

| | | | AÑO ACTUAL | AÑO ANTERIOR |
|--------------|--------------|--|-----------------|-----------------|
| CUENTA | SUB-CUENTA | CUENTA / SUBCUENTA | IMPORTE | IMPORTE |
| 820103500000 | | Resultado neto | 3,018,688,543 | 4,948,507,125 |
| 820103600000 | | Ajustes por partidas que no implican flujo de efectivo: | 10,631,610,815 | 7,603,945,010 |
| | 820103600100 | Pérdidas por deterioro o efecto por reversión del deterioro asociados a actividades de inversión | 36,560,576 | 7,133,234 |
| | 820103600200 | Depreciaciones de propiedades, mobiliario y equipo | 502,002,230 | 523,455,531 |
| | 820103600300 | Amortizaciones de activo intangibles | 417,869,466 | 322,339,684 |
| | 820103600400 | Provisiones | 9,000,604,720 | 5,884,576,721 |
| | 820103600500 | Impuestos a la utilidad causados y diferidos | 981,425,777 | 1,841,844,026 |
| | 820103600600 | Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos | -1,323,586 | -950,694 |
| | 820103600700 | Operaciones discontinuadas | 0 | 0 |
| | 820103609000 | Otros | -305,528,368 | -974,453,492 |
| | | Actividades de operación | | |
| | 820103010000 | Cambio en cuentas de margen | -1,713,353,105 | -988,033,165 |
| | 820103020000 | Cambio en inversiones en valores | -37,160,507,008 | -21,628,198,281 |
| | 820103030000 | Cambio en deudores por reporto | -25,284,411,986 | 728,194,067 |
| | 820103040000 | Cambio en préstamo de valores (activo) | 0 | 0 |
| | 820103050000 | Cambio en derivados (activo) | -10,911,629,480 | 10,639,095,072 |
| | 820103060000 | Cambio de cartera de crédito (neto) | -6,181,537,828 | -47,423,659,067 |
| | 820103070000 | Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto) | 0 | 0 |
| | 820103080000 | Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización | 0 | 0 |
| | 820103090000 | Cambio en bienes adjudicados (neto) | -92,600,446 | -44,474,541 |
| | 820103100000 | Cambio en otros activos operativos (neto) | 7,564,391,412 | -8,092,654,231 |
| | 820103110000 | Cambio en captación tradicional | 41,253,682,490 | 9,510,773,208 |
| | 820103120000 | Cambio en préstamos interbancarios y de otros organismos | 10,969,815,768 | 25,307,990,086 |
| | 820103130000 | Cambio en acreedores por reporto | -6,243,636,370 | 15,332,647,583 |
| | 820103140000 | Cambio en préstamo de valores (pasivo) | 15,923 | 0 |
| | 820103150000 | Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía | 522,783,630 | 0 |
| | 820103160000 | Cambio en derivados (pasivo) | 11,867,883,484 | -10,413,402,840 |
| | 820103170000 | Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización | 0 | 0 |
| | 820103180000 | Cambio en obligaciones subordinadas con características de pasivo | 5,759,492 | 2,234,405 |
| | 820103190000 | Cambio en otros pasivos operativos | -3,691,114,701 | 7,241,053,130 |
| | 820103200000 | Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación) | 0 | 0 |
| | 820103230000 | Cobros de impuestos a la utilidad (devoluciones) | 0 | 0 |
| | 820103240000 | Pagos de impuestos a la utilidad | -1,899,072,019 | -313,280,884 |
| | 820103900000 | Otros | 0 | 0 |
| 820103000000 | | Flujos netos de efectivo de actividades de operación | -20,993,530,744 | -20,141,715,458 |
| | | Actividades de inversión | | |
| | 820104010000 | Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo | 0 | 184,000,000 |
| | 820104020000 | Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo | -473,749,887 | -265,379,503 |
| | 820104030000 | Cobros por disposición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto | 0 | 0 |
| | 820104040000 | Pagos por adquisición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto | 0 | 0 |
| | 820104050000 | Cobros por disposición de otras inversiones permanentes | 0 | 0 |
| | 820104060000 | Pagos por adquisición de otras inversiones permanentes | 0 | 0 |
| | 820104070000 | Cobros de dividendos en efectivo | 1,044,492 | 800,036 |
| | 820104080000 | Pagos por adquisición de activos intangibles | -172,986,938 | -294,195,276 |
| | 820104090000 | Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta | 0 | 0 |
| | 820104100000 | Cobros por disposición de otros activos de larga duración | 0 | 0 |
| | 820104110000 | Pagos por adquisición de otros activos de larga duración | 0 | 0 |
| | 820104120000 | Cobros asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión) | 0 | 0 |
| | 820104130000 | Pagos asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión) | 0 | 0 |
| | 820104900000 | Otros | 0 | 0 |
| 820104000000 | | Flujos netos de efectivo de actividades de inversión | -645,692,333 | -374,774,743 |
| | | Actividades de financiamiento | | |
| | 820105010000 | Cobros por emisión de acciones | 0 | 0 |
| | 820105020000 | Pagos por reembolsos de capital social | 0 | 0 |
| | 820105030000 | Pagos de dividendos en efectivo | 0 | 0 |
| | 820105040000 | Pagos asociados a la recompra de acciones propias | 0 | 0 |
| | 820105050000 | Cobros por la emisión de obligaciones subordinadas con características de capital | 0 | 0 |
| | 820105060000 | Pagos asociados a obligaciones subordinadas con características de capital | 0 | 0 |
| | 820105900000 | Otros | 0 | 0 |
| 820105000000 | | Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento | 0 | 0 |

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

**ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO**

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

| | | | AÑO ACTUAL | AÑO ANTERIOR |
|--------------|------------|--|----------------|----------------|
| CUENTA | SUB-CUENTA | CUENTA / SUBCUENTA | IMPORTE | IMPORTE |
| 820100000000 | | Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo | -7,988,923,719 | -7,964,038,066 |
| 820400000000 | | Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo | 0 | 0 |
| 820200000000 | | Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo | 37,943,486,324 | 45,907,524,390 |
| 820000000000 | | Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo | 29,954,562,605 | 37,943,486,324 |

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB
 SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
 GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
 INVERLAT

ESTADO DE VARIACIONES EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO
 AL 31 DE DICIEMBRE DE 2020 Y 2019

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

| Concepto | Participación controladora | Capital contribuido | | | | Capital Ganado | | | | | | | | Participación no controladora | Capital contable |
|--|----------------------------|---------------------|--|----------------------------|--|---------------------|------------------------------------|--|--|---------------------------------|---|---|----------------|-------------------------------|------------------|
| | | Capital social | Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno | Prima en venta de acciones | Obligaciones subordinadas en circulación | Reservas de capital | Resultado de ejercicios anteriores | Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta | Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo | Efecto Acumulado por conversión | Remediones por beneficios definidos a los empleados | Resultado por tenencia de activos no monetarios | Resultado neto | | |
| Saldo al inicio del periodo | 53,195,720,153 | 10,404,165,369 | 0 | 472,599,113 | 0 | 6,263,000,124 | 31,961,340,428 | 60,504,632 | -103,919,874 | 0 | -810,455,900 | 0 | 4,948,486,261 | 203,566 | 53,195,923,719 |
| MOVIMIENTOS INHERENTES A LAS DECISIONES DE LOS PROPIETARIOS | | | | | | | | | | | | | | | |
| Suscripción de acciones | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Capitalización de utilidades | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Constitución de reservas | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 494,848,626 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -494,848,626 | 0 | 0 |
| Traspaso del resultado neto a resultado de ejercicios anteriores | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 4,453,637,635 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -4,453,637,635 | 0 | 0 |
| Pago de dividendos | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total por movimientos inherentes a las decisiones de los propietarios | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 494,848,626 | 4,453,637,635 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -4,948,486,261 | 0 | 0 |
| MOVIMIENTOS INHERENTES AL RECONOCIMIENTO DE LA UTILIDAD INTEGRAL | | | | | | | | | | | | | | | |
| -Resultado neto | 3,018,677,472 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 3,018,677,472 | 11,071 | 3,018,688,543 |
| -Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta | 356,250,987 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 356,250,987 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 356,250,987 |
| -Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo. | -1,057,202,298 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -1,057,202,298 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | -1,057,202,298 |
| -Efecto acumulado por conversión | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Remediones por beneficios definidos a los empleados | -192,321,073 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 17,196,976 | 0 | 0 | 0 | -209,518,049 | 0 | 0 | 0 | -192,321,073 |
| -Resultado por tenencia de activos no monetarios | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Otros | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Total de movimientos inherentes al reconocimiento de la utilidad integral | 2,125,405,088 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 17,196,976 | 356,250,987 | -1,057,202,298 | 0 | -209,518,049 | 0 | 3,018,677,472 | 11,071 | 2,125,416,159 |
| Saldo al final del periodo | 55,321,125,241 | 10,404,165,369 | 0 | 472,599,113 | 0 | 6,757,848,750 | 36,432,175,039 | 416,755,619 | -1,161,122,172 | 0 | -1,019,973,949 | 0 | 3,018,677,472 | 214,637 | 55,321,339,878 |

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 29

CONSOLIDADO

Impresión Final

(1) Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 26 de febrero de 2021, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y H. Valerio Bustos Quiroz (Director Contabilidad Grupo) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

Los estados financieros consolidados del Banco incluyen los de las subsidiarias en las que ejerce control: la Inmobiliaria, Scotia Servicios y Scotia Derivados. Los saldos y operaciones importantes con estas compañías se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados.

La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2020 y 2019.

Los accionistas y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (la Comisión Bancaria) tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2020 adjuntos, se someterán a la aprobación de la próxima Asamblea de Accionistas.

Bases de presentación

a) Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados adjuntos se prepararon de conformidad con la legislación bancaria y de acuerdo con los criterios de contabilidad para las instituciones de crédito en México, establecidos por la Comisión Bancaria (los Criterios Contables), quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las instituciones de crédito, así como la revisión de su información financiera.

Los Criterios Contables señalan que a falta de criterio contable expreso de la Comisión Bancaria para las instituciones de crédito, y en un contexto más amplio de las Normas de Información Financiera (NIF) emitidas por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A. C. (CINIF), se observará el proceso de supletoriedad establecido en la NIF A-8 y, sólo en caso de que las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) a que se refiere la NIF A-8 no den solución al reconocimiento contable, se podrá optar por una norma supletoria que pertenezca a cualquier otro esquema normativo, siempre que cumpla con todos los requisitos señalados en la mencionada NIF, debiéndose aplicar la supletoriedad en el siguiente orden: los principios de contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP) y después cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando no contravengan los criterios de la Comisión Bancaria.

b) Uso de juicios y estimaciones

La preparación de los estados financieros consolidados requiere que la Administración efectúe estimaciones y suposiciones que afectan los importes registrados de activos y pasivos y la revelación de activos y pasivos contingentes a la fecha de los estados financieros consolidados, así como los importes registrados de ingresos y gastos

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

Juicios

La información sobre juicios realizados en la aplicación de políticas contables que tienen el efecto más importante sobre los importes reconocidos en los estados financieros consolidados se describe en las notas a los estados financieros consolidados que se mencionan más adelante.

Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

La información sobre supuestos e incertidumbres de estimación que tienen un riesgo significativo de resultar en un ajuste material a los importes en los libros de activos y pasivos en el siguiente año se incluye en las siguientes notas a los estados financieros consolidados:

-Valuación de instrumentos financieros derivados: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo (ver nota 10);

-Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios: supuestos e insumos utilizados en su determinación (ver nota 11(e) y (f));

-Deterioro de inmuebles, mobiliario y equipo: Pruebas de deterioro del valor de activos fijos, incluyendo los supuestos claves para determinación del importe recuperable de dichos activos (ver nota 13);

-Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves (ver nota 17);

-Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables y la materialización de los impuestos diferidos (ver nota 18).

c) Moneda funcional y de informe

Los estados financieros consolidados antes mencionados se presentan en moneda de informe peso mexicano, que es igual a la moneda de registro y a su moneda funcional.

Para propósitos de revelación en las notas a los estados financieros consolidados, cuando se hace referencia a pesos o "\$", se trata de millones de pesos mexicanos, y cuando se hace referencia a dólares o "USD", se trata de millones de dólares de los Estados Unidos de América.

d) Reconocimiento de activos y pasivos por instrumentos financieros

Los estados financieros consolidados adjuntos reconocen los activos y pasivos provenientes de operaciones de compraventa de divisas, inversiones en valores, reportos y derivados en la fecha en que la operación es concertada, independientemente de su fecha de liquidación.

(2) Resumen de las principales políticas contables-

Las políticas contables que se muestran en la preparación de los estados financieros consolidados que se presentan a continuación, han sido aplicadas consistentemente por

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 3 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

el Banco, excepto por los Criterios Contables especiales aplicados en el año, los cuales se detallan en la nota 4.

(a) Reconocimiento de los efectos de la inflación-

Los estados financieros consolidados adjuntos incluyen el reconocimiento de la inflación con base en Unidades de Inversión (UDI) hasta el 31 de diciembre de 2007, de acuerdo con los Criterios Contables aplicables.

Los ejercicios terminados el 31 de diciembre de 2020 y 2019, son considerados como entorno económico no inflacionario (inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores menor que el 26%), conforme a lo establecido en la NIF B-10 "Efectos de la inflación"; consecuentemente no se reconocen los efectos de la inflación en la información financiera del Banco. En caso de que se vuelva a estar en un entorno inflacionario, se deberán registrar de manera retrospectiva los efectos acumulados de la inflación no reconocidos en los periodos en los que el entorno fue calificado como no inflacionario. El porcentaje de inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores se muestra a continuación:

| | Inflación |
|------|--|
| | 31 de diciembre de UDI Del año Acumulada |
| 2020 | 6.6055973.23%11.31% |
| 2019 | 6.3990182.77%15.03% |
| 2018 | 6.2266314.92%15.71% |

(b) Bases de consolidación-

Los estados financieros consolidados incluyen los estados financieros del Banco y los de sus subsidiarias en las que ejerce control. Los saldos y operaciones importantes entre las compañías se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados.

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2020 y 2019, se detallan a continuación:

| Subsidiaria | Participación | Ubicación | Actividad |
|------------------|---------------|------------------|--|
| Inmobiliaria | 99.99% | Ciudad de México | Administración de activo fijo |
| Scotia Servicios | 99.99% | Ciudad de México | Apoya la administración del negocio adquirente de tarjeta de crédito |
| Scotia Derivados | 99.99% | Ciudad de México | Operador de contratos de futuros y opciones en Mexder |

(c) Disponibilidades-

Este rubro se compone de efectivo, saldos bancarios en moneda nacional y dólares, así como operaciones de compraventa de divisas que no se consideren derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable. Adicionalmente, incluye disponibilidades restringidas conformadas por préstamos interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días (operaciones de "Call Money") y depósitos en el Banco Central, estos últimos incluyen los depósitos de regulación monetaria que el Banco está obligado a mantener conforme a las disposiciones emitidas por el Banco Central con el propósito de regular la liquidez en el mercado de dinero; dichos depósitos carecen de plazo, y generan intereses a la tasa promedio de la captación bancaria, mismos que son

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 4 / 29

CONSOLIDADO

Impresión Final

reconocidos en resultados conforme se devengan.

Las disponibilidades se reconocen a su valor nominal. En el caso de cuentas bancarias denominadas en dólares, el tipo de cambio utilizado para la conversión es el publicado por el Banco Central. El efecto de valorización y los intereses ganados se registran en resultados, como ingreso o gasto por intereses, según corresponda, conforme se devengan.

Las aportaciones adicionales o retiros efectuados por el Banco a la cuenta de margen en efectivo se reconocen también como otras disponibilidades.

Los documentos de cobro inmediato en firme, se reconocerán como otras disponibilidades de acuerdo a lo siguiente:

-Operaciones con entidades del país; dos días hábiles después de haberse efectuado la operación.

-Operaciones con entidades del extranjero; cinco días hábiles después de haber efectuado la operación.

Cuando los documentos mencionados anteriormente no sean cobrados en los plazos mencionados, el importe de éstos se traspasará a la partida que les dio origen según corresponda, "Otras cuentas por cobrar, neto" o "Cartera de crédito", y deberá atenderse a lo dispuesto en los criterios A-2 "Aplicación de normas particulares" y B-6 "Cartera de crédito", respectivamente.

Por las operaciones traspasadas a deudores diversos dentro del rubro de "Otras cuentas por cobrar" y que se mantengan como pendientes de cobro a los quince días naturales siguientes a la fecha de realizado el traspaso, se clasifican como adeudos vencidos y se constituye simultáneamente su estimación por el importe total de las mismas.

Los documentos recibidos salvo buen cobro se registran en cuentas de orden en el rubro de "Otras cuentas de registro".

Los sobregiros en cuentas de cheques reportados en el estado de cuenta emitido por la institución de crédito correspondiente, se presentan en el rubro de "Acreedores diversos y otras cuentas por pagar". Del mismo modo, el saldo compensado de divisas a recibir con las divisas a entregar, en caso de que esta compensación muestre saldo acreedor.

Los rendimientos que generan los depósitos en entidades financieras, las operaciones de préstamos interbancarios pactadas a un plazo menor o igual a 3 días hábiles, así como los efectos de valorización de aquellos constituidos en moneda extranjera, se presentarán en el estado de resultados consolidado, dentro del rubro de "Ingresos por intereses" o "Gastos por intereses", según corresponda.

Las divisas adquiridas que se pacte liquidar en operaciones de compraventa a 24, 48, 72 y 96 horas, se reconocen como una disponibilidad restringida (divisas a recibir); en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de disponibilidades (divisas a entregar). Los derechos y obligaciones originadas por las ventas y compras de divisas a 24, 48, 72 y 96 horas se registran en cuentas liquidadoras dentro del rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y "Acreedores por liquidación de operaciones", respectivamente.

(d) Cuentas de margen-

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Los activos financieros otorgados en efectivo requeridos al Banco con motivo de la celebración de operaciones con derivados realizados en mercados o bolsas reconocidos se reconocen a su valor nominal y se presentan en el rubro de "Cuentas de margen". El valor de la cuenta de margen otorgada en efectivo se modifica por las liquidaciones parciales o totales que la cámara de compensación deposita o retira y por las aportaciones adicionales o retiros efectuados por el Banco.

Los rendimientos y las comisiones que afectan a las cuentas de margen, distintos a las fluctuaciones en los precios de los derivados, se reconocen en los resultados del ejercicio conforme se devengan dentro de los rubros de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas pagadas", respectivamente. Las liquidaciones parciales o totales depositadas o retiradas por la cámara de compensación con motivo de las fluctuaciones en los precios de los derivados se reconocen dentro del rubro de "Cuentas de margen".

El fondo de compensación de los Fideicomisos MexDer es depositado en el Fideicomiso 30430 Asigna, Compensación y Liquidación (Asigna) de acuerdo con lo establecido en las reglas, de las disposiciones, el reglamento interno y el manual operativo de Asigna y está integrado por las aportaciones en efectivo que realizan los Fideicomisos MexDer en función de los contratos abiertos que mantengan registrados y de las aportaciones iniciales mínimas exigidas por Asigna. El fondo de compensación se reconoce como una disponibilidad restringida dentro del rubro de "Disponibilidades".

(e) Inversiones en valores-

Comprende acciones, valores gubernamentales, papel bancario y otros valores de deuda cotizados en mercados reconocidos, que se clasifican utilizando las categorías que se muestran a continuación, atendiendo a la intención y capacidad de la Administración del Banco sobre su tenencia al momento de adquirir determinado instrumento:

Títulos para negociar-

Son aquellos que se adquieren con la intención de enajenarlos obteniendo ganancias a corto plazo, derivadas de las diferencias en precios que resulten de su operación en el mercado. Los títulos al momento de su adquisición se reconocen a su valor razonable (el cual incluye, en su caso, el descuento o sobreprecio) y que presumiblemente corresponde al precio pagado; los costos de transacción por la adquisición de títulos se reconocen en resultados en esa misma fecha.

Posteriormente, y en cada fecha de reporte los títulos se valúan a valor razonable proporcionado por un proveedor de precios independiente; los efectos de valuación y los resultados por compraventa se reconocen en los resultados del ejercicio, dentro del rubro "Resultado por intermediación". Cuando los títulos son enajenados, el resultado por compraventa se determina del diferencial entre el precio de compra y el de venta, debiendo reclasificar el resultado por valuación que haya sido previamente reconocido en los resultados del ejercicio, al resultado por compra venta dentro de dicho rubro.

Los intereses devengados de los títulos de deuda se determinan conforme al método de interés efectivo y se reconocen en los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses".

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio neto a favor provenientes de inversiones en valores se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de "Ingresos por intereses".

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 6 / 29

CONSOLIDADO

Impresión Final

Títulos disponibles para la venta-

Son aquellos cuya intención no está orientada a obtener ganancias derivadas de las diferencias en precios en el corto plazo ni se tiene la intención o capacidad de mantenerlos hasta su vencimiento. El reconocimiento inicial y la valuación posterior se llevan a cabo de igual manera que los títulos para negociar, excepto que el efecto de valuación, se reconoce en el capital contable en el rubro de "Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta", el cual se ajusta por el efecto de impuestos diferidos. El efecto por valuación se cancela para reconocerlo en resultados al momento de la venta en el rubro de "Resultado por intermediación".

La valuación de los instrumentos de esta categoría designados como partida cubierta por derivados de cobertura a valor razonable, es reconocida en el rubro de "Resultado por intermediación".

Los intereses devengados se determinan conforme al método de interés efectivo y se reconocen en los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses".

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de "Ingresos por intereses".

Títulos conservados al vencimiento-

Son aquellos títulos de deuda, con pagos fijos o determinables y con vencimiento fijo, respecto a los cuales se tiene tanto la intención como la capacidad de conservarlos hasta su vencimiento. Los títulos se reconocen inicialmente a su valor razonable que es presumiblemente el precio pagado y posteriormente se valúan a su costo amortizado, lo cual implica que la amortización del premio o descuento, así como de los costos de transacción, forman parte de los intereses devengados que se reconocen en resultados dentro del rubro "Ingresos por intereses". Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan y una vez que se enajenan los títulos, se reconoce el resultado por compraventa por la diferencia entre el valor neto de realización y el valor en libros de los títulos, dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Deterioro del valor de un título-

Cuando se tiene evidencia objetiva de que un título disponible para la venta o conservado a vencimiento presenta un deterioro como resultado de uno o más eventos que ocurrieron posteriormente al reconocimiento inicial del título, el valor en libros del título se modifica y el monto del deterioro se reconoce en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Resultado por intermediación". Para los títulos disponibles para la venta, el monto de la pérdida reconocida en el capital contable se reclasifica a los resultados del ejercicio.

Si en un período posterior, el valor razonable del título se incrementa, y dicho efecto

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

está relacionado objetivamente con un evento que ocurra después de que el deterioro fue reconocido en los resultados del ejercicio, el deterioro se revierte en los resultados del ejercicio, excepto si se trata de un instrumento de patrimonio.

Al 31 de diciembre de 2020 y 2019, la Administración del Banco no ha identificado que exista evidencia objetiva del deterioro de algún título.

Operaciones fecha valor-

Los títulos adquiridos que se pacte liquidar en fecha posterior hasta un plazo máximo de cuatro días hábiles siguientes a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como títulos restringidos, en tanto que, los títulos vendidos se reconocen como títulos por entregar disminuyendo las inversiones en valores. La contrapartida deberá ser una cuenta liquidadora, acreedora o deudora, según corresponda. Cuando el monto de títulos por entregar excede el saldo de títulos en posición propia de la misma naturaleza (gubernamentales, bancarios, accionarios y otros títulos de deuda), se presenta en el pasivo dentro del rubro de "Valores asignados por liquidar".

Reclasificación entre categorías-

Los Criterios Contables permiten efectuar reclasificaciones de la categoría de títulos conservados al vencimiento hacia títulos disponibles para la venta, siempre y cuando no se tenga la intención o capacidad de mantenerlos hasta el vencimiento. El resultado por valuación correspondiente a la fecha de reclasificación se reconoce en el capital contable. En caso de reclasificaciones hacia la categoría de títulos conservados a vencimiento, o de títulos para negociar hacia disponibles para la venta, se podría efectuar únicamente con autorización expresa de la Comisión Bancaria. Asimismo, en caso de ventas de títulos conservados a vencimiento deberá informarse a la Comisión Bancaria. Durante los años terminados el 31 de diciembre de 2020 y 2019, el Banco no llevó a cabo transferencias entre categorías, ni ventas de títulos conservados a vencimiento.

(f) Préstamo de valores-

En la fecha de contratación de las operaciones de préstamo de valores actuando el Banco como prestamista, en lo que se refiere a los valores objeto del préstamo, se reclasifican como restringidos en el balance general consolidado dentro del rubro de "Inversiones en valores"; mientras que actuando como prestatario se reconocen en cuentas de orden en el rubro de "Colaterales recibidos por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes".

El importe del premio devengado actuando el Banco como prestamista o prestatario se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio, a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación en el rubro de "Ingresos por intereses" o "Gastos por intereses", respectivamente, contra el rubro de "Préstamo de valores" dentro del activo o pasivo, según corresponda.

En el caso de que el Banco, previo al vencimiento de la operación de préstamo de valores, venda el colateral recibido como prestamista o el valor objeto de la operación

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2020

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 8 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

como prestatario, reconoce la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como la obligación de restituir dicho colateral al prestatario o el valor objeto de la operación al prestamista dentro del rubro de "Colaterales vendidos o dados en garantía", dicha obligación es medida inicialmente al precio pactado y posteriormente se valúa a valor razonable, el efecto por valuación se presenta en resultados dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

La diferencia entre el precio recibido y el valor razonable del valor objeto de la operación o de los colaterales recibidos, que en su caso exista en el momento de vender, se presenta en el rubro de "Resultado por intermediación".

(g) Operaciones de reporto-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco actuando como reportada reconoce la entrada del efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar; mientras que actuando como reportadora reconoce la salida de disponibilidades o bien una cuenta liquidadora acreedora, así como una cuenta por cobrar. Tanto la cuenta por pagar como la cuenta por cobrar son medidas inicialmente al precio pactado, lo cual representa la obligación de restituir o el derecho a recuperar el efectivo, respectivamente.

A lo largo de la vigencia del reporto la cuenta por cobrar y por pagar se valúan a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devengue, de acuerdo al método de interés efectivo; dicho interés se reconoce dentro del rubro de "Ingresos por intereses" o "Gastos por intereses", según corresponda. La cuenta por cobrar y por pagar, así como los intereses devengados se presentan en el rubro de "Deudores por reporto" y "Acreedores por reporto", respectivamente.

El Banco actuando como reportadora reconoce el colateral recibido en cuentas de orden en el rubro "Colaterales recibidos por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes". Los activos financieros otorgados como colateral, actuando el Banco como reportada se reclasifican en el balance general consolidado dentro del rubro de "Inversiones en valores", presentándolos como restringidos.

En caso de que el Banco, actuando como reportadora venda el colateral o lo otorgue en garantía, reconoce los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral a la reportada, la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. Dicha cuenta por pagar se compensa con la cuenta por cobrar que es reconocida cuando el Banco actuando como reportadora se convierte a su vez en reportada y, se presenta el saldo deudor o acreedor en el rubro de "Deudores por reporto" o en el rubro de "Colaterales vendidos o dados en garantía", según corresponda.

Adicionalmente, el colateral recibido, entregado o vendido se reconoce en cuentas de orden dentro del rubro de "Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes".

(h) Derivados-

Las operaciones con instrumentos financieros derivados comprenden aquellas con fines de negociación y de cobertura; los derivados sin consideración de su intencionalidad se reconocen a valor razonable.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 9 / 29

CONSOLIDADO

Impresión Final

El efecto por valuación de los derivados con fines de negociación se presenta en el balance general consolidado y en el estado consolidado de resultados dentro de los rubros "Derivados", en el activo o pasivo, según corresponda, y "Resultado por intermediación", respectivamente. El efecto por el riesgo de crédito (contraparte) de los derivados, debe determinarse de acuerdo a la metodología del área de riesgos, y debe reconocerse en los resultados en el periodo en que ocurra contra la cuenta complementaria.

La porción efectiva del resultado por valuación de las coberturas designadas como de flujo de efectivo se reconoce en el capital contable dentro del rubro "Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo", en tanto que la porción inefectiva del cambio en el valor razonable se reconoce de manera inmediata en resultados dentro del rubro "Resultado por intermediación" y la contracuenta con dicho efecto se presenta en el balance general consolidado dentro del rubro de "Derivados". La ganancia o pérdida asociada a la cobertura de la transacción pronosticada que haya sido reconocida en el capital contable, se reclasifica al estado consolidado de resultados dentro del mismo rubro donde se presenta el resultado por valuación de la partida cubierta atribuible al riesgo cubierto, en el mismo periodo durante el cual los flujos de efectivo pronosticados cubiertos afecten los resultados del ejercicio.

En el caso de que el derivado de cobertura de flujo de efectivo expire, sea ejercido, terminado o la cobertura no cumpla con los requisitos para ser considerada como tal, se revoca la designación de cobertura a la vez que la valuación del derivado de cobertura de flujo de efectivo que se encuentra dentro de capital contable permanece en dicho rubro y se reconoce cuando la transacción pronosticada ocurre en los resultados dentro del mismo rubro donde se presenta el resultado por valuación atribuible al riesgo cubierto.

La ganancia o pérdida que resulte de valorar el derivado de cobertura de valor razonable se reconoce en el balance general consolidado en el rubro de "Derivados" y en el estado consolidado de resultados en los rubros de "Ingresos por intereses" y "Resultado por intermediación", dado que corresponden a coberturas de tasa de interés de cartera de crédito e inversiones en valores clasificadas como disponibles para la venta, respectivamente. El resultado por valuación de la partida atribuible al riesgo cubierto, se reconoce en el balance general consolidado en el rubro de "Ajustes de valuación por cobertura de activos financieros" y se reconoce en los resultados del ejercicio, tratándose de cartera de crédito, en el rubro de "Ingresos por intereses", mientras que por las inversiones en valores clasificadas como disponibles para la venta se reconocen dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

Derivados implícitos y estructurados

El Banco mantiene derivados implícitos que no se utilizan para cubrir posiciones, sino como estrategia de negociación; dichos derivados se encuentran relacionados a estructuras y/o notas emitidas bajo las siguientes características:

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que, por medio de swaps u opciones implícitas, se puede ofrecer un rendimiento garantizado y/o se mejora la tasa de rendimiento del cliente (ver nota 15).

El valor razonable del componente derivado se registra dentro de los rubros de "Derivados" y "Resultado por intermediación, neto". Los intereses devengados se reconocen en el rubro de "Gastos por intereses".

Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de derivados no realizadas en mercados

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

o bolsas reconocidos-

El colateral es una garantía constituida para asegurar el pago de las contraprestaciones pactadas en contratos con instrumentos financieros derivados en operaciones no realizadas en mercados o bolsas reconocidos.

El otorgamiento de colaterales entregados en efectivo en operaciones de derivados no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se registran como una cuenta por cobrar que se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que los colaterales recibidos en efectivo se registran en el rubro de "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en títulos se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

(i) Compensación de cuentas liquidadoras-

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reporto y/o de operaciones con derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados se registran en cuentas liquidadoras, incluyendo los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día.

Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y la intención de liquidar la cantidad neta, o de realizar el activo y cancelar el pasivo, simultáneamente.

Las cuentas liquidadoras se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" o "Acreedores por liquidación de operaciones", según corresponda.

(j) Cartera de crédito-

Representa el saldo de la disposición total o parcial de las líneas de crédito otorgadas a los acreditados más los intereses devengados no cobrados, menos los intereses cobrados por anticipado. La estimación preventiva para riesgos crediticios se presenta deduciendo los saldos de la cartera de crédito.

Las líneas de crédito no dispuestas se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios". El monto que es dispuesto por el acreditado se considerará dentro de la cartera de crédito conforme a la categoría de cartera que le corresponda.

Al momento de su contratación, las operaciones con cartas de crédito se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios", las cuales, al ser ejercidas por el cliente o por su contraparte se traspasan a la cartera de créditos.

Los créditos otorgados en garantía, se reconocen como créditos restringidos.

Cartera INFONAVIT-

La cartera en prórroga se integra por todos aquellos créditos a la vivienda originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT) adquiridos por las entidades, y que en términos de la Ley del INFONAVIT, cuenten con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios, al concluir la prórroga la cartera recibirá el tratamiento que le

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 11 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

corresponda de: Régimen Ordinario de Amortización (ROA) o Régimen Especial de Amortización (REA). Lo anterior, siempre y cuando la entidad esté contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos del organismo de referencia.

REA es la modalidad de pago de los créditos cuyos derechos fueron adquiridos por el Banco al INFONAVIT, prevista por las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del INFONAVIT" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

ROA es la modalidad de pago de los créditos cuyos derechos fueron adquiridos por el Banco al INFONAVIT, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

Créditos e intereses vencidos-

Los saldos insolutos de los créditos e intereses se clasifican como vencidos de acuerdo con los siguientes criterios:

1. Se tenga conocimiento de que el acreditado es declarado en concurso mercantil, conforme a la Ley de Concursos Mercantiles.

Se exceptúa de la regla anterior aquellos créditos que continúen recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles, así como los créditos otorgados al amparo del artículo 75 en relación con las fracciones II y III del artículo 224 de la citada Ley; sin embargo, cuando incurran en los supuestos previstos en el punto 2 siguiente, serán traspasados a cartera vencida.

2. Sus amortizaciones no hayan sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, considerando lo siguiente:

a) si los adeudos consisten en créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento y presentan 30 o más días naturales de vencidos;

b) si los adeudos se refieren a créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses y presentan 90 o más días naturales de vencido el pago de intereses respectivo, o bien 30 o más días naturales de vencido el principal;

c) si los adeudos consisten en créditos con pagos periódicos parciales de principal e intereses, incluyendo los créditos a la vivienda, presentan 90 o más días naturales de vencidos;

d) si los adeudos consisten en créditos revolventes y presentan dos periodos mensuales de facturación vencidos o, en caso de que el periodo de facturación sea distinto al mensual, cuando corresponda a 60 o más días naturales de vencidos, y

e) los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes que cuentan con línea de crédito, así como los documentos de cobro inmediato, al momento en el cual se presente dicho evento.

3. Para el caso de cartera en prórroga y créditos a la vivienda, cuando las amortizaciones no hayan sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presenten 90 o más días de vencidos:

a) los pagos correspondientes a los créditos que el Banco haya adquirido al INFONAVIT o el Fondo de la Vivienda del Instituto de Seguridad y Servicios Sociales de los

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 12 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Trabajadores del Estado (FOVISSSTE), conforme a la modalidad de pago correspondiente (REA o ROA), así como

b) los créditos otorgados a personas físicas destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial que estén respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado.

El traspaso al rubro de "Cartera de crédito vencida" de los créditos a que se refiere el numeral 3 del párrafo anterior se sujetará al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

- a) los recursos del crédito sean dispuestos para el fin con que fueron otorgados;
- b) el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o
- c) el Banco haya recibido el pago parcial de la amortización correspondiente. La excepción contenida en el presente inciso será aplicable siempre y cuando se trate de créditos bajo el esquema ROA, y cada uno de los pagos realizados durante dicho periodo representen, al menos, el 5% de la amortización pactada.

Las excepciones contenidas en los incisos a), b) y c) anteriores, no serán excluyentes entre sí.

Cuando un crédito es traspasado a cartera vencida, se suspende la acumulación de intereses devengados y se lleva el registro de los mismos en cuentas de orden. Asimismo, se suspende la amortización en resultados del ejercicio de los ingresos financieros devengados. Cuando dichos intereses son cobrados se reconocen directamente en resultados en el rubro de "Ingresos por intereses". El reconocimiento en resultados de los ingresos por intereses se reanuda cuando la cartera deja de considerarse como vencida.

Por los intereses devengados no cobrados correspondientes a créditos considerados como cartera vencida, se constituye una estimación por el equivalente al total de éstos al momento del traspaso del crédito como cartera vencida. Para los créditos vencidos en los que en su reestructuración se acuerde la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, se constituye una estimación por el total de dichos intereses. La estimación se cancela cuando se cuenta con evidencia de pago sostenido.

El traspaso de créditos de cartera vencida a vigente se realiza cuando los acreditados liquidan la totalidad de los saldos pendientes de pago (principal e intereses, entre otros), excepto los créditos reestructurados o renovados, que se traspasan a cartera vigente cuando éstos cumplen oportunamente con el pago sostenido.

Pago sostenido

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado presenta cumplimiento de pago sin retraso por el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito, o en caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 60 días naturales, el pago de una exhibición.

En los casos de los créditos que el Banco adquiriera al INFONAVIT, en los que esté obligada a respetar los términos que los organismos de referencia contrataron con los acreditados, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado haya cubierto sin retraso el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de una amortización en los créditos bajo el esquema de ROA y tres amortizaciones para

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 13 / 29
CONSOLIDADO
Impresión Final

los créditos bajo el esquema de REA.

En los créditos con pagos periódicos de principal e intereses cuyas amortizaciones sean menores o iguales a 60 días en los que se modifique la periodicidad del pago a periodos menores derivado de la aplicación de una reestructura, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado presenta cumplimiento de pago de amortizaciones equivalentes a tres amortizaciones consecutivas del esquema original del crédito.

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan la reclasificación al rubro de "Cartera de crédito vencida", para determinar las tres amortizaciones consecutivas requeridas para la existencia de pago sostenido, se deberá considerar el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalga al plazo más extenso.

Tratándose de créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, se considera que existe pago sostenido del crédito cuando, ocurra alguno de los siguientes supuestos:

a) el acreditado haya cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,

b) se hubiere cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días.

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados (amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito, o en caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 60 días naturales, el pago de una exhibición), distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido.

En cualquier caso, para que el Banco demuestre que existe pago sostenido, además de asegurarse que el acreditado cumpla con los lineamientos de pago sostenido indicados en los párrafos anteriores, debe tener a disposición de la Comisión Bancaria evidencia que justifique que el acreditado cuenta con capacidad de pago en el momento que se lleve a cabo la reestructura o renovación para responder a las nuevas condiciones del crédito. La evidencia mínima que deberá obtener lo que se señala a continuación:

- i. probabilidad de incumplimiento intrínseca al acreditado,
- ii. las garantías otorgadas al crédito reestructurado o renovado,
- iii. la prelación de pago frente a otros acreedores y,
- iv. la liquidez del acreditado ante la nueva estructura financiera del financiamiento.

Reestructuras y renovaciones

Un crédito se considera reestructurado cuando el acreditado solicita al Banco cualquiera de las siguientes situaciones:

1) Ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate, o bien,

2) Modificaciones a las condiciones originales del crédito o al esquema de pagos, entre las que se encuentran:

a) Cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 29

CONSOLIDADO

Impresión Final

b) Cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, VSM o UDI);

c) Concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito, excepto por los que forman parte de los programas de apoyo COVID, o

d) Prórroga del plazo del crédito.

Los créditos vencidos que se reestructuren o se renueven permanecerán dentro de la cartera vencida, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento que se reestructuren durante el plazo del crédito o se renueven en cualquier momento serán considerados como cartera vencida en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos vigentes que se reestructuren o se renueven, sin que haya transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se considerará que continúan siendo vigentes, únicamente cuando el acreditado hubiere:

- i) cubierto la totalidad de los intereses devengados, y
- ii) cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto.

Los créditos vigentes que se reestructuren o renueven durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, se considerarán vigentes únicamente cuando el acreditado hubiere:

- i) liquidado la totalidad de los intereses devengados;
- ii) cubierto la totalidad del monto original del crédito que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto, y
- iii) cubierto el 60% del monto original del crédito.

En caso de no cumplirse todas las condiciones descritas anteriormente serán considerados como vencidos desde el momento en que se reestructuren o renueven y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Aquellos créditos catalogados como revolventes, que se reestructuren o renueven, en cualquier momento se considerarán vigentes únicamente cuando el acreditado hubiere liquidado la totalidad de los intereses devengados, el crédito no presente periodos de facturación vencidos y se cuente con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor.

No se considerarán como tales a aquéllas que a la fecha de la reestructura presenten cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las siguientes condiciones originales del crédito:

- i) Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.
- ii) Tasa de interés: cuando se mejore la tasa de interés pactada.
- iii) Moneda: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda.
- iv) Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago deberá permitir la omisión de pago en periodo alguno.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 15 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Las reestructuras o renovaciones de créditos de cartera se efectúan en apego a lo establecido en las "Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito" y la viabilidad de las mismas es analizada de forma particular.

El Banco evalúa periódicamente si un crédito vencido debe permanecer en el balance general consolidado, o bien, ser castigado, siempre y cuando estén provisionados al 100%. Dicho castigo se realiza cancelando el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios creada con anterioridad para cada crédito. Cualquier recuperación derivada de créditos previamente castigados o eliminados, deberá reconocerse en los resultados del ejercicio.

Las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos, es decir, el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total, se registran con cargo a la estimación preventiva para riesgos crediticios. En caso de que el importe de éstas exceda el saldo de la estimación asociada al crédito, previamente se constituyen estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

Comisiones

Las comisiones cobradas por el otorgamiento del crédito se registrarán como un crédito diferido, el cual se amortizará contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses, bajo el método de línea recta durante la vida del crédito, excepto las que se originen por créditos revolventes que deberán ser amortizadas por un periodo de 12 meses.

Tratándose de las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos, estas deberán adicionarse a las comisiones que se hubieran originado conforme al párrafo anterior reconociéndose como un crédito diferido, el cual se amortizará contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses, bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito.

No entrarán en esta categoría las comisiones que se reconozcan con posterioridad al otorgamiento del crédito, aquellas que se generen como parte del mantenimiento de dichos créditos, ni las que se cobren con motivo de créditos que no hayan sido colocados. En el caso de comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito, ya sea la primera anualidad o subsecuentes por concepto de renovación, se reconocerán como un crédito diferido y serán amortizadas en un periodo de 12 meses contra los resultados del ejercicio en el citado rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Las comisiones cobradas que se originen por el otorgamiento de una línea de crédito que no haya sido dispuesta, en ese momento se reconocerán como un crédito diferido, el cual se amortizará contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta por un periodo de 12 meses. En el caso de que la línea de crédito se cancele antes de que concluya el periodo de 12 meses, el saldo pendiente por amortizar deberá reconocerse directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de comisiones y tarifas cobradas, en la fecha en que ocurra la cancelación de la línea.

Las comisiones y tarifas distintas a las cobradas por el otorgamiento del crédito, se reconocerán contra los resultados de ejercicio en el rubro de comisiones y tarifas cobradas, en la fecha en que se devenguen. En el caso de que una parte o la totalidad de la contraprestación recibida por el cobro de la comisión o tarifa correspondiente se reciban anticipadamente al devengamiento del ingreso relativo, dicho anticipo deberá reconocerse como un pasivo.

Costos y gastos relacionados al otorgamiento inicial del crédito

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 16 / 29

CONSOLIDADO

Impresión Final

Los costos y gastos relacionados con el otorgamiento del crédito se reconocen como un cargo diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses", durante el plazo promedio de la vida de los créditos, excepto para las que se originen por créditos revolventes, las cuales son amortizadas en un periodo de 12 meses contra el rubro del gasto que le corresponda de acuerdo a su naturaleza.

Para efectos del párrafo anterior, se entenderán como costos o gastos asociados con el otorgamiento del crédito, únicamente a aquellos que sean incrementales y relacionados directamente con actividades realizadas por las entidades para otorgar el crédito, por ejemplo la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades.

Adquisición de cartera de crédito

En la fecha de adquisición de la cartera se deberá reconocer el valor contractual de la cartera adquirida en el rubro de cartera de crédito, conforme al tipo de cartera que el originador hubiere clasificado; la diferencia que se origine respecto del precio de adquisición se registrará como se muestran en la siguiente hoja.

a) cuando el precio de adquisición sea menor al valor contractual de la misma, en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", hasta por el importe de la estimación preventiva para riesgos crediticios que, en su caso, se constituya conforme a lo indicado en el párrafo siguiente y el excedente como un crédito diferido, el cual se amortizará conforme se realicen los cobros respectivos, de acuerdo a la proporción que estos representen del valor contractual del crédito;

b) cuando el precio de adquisición de la cartera sea mayor a su valor contractual, como un cargo diferido el cual se amortizará conforme se realicen los cobros respectivos, de acuerdo a la proporción que estos representen del valor contractual del crédito;

c) cuando provenga de la adquisición de créditos revolventes, se llevará dicha diferencia directamente a los resultados del ejercicio en la fecha de adquisición.

Criterios Contables Especiales (CCE), derivado de la contingencia sanitaria por COVID-19

Mediante oficios número P-285/2020 y 026/2020 de fecha 26 de marzo y 15 de abril de 2020, respectivamente, la Comisión Bancaria determinó emitir con carácter temporal, los CCE aplicables a los programas de apoyo otorgados por el Banco. Posteriormente, mediante oficio número P-325/2020 de fecha 23 de junio de 2020, la Comisión Bancaria indicó lo siguiente:

- Los CCE serán aplicados de manera general a los clientes que se hayan visto afectados y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo 2020.
- El plazo para realizar los trámites de reestructuración o renovación deberán concluir a más tardar el 31 de julio de 2020.

Los programas de apoyo consisten en otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 4 meses y con posibilidad de extenderlo a 2 meses adicionales, otorgando un periodo de gracia total hasta de 6 meses. Será de 18 meses tratándose de créditos otorgados a los sectores primarios

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

agrícola, ganadero, forestal y pesquero; y a los sectores industrial, comercial y servicios que estén integrados los citados sectores primarios.

Lo anterior será aplicable a los siguientes tipos de crédito y para clientes que se encuentren clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo de 2020:

- a. Créditos para la construcción de vivienda.
- b. Créditos individuales con garantía hipotecaria.
- c. Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).
- d. Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial.
- e. Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.
- f. Microcréditos individuales o grupales.

Para los CCE no se consideran como reestructuras y/o renovaciones y serán consideradas como cartera vigente los siguientes:

1. Créditos con "pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento", que sean reestructurados o renovados, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 79 del Criterio Contable B-6 "Cartera de Crédito" (el "Criterio Contable B-6") contenido en el Anexo 33 de la Circular única de Bancos, siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

2. Para créditos con "pagos periódicos de principal e intereses", que se reestructuren o renueven, podrán considerarse como vigentes al momento en que se lleve a cabo dicho acto, sin que sea aplicable lo que establecen los párrafos 82 y 84 del Criterio Contable B-6, siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

3. Los créditos que desde su inicio se estipule su carácter revolvente, que se reestructuren o renueven, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 80 y 81 del Criterio Contable B-6. Esto siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

En relación con los créditos citados en los numerales anteriores, estos no se considerarán como reestructurados conforme lo que establece el párrafo 40 del Criterio Contable B-6.

4. En caso de incluir quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, el Banco podrá diferir la constitución de Estimaciones Preventivas de Riesgos Crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una reserva por la diferencia en un período que no exceda el ejercicio de 2020.

Mediante oficio número 141-5/2263/2020 de fecha 2 de septiembre de 2020, la Comisión Bancaria extendió el plazo hasta el 30 de septiembre de 2020 para que el Banco pudiera aplicar los planes de reestructura o renovación para aquellos clientes ya inscritos en el programa de apoyo al 31 de julio de 2020, y que requieren dos meses adicionales de diferimiento para que de esta forma cuenten con los 6 meses de diferimiento al amparo de los CCE, establecidos en los oficios de fechas 26 de marzo, 15 de abril y 23 de junio de 2020.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 18 / 29

CONSOLIDADO

Impresión Final

(k) Estimación preventiva para riesgos crediticios-

Se mantiene una estimación para riesgos crediticios, la cual, a juicio de la administración del Banco, es suficiente para cubrir cualquier pérdida que pudiera surgir tanto de los préstamos incluidos en su cartera de créditos, como otros riesgos crediticios de avales y compromisos irrevocables de conceder préstamos.

Cartera comercial - Las estimaciones para la cartera comercial se basan en la evaluación individual del riesgo crediticio de los acreditados y su clasificación, en apego a las "Disposiciones de carácter general aplicables a la metodología de calificación de la cartera crediticia de las instituciones de crédito" (las "Disposiciones"), establecidas por la Comisión Bancaria. La cartera crediticia estará sujeta a calificación, sin incluir aquellos créditos con garantía otorgada por Entidades de la Administración Pública Federal bajo control presupuestario directo, empresas productivas del Estado o aquellas señaladas en la fracción VI del artículo 112 de las Disposiciones, en los cuales el porcentaje de reserva será igual a 0.5%.

Las Disposiciones utilizan una metodología en la cual se clasifica a la cartera en diferentes grupos: en entidades federativas y municipios, proyectos de inversión con fuente de pago propia, fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, entidades financieras y personas morales y físicas con actividad empresarial no incluidas en los grupos anteriores, a su vez, este último grupo deberá dividirse en dos subgrupos: personas morales y físicas con actividad empresarial con ingresos o ventas netas anuales mayores a 14 millones de UDIS y menores a 14 millones de UDIS. Para efectos de la calificación de proyectos con fuente de pago propia establece que la calificación se calculará mediante al análisis del riesgo del proyecto de inversión de acuerdo a su etapa de construcción u operación y mediante el sobrecosto de obra y los flujos de efectivo del proyecto. Para los demás grupos se establece una metodología de pérdida esperada por riesgo de crédito, considerando la probabilidad de incumplimiento, severidad de la pérdida y exposición al incumplimiento.

Para la cartera de crédito con personas morales y físicas con actividad empresarial, con ingresos o ventas netas anuales iguales o mayores a 14 millones de UDIS, el Banco utiliza la metodología descrita en el Anexo 22 de las Disposiciones de la Comisión Bancaria.

La cartera de crédito con personas morales y físicas con actividad empresarial, con ingresos o ventas netas anuales menores a 14 millones de UDIS es calificada mediante la aplicación de la metodología descrita en el Anexo 21 de las Disposiciones, y para el caso de créditos con entidades financieras se utiliza la metodología descrita en el Anexo 20 de las mismas, en donde establece el concepto de probabilidad de incumplimiento, severidad de la pérdida y exposición al incumplimiento.

Las estimaciones realizadas al 31 de diciembre de 2020 y 2019 se determinaron conforme al grado de riesgo y los porcentajes de estimación preventiva siguientes:

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

A10.0000.90%
A20.9011.50%
B11.5012.00%
B22.0012.50%
B32.5015.00%
C15.00110.00%

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 19 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

C210.00115.50%
D15.50145.00%
EMayor a 45.00%

Cartera hipotecaria incluyendo la originada y adquirida al INFONAVIT-

La reserva para créditos a la vivienda, se determina utilizando los saldos correspondientes al último día de cada mes. Asimismo, se consideran factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) días de atraso, vi) denominación del crédito e vii) integración del expediente. Adicionalmente, para los créditos adquiridos al INFONAVIT se consideran factores tales como: viii) ROA, ix) REA y x) prórroga. El monto total a constituir de cada crédito evaluado, es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento.

Para la determinación de la severidad de la pérdida es utilizado el componente de tasa de recuperación del crédito, la cual se ve afectada si el crédito cuenta con un fideicomiso de garantía o convenio judicial clasificando por regiones a las entidades federativas a las que pertenezcan dichos tribunales.

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2020 y 2019, se muestran a continuación:

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

A10.0000.50%
A20.5010.75%
B10.7511.00%
B21.0011.50%
B31.5012.00%
C12.0015.00%
C25.00110.00%
D10.00140.00%
E40.001100.00%

Cartera de consumo-

Para determinar la reserva de la cartera de consumo, ésta es separada en dos grupos: a) tarjeta de crédito (a partir del 1 de octubre de 2019) y otros créditos revolventes, y b) créditos no revolventes descritas en los Artículos 91 y 92 de las Disposiciones. Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, así como viii) antigüedad del acreditado en el Banco.

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a créditos no revolventes considera lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) días de atraso, (iv) plazo total, (v) plazo remanente, (vi) importe original del crédito, (vii) valor original del bien, (viii) el saldo del crédito y (ix) tipo de crédito.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 20 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2020 y 2019, se muestran a continuación:

Rango de porcentaje de estimación preventiva

Tarjeta de crédito

y otros créditos

Grado de riesgo No revolventes / revolventes

A10.002.0% / 0.003.00%

A22.013.0% / 3.015.00%

B13.014.0% / 5.016.50%

B24.015.0% / 6.518.00%

B35.016.0% / 8.0110.00%

C16.018.0% / 10.0115.00%

C28.0115.0% / 15.0135.00%

D15.0135.0% / 35.0175.00%

E35.01100.0% / Mayores a 75.01%

Cartera emproblemada - El Banco para propósitos de las revelaciones en los estados financieros consolidados, considera emproblemados aquellos créditos comerciales respecto de los cuales determina que existe una probabilidad considerable de que no se podrían recuperar en su totalidad, sin excluir las mejoras en los grados de riesgo derivadas de la parte del crédito cubierto por garantías, así como créditos que aún y cuando se encuentren vigentes provengan de una negociación en la cual se autorizó una condonación, quita o bonificación al final del plazo pactado, o son a cargo de personas a las cuales se les ha clasificado como clientela indeseable.

Reservas adicionales identificadas - Son establecidas para aquellos créditos que, en la opinión de la administración, podrían verse emproblemados en el futuro dada la situación del cliente, la industria o la economía. Además, incluye estimaciones para partidas como intereses ordinarios devengados no cobrados y otras partidas cuya realización se estima podrían resultar en una pérdida para el Banco, así como reservas mantenidas por regulación normativa.

Castigos- El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo a plazos establecidos (6 y 35 meses, respectivamente) que determinan la imposibilidad práctica de recuperación; los castigos cancelan el saldo del crédito contra la estimación preventiva previamente constituida. Cuando el crédito a castigar excede el saldo de su estimación asociada, antes de efectuar el castigo, dicha estimación se incrementa hasta por el monto de la diferencia. Cualquier recuperación derivada de los créditos previamente castigados, se reconoce en los resultados del ejercicio dentro del rubro de estimación preventiva para riesgos crediticios.

(l) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

Con base al párrafo 3 del criterio A-4 "Aplicación Supletoria a los Criterios de Contabilidad" emitido por la Comisión, el Banco había adoptado la NIIF 15 "Ingresos provenientes de contratos con clientes" el cual incorpora el reconocimiento de ingresos derivados de programas de fidelización con clientes, y por lo tanto la IFRIC 13 "Programa de fidelidad de clientes" queda sin efecto. De acuerdo con la NIIF 15, una porción de los ingresos por cuota de intercambio se difiere en el momento en que se identifican las obligaciones de cumplir, es decir, de entregar los premios a los que los clientes tienen derecho y se amortizan contra resultados una vez que se satisface dicha obligación de cumplir.

(m) Otras cuentas por cobrar-

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 21 / 29

CONSOLIDADO

Impresión Final

Los derechos de cobro y las cuentas por cobrar relativas a deudores identificados cuyo vencimiento se pacte desde su origen a un plazo mayor a 90 días naturales, son evaluados por la Administración del Banco para determinar su valor de recuperación estimado, y en su caso constituir las reservas correspondientes. Los saldos de las demás partidas deudoras se reservan con cargo a los resultados del ejercicio a los 90 días siguientes a su registro inicial cuando correspondan a saldos identificados y a los 60 días si corresponden a saldos no identificados, independientemente de su posibilidad de recuperación, con excepción de los relativos a saldos por recuperar de impuestos e impuesto al valor agregado acreditable.

Tratándose de cuentas liquidadoras, en los casos en que el monto por cobrar no se realice a los 90 días naturales siguientes a partir de la fecha en que se haya registrado en cuentas liquidadoras, se registra como adeudo vencido y se constituye una estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro por el importe total del mismo.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes, que no cuenten con una línea de crédito para tales efectos, se clasificarán como adeudos vencidos y las instituciones deberán constituir simultáneamente a dicha clasificación una estimación por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

(n) Bienes adjudicados o recibidos como dación en pago-

Los bienes adquiridos mediante adjudicación judicial se registran en la fecha en que cause ejecutoria el auto aprobatorio del remate mediante el cual se decretó la adjudicación.

Los bienes recibidos en dación en pago se registran en la fecha en que se firmó la escritura de dación, o en la que se haya dado formalidad a la transmisión de la propiedad del bien.

El reconocimiento contable de un bien adjudicado considera el valor del bien (costo o valor razonable deducido de los costos y gastos estrictamente indispensables que se eroguen en su adjudicación, el que sea menor) así como el valor neto del activo que da origen a la adjudicación. Cuando el valor neto del activo que dio origen a la adjudicación es superior al valor del bien adjudicado, la pérdida se reconoce en los resultados del ejercicio, en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto"; en caso contrario, el valor del bien adjudicado se ajusta al valor neto del activo.

El valor del activo que dio origen a la misma y la estimación preventiva que se tenga constituida a esa fecha, se dan de baja del balance general consolidado.

Los bienes adjudicados prometidos en venta se reconocen como restringidos a valor en libros, los cobros que se reciben a cuenta del bien se registran como un pasivo; en la fecha de enajenación se reconoce en resultados la utilidad o pérdida generada dentro del rubro "Otros ingresos de la operación, neto".

Los bienes adjudicados se valúan de acuerdo al tipo de bien de que se trate, registrando dicha valuación (bajas de valor) contra resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El Banco constituye provisiones adicionales que reconocen los indicios de deterioro por las potenciales pérdidas de valor por el paso del tiempo en los bienes adjudicados, contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", las cuales se determinan multiplicando el porcentaje de reserva que corresponda por el valor de los bienes adjudicados, con base en las disposiciones por tenencia de bienes adjudicados o recibidos en dación de pago de la Comisión Bancaria, conforme se muestra a continuación:

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 29
CONSOLIDADO
Impresión Final

Porcentaje de reserva
Bienes muebles,
Meses transcurridos a partir de laderechos de cobro e
adjudicación o dación en pagoBienes inmueblesinversiones en valores

Hasta 6 0%0%
Más de 6 y hasta 120%10%
Más de 12 y hasta 1810%20%
Más de 18 y hasta 2410%45%
Más de 24 y hasta 3015%60%
Más de 30 y hasta 3625%100%
Más de 36 y hasta 4230%100%
Más de 42 y hasta 4835%100%
Más de 48 y hasta 5440%100%
Más de 54 y hasta 6050%100%
Más de 60 100%100%

(o) Inmuebles, mobiliario y equipo-

Los inmuebles, mobiliario y equipo son registrados a su costo de adquisición. Los saldos que provienen de adquisiciones realizadas hasta el 31 de diciembre 2007, se actualizaron mediante factores derivados del valor de la UDI de su fecha de adquisición hasta esa fecha, que fue cuando se suspendió el reconocimiento de la inflación en la información financiera de acuerdo a las NIF. Los componentes adquiridos en moneda extranjera se registran al tipo de cambio histórico, es decir, a aquellos vigentes en la fecha de adquisición del bien.

La depreciación se calcula usando el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del Banco de los activos correspondientes.

El monto a depreciar de los inmuebles, mobiliario y equipo se determina después de deducir a su costo de adquisición su valor residual y, en su caso menos las pérdidas por deterioro acumuladas. El Banco evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichos inmuebles, mobiliario y equipo.

El Banco evalúa periódicamente los valores netos en libros de los inmuebles, mobiliario y equipo, para determinar la existencia de indicios de que dichos valores exceden su monto recuperable. El monto recuperable es aquel que resulte mayor entre el precio neto de venta y el valor de uso. Si se determina que los valores netos en libros exceden su monto recuperable, el Banco reconoce el deterioro con cargo a los resultados del ejercicio para reducirlos a este último monto. Los gastos de mantenimiento y reparaciones menores se registran en los resultados cuando se incurren.

(p) Activos de larga duración disponibles para su venta-

Los activos de larga duración se clasifican como disponibles para su venta si cumplen todos los requisitos que se muestran a continuación:

- a) El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.
- b) Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.
- c) Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2020

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 23 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.

d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que el Banco celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del periodo de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control del Banco y existen evidencias suficientes de que el Banco se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.

e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.

f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores, se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

(q) Inversiones permanentes-

Las inversiones permanentes en donde no se tiene el control, control conjunto, ni influencia significativa son clasificadas como otras inversiones, las cuales se reconocen inicialmente y se mantienen valuadas a su costo de adquisición. En caso de que haya dividendos provenientes de dichas inversiones se reconocen en resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de periodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

(r) Otros activos-

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la administración del Banco.

Ante la presencia de algún indicio de deterioro del valor de un activo, se determina la posible pérdida por deterioro, y en caso de que el valor de recuperación sea menor al valor neto en libros se reduce el valor del activo y se reconoce la pérdida por deterioro en los resultados del ejercicio.

(s) Impuestos a la utilidad-

Los impuestos a la utilidad causados en el año se determinan conforme a las disposiciones fiscales vigentes.

El impuesto causado se presenta dentro del balance general consolidado como un pasivo; cuando los anticipos realizados exceden el impuesto determinado del ejercicio, el exceso generado constituye una cuenta por cobrar.

Los impuestos a la utilidad diferidos se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2020

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 24 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

impuestos a la utilidad (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas y por pérdidas fiscales por amortizar. Los activos y pasivos por impuestos a la utilidad se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas fiscales sobre los impuestos a la utilidad se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por impuesto a la utilidad diferido se evalúa periódicamente creando, en su caso, reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los "Otros Resultados Integrales" (ORI) o directamente en un rubro del capital contable.

(t)Arrendamientos capitalizables-

Las operaciones de arrendamiento capitalizable se registran como un activo y una obligación correlativa por el equivalente al valor menor entre el valor presente de los pagos mínimos y el valor de mercado del activo arrendado. La diferencia entre el valor nominal de los pagos mínimos y la obligación mencionada anteriormente, se registra durante el periodo de arrendamiento en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El activo se deprecia de la misma manera que los otros activos que se tienen en propiedad cuando se tiene la certeza de que al término del contrato se transferirá la propiedad del activo arrendado, caso contrario se deprecia durante la duración del contrato.

(u)Captación tradicional-

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del público en general, los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses". Por aquellos títulos colocados a un precio diferente al valor nominal, la diferencia entre el valor nominal del título y el monto de efectivo recibido por el mismo, se reconoce como un cargo o crédito diferido y se amortiza bajo el método de línea recta contra resultados durante el plazo del título que le dio origen.

Los depósitos e inversiones y sus intereses de los instrumentos de captación que no tengan una fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven de forma automática, así como las transacciones o las inversiones vencidas y no reclamadas se registraran en el rubro de "Cuenta global de captación sin movimientos". Los depósitos e inversiones y sus intereses sin movimiento en el transcurso de 3 años contados a partir de que estos últimos se depositen en la cuenta global, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública. El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto en este.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT
INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 29

CONSOLIDADO

Impresión Final

(v) Provisiones-

El Banco reconoce con base en estimaciones de la administración, provisiones por aquellas obligaciones presentes en las que es probable la transferencia de activos o la prestación de servicios y surge como consecuencia de eventos pasados.

(w) Préstamos interbancarios y de otros organismos-

En este rubro se registran los préstamos de exigibilidad inmediata, de corto plazo y de largo plazo de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento; asimismo, este rubro incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

(x) Beneficios a los empleados-

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que se devengan los servicios prestados, se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

Plan de contribución definida

El Banco tiene reconocido un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocían directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción" (nota 17).

Plan de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos, se realiza anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 26 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el período, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del período.

Las remediciones generadas resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable y posteriormente se recicla a los resultados del período, tomando como base la vida laboral remanente promedio del personal jubilado.

(y) Obligaciones subordinadas-

Las obligaciones subordinadas se reconocen a su valor contractual y los intereses se reconocen conforme se devengan en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Gastos por intereses".

(z) Reconocimiento de ingresos-

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan. Los intereses sobre cartera de crédito vencida, se reconocen en resultados hasta el momento en que efectivamente se cobran.

Los cobros anticipados por concepto de intereses y las comisiones por originación del crédito se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas cobradas" respectivamente, conforme se devenguen o en el plazo del crédito, según aplique.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes, así como comisiones por servicios relacionados a operaciones derivadas se reconocen en los resultados cuando se proporciona el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

Las comisiones por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devenga el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas". En el momento en que el adeudo de dichas comisiones presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, se suspende la acumulación de dichos ingresos devengados y se lleva el control de éstos en cuentas de orden; en caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

Las comisiones por reestructuraciones o renovaciones de créditos se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses", bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito.

(aa) Transacciones en moneda extranjera-

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 27 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio para solventar obligaciones denominadas en moneda extranjera pagaderas en la República Mexicana, determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio FIX publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el periodo en que se originan.

(ab) Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)-

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que es un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regular los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo.

De acuerdo a dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400 mil UDIS por persona, física o moral, y por institución bancaria. Las aportaciones al IPAB se reconocen en resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción".

(ac) Cuentas de orden-

Las cuentas de orden corresponden principalmente a los bienes en custodia o de administración y operaciones de fideicomisos.

Los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración, se reconocen en las cuentas de orden respectivas de acuerdo con los Criterios Contables establecidos por la Comisión Bancaria, representando así el monto máximo esperado por el que estaría obligado el Banco a responder ante sus clientes.

Los montos de los bienes en custodia o en administración se presentan en el rubro "Bienes en custodia o en administración", en tanto que las operaciones de fideicomiso se presentan en el rubro de "Bienes en fideicomiso o mandato".

(ad) Contingencias-

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos, utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

(4) Cambios contables-

NIF aplicables en 2020:

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 28 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NIF B-11 "Disposición de activos de larga duración y operaciones discontinuadas"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2020, no permitiendo su aplicación anticipada, dado que es necesario aplicarla junto con la NIF C-15 que se reemitirá durante 2019 y también será aplicable a partir del 2020. La aplicación por primera vez de esta NIF no genera cambios contables en los estados financieros.

Venta de créditos de cartera hipotecaria

El 31 de enero de 2020, el Banco vendió un portafolio de préstamos hipotecarios totalmente castigados a una compañía no relacionada con valor nominal de \$181, el ingreso recibido y utilidad en libros de dicho portafolio fue de \$38. El resultado por esta operación fue registrado como recuperaciones en el estado de resultados dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios".

Criterios Contables Especiales emitidos por la Comisión Bancaria, derivado de la contingencia sanitaria por COVID-19

Como se describe en las políticas contables de cartera de crédito, derivado de la contingencia sanitaria ocasionada por COVID-19 y el impacto negativo en la economía, el 26 de marzo de 2020 la Comisión Bancaria emitió de forma temporal Criterios Contables especiales para las instituciones de crédito respecto de la cartera crediticia de consumo, vivienda y comercial, para los clientes que hayan sido afectados y que estuvieran clasificados como vigentes al 31 de marzo de 2020 (con excepción de aquellos otorgados a personas relacionadas según lo previsto en los artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley de Instituciones de Crédito). En relación con dichos Criterios Contables especiales, el Banco aplicó los Criterios Contables especiales mencionados en las políticas contables.

El detalle por tipo de cartera de los importes que se hubieran registrado y presentado en el balance general consolidado y en el estado consolidado de resultados al 31 de diciembre de 2020, de no haber aplicado los Criterios Contables especiales se presenta en la hoja siguiente.

Concepto Saldos con apoyo COVID Efectos de apoyo COVID Saldo sin apoyo COVID

Balance general

Cartera de crédito vigente:

Créditos comerciales \$217,299 (26) 217,273

Créditos consumo 39,036 402 39,438

Créditos vivienda 146,210 (2,803) 143,407

402,545 (2,427) 400,118

Cartera de crédito vencida:

Créditos comerciales 4,852 264,878

Créditos consumo 2,526 (484) 2,042

Créditos vivienda 5,283 2,632 7,915

12,661 2,174 14,835

Total cartera de crédito 415,206 (253) 414,953

Menos

Estimación preventiva para riesgos crediticios

Créditos comerciales 5,719 275,746

Créditos consumo 4,837 820 5,657

Créditos vivienda 2,217 1,612 3,829

Operaciones contingentes y avales 227-227

Estimación preventiva para riesgos crediticios 13,000 2,459 15,459

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2020**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 29 / 29

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

| | |
|---|---------------------|
| Estimación preventiva para riesgos crediticios adicional | |
| 4,063 | |
| (3,750) | |
| 313 | |
| 17,063(1,291)15,772 | |
| Cartera de crédito (neta)\$ | 398,1431,038399,181 |
| Cuentas de orden | |
| Intereses devengados no cobrados derivados | |
| de cartera de crédito vencida\$ | 644234878 |
| Estado de resultados | |
| Ingresos por intereses de cartera de crédito: | |
| Créditos comerciales\$ | 16,702-16,702 |
| Créditos consumo8,784(62)8,722 | |
| Créditos vivienda14,552(172)14,380 | |
| Total de ingresos por intereses de cartera\$ | 40,038(234)39,804 |
| Estimación preventiva para riesgos crediticios | |
| Créditos comerciales\$ | 1,061271,088 |
| Créditos consumo4,1218394,960 | |
| Créditos vivienda1,1691,6122,781 | |
| Operaciones contingentes y avales(3)-(3) | |
| Estimación preventiva para riesgos crediticios6,3482,4788,826 | |
| Estimación preventiva para riesgos crediticios adicional | |
| 3,816 | |
| (3,750) | |
| 66 | |
| Total estimación preventiva para riesgos crediticios | |
| \$ | 10,164 |
| (1,272) | |
| 8,892 | |

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF