

# Scotiabank Inverlat

# Información Financiera

## SCOTIABANK INVERLAT

### Indicadores Financieros

Scotiabank-Indicadores Financieros	T1 2023	T2 2023	T3 2023	T4 2023
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	15.9%	13.2%	14.8%	14.2%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	1.6%	1.3%	1.5%	1.4%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.7%	3.4%	3.3%	3.1%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.3%	2.2%	2.1%	2.2%
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	3.8%	4.0%	4.0%	3.3%
Índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)	87.8%	82.2%	79.8%	77.4%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	21.01%	21.94%	22.60%	21.47%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	16.12%	16.59%	17.07%	15.99%
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	44.0%	50.6%	49.0%	47.2%

La utilidad neta al cierre del cuarto trimestre alcanza \$2,828 millones, un incremento de \$908 millones o 47% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por menores requerimientos de reservas crediticias. Por otro lado, respecto al trimestre anterior se mostró una disminución de \$108 millones o 4%, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias y menores ingresos no financieros; compensados parcialmente por un incremento de 7% en margen financiero y menores impuestos a la utilidad.

La utilidad neta acumulada al cierre de diciembre 2023 se ubicó en \$11,279 millones; un incremento de \$177 millones o 2% respecto al mismo periodo del año pasado. En el periodo, el PTPP creció 10%, impulsado por un crecimiento del 7% en los ingresos totales y una gestión eficiente del gasto.

	3 meses				12 meses		
<b>Scotiabank- Información Financiera (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%	31 dic 2022	31 dic 2023	A/A Δ%
Ingresos por intereses	16,950	19,984	21,215	25%	57,270	79,209	38%
Gastos por intereses	(10,211)	(13,250)	(14,035)	37%	(31,711)	(52,136)	64%
<b>Margen Financiero</b>	<b>6,739</b>	<b>6,734</b>	<b>7,180</b>	<b>7%</b>	<b>25,559</b>	<b>27,073</b>	<b>6%</b>
Comisiones	1,197	1,044	1,210	1%	4,392	4,477	2%
Resultado por Intermediación	333	430	312	-6%	1,548	1,865	20%
Otros ingresos/egresos de la operación	274	273	115	-58%	676	878	30%
<b>Ingresos no Financieros</b>	<b>1,804</b>	<b>1,747</b>	<b>1,637</b>	<b>-9%</b>	<b>6,616</b>	<b>7,220</b>	<b>9%</b>
<b>Total Ingresos</b>	<b>8,543</b>	<b>8,481</b>	<b>8,817</b>	<b>3%</b>	<b>32,175</b>	<b>34,293</b>	<b>7%</b>
Gastos de Administración y Promoción	(4,310)	(4,096)	(4,510)	5%	(16,704)	(17,320)	4%
<b>PTPP <sup>1)</sup></b>	<b>4,233</b>	<b>4,385</b>	<b>4,307</b>	<b>2%</b>	<b>15,471</b>	<b>16,973</b>	<b>10%</b>
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(2,006)	(574)	(1,191)	-41%	(1,739)	(2,197)	26%
<b>Resultado de la Operación</b>	<b>2,227</b>	<b>3,811</b>	<b>3,116</b>	<b>40%</b>	<b>13,732</b>	<b>14,776</b>	<b>8%</b>
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	-	-	394	0%	59	562	> +100%
<b>Resultado antes de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>2,227</b>	<b>3,811</b>	<b>3,510</b>	<b>58%</b>	<b>13,791</b>	<b>15,338</b>	<b>11%</b>
Impuestos a la Utilidad	(307)	(875)	(682)	> +100%	(2,689)	(4,059)	51%
<b>Resultado Neto</b>	<b>1,920</b>	<b>2,936</b>	<b>2,828</b>	<b>47%</b>	<b>11,102</b>	<b>11,279</b>	<b>2%</b>
Otros Resultados Integrales							
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	238	(489)	662	> +100%	(245)	255	> -100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	(137)	831	(774)	> +100%	473	(150)	> -100%
Remediación de beneficios definidos a los empleados	(366)	20	(154)	-58%	(355)	(129)	-64%
Participación en ORI de otras entidades	(2)	-	1	> -100%	(2)	1	> -100%
<b>Resultado Integral</b>	<b>1,653</b>	<b>3,298</b>	<b>2,563</b>	<b>55%</b>	<b>10,973</b>	<b>11,256</b>	<b>3%</b>

1). PTPP: "Pre-Tax, Pre-Provision", resultado antes de impuestos y reservas.

## Margen Financiero

El margen financiero fue de \$7,180 millones al cierre del cuarto trimestre de 2023, un incremento de \$441 millones o 7% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente relacionado con mayores ingresos en la cartera comercial e hipotecaria; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de \$446 millones o 7%; debido principalmente a mayores volúmenes de cartera hipotecaria, auto, préstamos sin garantía y cartera corporativa; así como mayores depósitos de exigibilidad inmediata.

El margen financiero acumulado al cierre de diciembre 2023 ascendió a \$27,073 millones, un incremento anual de \$1,514 millones o 6% respecto al mismo periodo de 2022, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera corporativa, hipotecaria, auto y préstamos sin garantía; así como una mayor participación de depósitos a plazo y mayores intereses pagados; relacionado con niveles más altos en las tasas de referencia.

## Ingresos no Financieros

El total de ingresos no financieros fue de \$1,637 millones en el cuarto trimestre de 2023, una disminución de \$167 millones o 9% respecto al mismo periodo del año anterior, debido a mayores gastos en aportaciones al IPAB y en afectaciones a la estimación de pérdidas crediticias esperadas; ambos en Otros Ingresos / Egresos de la Operación.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron una disminución de \$110 millones o 6%, debido a mayores comisiones, más que compensadas por mayores gastos en aportaciones al IPAB y afectaciones a la estimación de pérdidas crediticias esperadas (ambos en Otros Ingresos / Egresos de la Operación), así como menores ingresos por intermediación. La variación en resultado por intermediación se debió principalmente a una pérdida en instrumentos financieros derivados; compensados parcialmente por una utilidad en inversiones en instrumentos financieros y mercado cambiario.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de diciembre 2023 ascendió a \$7,220 millones, un incremento de \$604 millones o 9% respecto al año anterior debido principalmente a mayores ingresos por intermediación y comisiones de seguros en Otros Ingresos / Egresos de la Operación. La variación en intermediación se debe principalmente a mayores ingresos provenientes de inversiones en instrumentos financieros, compensados parcialmente por una menor utilidad en el mercado cambiario y una pérdida en instrumentos financieros derivados.

	3 meses				12 meses		
	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%	31 dic 2022	31 dic 2023	A/A Δ%
<b>Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>							
Aceptaciones por Cuenta de Terceros	-	-	1	0%	1	3	> +100%
Actividades Fiduciarias	54	53	46	-15%	230	212	-8%
Apertura de Cuenta	6	6	5	-17%	19	22	16%
Cartas de Crédito	82	34	81	-1%	248	251	1%
Cheques Certificados	1	1	1	0%	3	3	0%
Cheques de caja	1	-	-	-100%	2	1	-50%
Compraventa de instrumentos financieros	-	(1)	-	0%	1	2	100%
Manejo de Cuenta	86	83	91	6%	355	339	-5%
Operaciones de Crédito	487	403	482	-1%	1,745	1,663	-5%
Otras Comisiones y Tarifas	401	395	430	7%	1,491	1,689	13%
Servicios de Banca Electrónica	50	45	47	-6%	186	188	1%
Transferencia de Fondos	29	25	26	-10%	111	104	-6%
<b>Total de Comisiones y Tarifas (netas)</b>	<b>1,197</b>	<b>1,044</b>	<b>1,210</b>	<b>1%</b>	<b>4,392</b>	<b>4,477</b>	<b>2%</b>

	3 meses				12 meses		
	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%	31 dic 2022	31 dic 2023	A/A Δ%
<b>Scotiabank- Otros Ingresos/Egresos de la operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>							
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	20	9	(15)	> -100%	(62)	6	> -100%
Aportaciones al IPAB	(521)	(551)	(577)	11%	(2,020)	(2,203)	9%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	25	8	5	-80%	217	57	-74%
Donativos	(11)	-	(17)	55%	(20)	(17)	-15%
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados	14	18	9	-36%	53	63	19%
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito	52	-	-	-100%	53	-	-100%
Ingresos por Arrendamiento	3	11	9	> +100%	17	42	> +100%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados	45	53	56	24%	145	206	42%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	639	782	787	23%	2,823	3,050	8%
Pérdida por venta de cartera de crédito	-	-	(79)	0%	-	(79)	0%
Quebrantos	(34)	(73)	(149)	> +100%	(591)	(360)	-39%
Recuperaciones	11	3	3	-73%	19	17	-11%
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo	1	13	(1)	> -100%	12	12	0%
Utilidad por venta de cartera de crédito	30	-	84	> +100%	30	84	> +100%
<b>Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación</b>	<b>274</b>	<b>273</b>	<b>115</b>	<b>-58%</b>	<b>676</b>	<b>878</b>	<b>30%</b>

## Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

	3 meses				12 meses		
	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%	31 dic 2022	31 dic 2023	A/A Δ%
<b>Scotiabank- Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>							
<b>Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios</b>	<b>(2,006)</b>	<b>(574)</b>	<b>(1,191)</b>	<b>-41%</b>	<b>(1,739)</b>	<b>(2,197)</b>	<b>26%</b>

En el cuarto trimestre de 2023, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en \$1,191 millones, una disminución de \$815 millones respecto al mismo periodo del año anterior; debido a menores requerimientos de cartera comercial; compensados parcialmente por mayores requerimientos de cartera de vivienda, consumo y automotriz.

Respecto al trimestre anterior, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra un incremento de \$617 millones, debido principalmente a mayores requerimientos en la cartera comercial, vivienda, consumo y automotriz.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de diciembre 2023 ascendió a \$2,197 millones, un incremento de \$458 millones o 26% respecto al acumulado del año anterior, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias en cartera de vivienda, consumo y automotriz; compensado parcialmente por el efecto en reservas crediticias producto de la implementación de IFRS 9 durante el primer trimestre de 2022.

## Gastos de Administración y Promoción

	3 meses				12 meses		
	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%	31 dic 2022	31 dic 2023	A/A Δ%
<b>Scotiabank- Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>							
Gastos de Personal	(1,555)	(1,799)	(1,783)	15%	(7,426)	(7,950)	7%
Gastos de Operación	(2,755)	(2,297)	(2,727)	-1%	(9,278)	(9,370)	1%
<b>Total de Gastos de Administración y Promoción</b>	<b>(4,310)</b>	<b>(4,096)</b>	<b>(4,510)</b>	<b>5%</b>	<b>(16,704)</b>	<b>(17,320)</b>	<b>4%</b>

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,510 millones en el cuarto trimestre de 2023, un incremento de \$200 millones o 5% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a una mayor PTU y mayores gastos de amortización de sistemas.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, incrementaron \$414 millones u 10%, debido principalmente a mayores gastos por amortización de sistemas, tarjetas de crédito y gastos generales.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de diciembre 2023 ascendieron a \$17,320 millones, un incremento anual de \$616 millones o 4%, debido principalmente a mayores sueldos, amortización de sistemas y PTU.

## Impuestos a la Utilidad

	3 meses				12 meses		
	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%	31 dic 2022	31 dic 2023	A/A Δ%
<b>Scotiabank-Impuestos - Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>							
Impuesto a la Utilidad Causado	(682)	(1,103)	(657)	-4%	(2,924)	(3,701)	27%
Impuesto a la Utilidad Diferido	375	228	(25)	> -100%	235	(358)	> -100%
<b>Total de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>(307)</b>	<b>(875)</b>	<b>(682)</b>	<b>&gt; +100%</b>	<b>(2,689)</b>	<b>(4,059)</b>	<b>51%</b>

En el cuarto trimestre de 2023, se registró un impuesto neto a cargo de \$682 millones, un incremento de \$375 millones respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una mayor utilidad gravable en el periodo.

Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto disminuyó \$193 millones o 22%, principalmente por una menor utilidad gravable en el periodo.

Los impuestos netos acumulados al cierre de diciembre 2023 ascendieron a \$4,059 millones, un incremento anual de \$1,370 millones o 51%, debido a la disminución de la inflación del ejercicio y a una mayor utilidad gravable en el periodo.

## Balance General

<b>Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	231,456	275,547	284,193	23%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	476,776	479,687	496,519	4%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	18,541	19,791	17,061	-8%
Partidas diferidas	2,746	2,899	3,093	13%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(16,805)	(15,793)	(13,209)	-21%
Otros Activos	37,223	41,081	48,663	31%
<b>Total Activo</b>	<b>749,937</b>	<b>803,212</b>	<b>836,320</b>	<b>12%</b>
Depósitos	485,323	530,579	541,557	12%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	49,518	30,451	36,804	-26%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,057	9,102	9,060	0%
Otros Pasivos	130,759	151,957	170,213	30%
<b>Total Pasivo</b>	<b>674,657</b>	<b>722,089</b>	<b>757,634</b>	<b>12%</b>
<b>Capital</b>	<b>75,280</b>	<b>81,123</b>	<b>78,686</b>	<b>5%</b>
<b>Total Pasivo y Capital</b>	<b>749,937</b>	<b>803,212</b>	<b>836,320</b>	<b>12%</b>

Al 31 de diciembre de 2023, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$836,320 millones, un incremento de \$86,383 millones o 12% respecto al cierre de diciembre de 2022. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en cartera de crédito, inversiones en instrumentos financieros (gubernamental) y deudores por liquidación de operaciones (en otros activos).

Los activos totales incrementaron \$33,108 millones o 4% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en cartera de crédito e inversiones en instrumentos financieros (gubernamental).

El total del pasivo registró \$757,634 millones al 31 de diciembre de 2023, un incremento de \$82,977 millones o 12% respecto al año pasado. Este incremento se debe a mayores volúmenes en depósitos y otros pasivos (acreedores por reporte, instrumentos financieros derivados y acreedores por liquidación de operaciones).

El pasivo total incrementó \$35,545 millones o 5% respecto al cierre del trimestre anterior, principalmente por mayores volúmenes en colaterales vendidos o dados en garantía (en otros pasivos) y depósitos; así como en préstamos bancarios y de otros organismos.

## Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

<b>Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	33,259	34,424	37,274	12%
Créditos a la Vivienda	189,071	205,076	213,481	13%
<b>Total Préstamos de Menudeo</b>	<b>222,330</b>	<b>239,500</b>	<b>250,755</b>	<b>13%</b>
Actividad Empresarial o Comercial	221,292	200,356	200,774	-9%
Entidades Financieras	17,426	24,931	23,989	38%
Entidades Gubernamentales	15,728	14,900	21,001	34%
<b>Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales</b>	<b>254,446</b>	<b>240,187</b>	<b>245,764</b>	<b>-3%</b>
<b>Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2</b>	<b>476,776</b>	<b>479,687</b>	<b>496,519</b>	<b>4%</b>

La cartera de préstamos de menudeo al 31 de diciembre de 2023 alcanzó \$250,755 millones, un incremento anual de \$28,425 millones o 13% y de \$11,255 o 5% millones respecto al trimestre anterior. Los incrementos anual y trimestral fueron impulsados por mayores créditos a la vivienda, créditos automotrices, personales y tarjeta de crédito.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de diciembre de 2023 se ubicó en \$245,764 millones, una disminución anual de \$8,682 millones o 3%; debido a menores créditos de cartera empresarial o comercial; compensados parcialmente por mayores créditos a entidades financieras y gubernamentales.

Respecto al trimestre anterior, el total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales incrementaron \$5,577 millones o 2%, debido a mayores créditos a entidades gubernamentales.

## Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

<b>Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	18,541	19,791	17,061	-8%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(16,805)	(15,793)	(13,209)	-21%
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta</b>	<b>1,736</b>	<b>3,998</b>	<b>3,852</b>	<b>&gt; +100%</b>
<b>Índice de morosidad</b>	<b>3.74%</b>	<b>3.96%</b>	<b>3.32%</b>	<b>-42 pb</b>

Al 31 de diciembre de 2023 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$17,061 millones, una disminución anual y trimestral de \$1,480 millones u 8% y de \$2,730 millones o 14% respectivamente.

En esta misma fecha, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$13,209 millones, una disminución anual de \$3,596 millones o 21% y de \$2,584 millones o 16% respecto del trimestre anterior.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 77.4% al 31 de diciembre de 2023, una disminución de 1,400pb respecto del año anterior y de 300pb respecto del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 31 de diciembre de 2023 fue de 3.3%, una disminución de 42pb respecto del año anterior y una disminución de 64pb respecto al trimestre pasado.

## Depósitos

<b>Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023	A/A Δ%
<b>Total Depósitos Vista y Ahorro</b>	<b>231,775</b>	<b>269,967</b>	<b>276,129</b>	<b>19%</b>
Público en General	209,629	207,459	208,686	0%
Mercado de Dinero	31,175	41,217	44,504	43%
<b>Total Depósitos a Plazo</b>	<b>240,804</b>	<b>248,676</b>	<b>253,190</b>	<b>5%</b>
Títulos de Crédito Emitidos	11,765	10,677	10,941	-7%
Cuenta global de captación sin movimientos	979	1,259	1,297	32%
<b>Total de Depósitos</b>	<b>485,323</b>	<b>530,579</b>	<b>541,557</b>	<b>12%</b>

El total de depósitos registró \$541,557 millones al 31 de diciembre de 2023, un incremento anual de \$56,234 millones o 12%, y de \$10,978 millones o 2% respecto al trimestre anterior. Los incrementos anual y trimestral se debieron principalmente a mayores depósitos de vista y ahorro, así como en plazo.

## Obligaciones Subordinadas en Circulación

Al 31 de diciembre de 2023, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$9,060 millones, sin cambios significativos respecto al año pasado y al trimestre anterior.

<b>Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros</b> (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023 valor razonable)					
Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
<b>Instrumentos financieros negociables</b>	<b>75,796</b>	<b>2,309</b>	<b>16</b>	<b>-</b>	<b>78,121</b>
Sin restricción:	-	-	16	-	16
Restringidos:	75,796	2,309	-	-	78,105
En operaciones de reporto	66,554	2,309	-	-	68,863
Préstamos de valores	1,508	-	-	-	1,508
Otros	7,734	-	-	-	7,734
<b>Instrumentos financieros para cobrar o vender</b>	<b>73,204</b>	<b>26,790</b>	<b>-</b>	<b>2,030</b>	<b>102,024</b>
Sin restricción:	68,184	26,790	-	2,030	97,004
Restringidos:	5,020	-	-	-	5,020
En operaciones de reporto	4,383	-	-	-	4,383
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	637	-	-	-	637
<b>Instrumentos financieros para cobrar principal e interés</b>	<b>4,903</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4,903</b>
Sin restricción	4,903	-	-	-	4,903
<b>Total</b>	<b>153,903</b>	<b>29,099</b>	<b>16</b>	<b>2,030</b>	<b>185,048</b>

<b>Scotiabank</b> <b>Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales</b> (Superiores al 5% del capital neto) (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)				
Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
<b>I-BANSAN-24012</b>	<b>14,818,500,007</b>	<b>11.25%</b>	<b>4</b>	<b>14,809</b>
<b>I-BANSAN-24045</b>	<b>100,958,332</b>	<b>11.50%</b>	<b>30</b>	<b>100</b>
<b>F_HSBCMX_23004</b>	<b>50,000,000</b>	<b>11.50%</b>	<b>28</b>	<b>5,040</b>

<b>Scotiabank-Instrumentos financieros derivados</b> (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023 valor razonable)														
Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Negociación	3,550	2,927	-	-	1,297	1,053	370	389	26,372	26,443	-	-	31,589	30,812
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	11,153	9,015	-	-	11,153	9,015

**Scotiabank-Montos nacionales en operaciones derivadas**  
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de diciembre de 2023)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados	
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
<b>Con fines de negociación</b>												
Posición USD	3,559	3,981	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	114	114	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CHF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	57	57	426	426	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	59	59	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	87	87	1,191	1,191	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	-	3,049	3,745	881	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	28,376	27,794	411,567	409,067	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	796	796	5,058	4,730	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	8	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
<b>Con fines de cobertura</b>												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	67,199	3,500	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	557	518	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	157,737	42,802	-	200,539
Créditos a entidades financieras	23,989	-	-	23,989
Créditos a entidades gubernamentales	16,572	4,429	-	21,001
Créditos al consumo	36,351	-	-	36,351
Créditos a la vivienda	209,772	11	45	209,828
<b>Total</b>	<b>444,421</b>	<b>47,242</b>	<b>45</b>	<b>491,708</b>

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	235	-	-	235
Créditos al consumo	923	-	-	923
Créditos a la vivienda	3,648	3	2	3,653
<b>Total</b>	<b>4,806</b>	<b>3</b>	<b>2</b>	<b>4,811</b>

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	4,969	1,390	-	6,359
Créditos a entidades financieras	56	-	-	56
Créditos al consumo	937	-	-	937
Créditos a la vivienda	9,680	24	5	9,709
<b>Total</b>	<b>15,642</b>	<b>1,414</b>	<b>5</b>	<b>17,061</b>

<b>Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)</b>	
<b>Saldo al 30 de septiembre de 2023</b>	<b>19,791</b>
Reestructuras	75
Recuperaciones	(430)
Castigos y quitas	(4,087)
Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 3	1,750
Fluctuación Tipo Cambio	(38)
<b>Saldo al 31 de diciembre de 2023</b>	<b>17,061</b>

<b>Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)</b>		
<b>Saldo al 30 de septiembre de 2023</b>		<b>15,793</b>
Más: Creación de reservas		32
Calificación		1,234
Menos: Adjudicaciones y otros		173
Castigos y quitas		639
Comercial	11	
Hipotecario	111	
Consumo	517	
Eliminaciones		2,770
Venta cartera Usó		223
Desliz cambiario		45
<b>Saldo al 31 de diciembre de 2023</b>		<b>13,209</b>

<b>Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito</b>	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2			
Metropolitano	62.2%	66.0%	69.3%
Noroeste – Centro	10.7%	9.9%	8.7%
Norte	13.7%	12.3%	11.2%
Bajío	7.9%	6.7%	6.3%
Sur	5.5%	5.1%	4.5%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3			
Metropolitano	41.5%	54.3%	57.2%
Noroeste – Centro	19.6%	15.8%	13.1%
Norte	7.3%	5.7%	5.9%
Bajío	15.7%	12.2%	13.5%
Sur	15.9%	12.0%	10.3%

**Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia**  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

Grado de Riesgo	Importe Cartera Crediticia	Reservas Preventivas Necesarias					Total Reservas Preventivas
		Cartera Comercial	Consumo		Cartera de Vivienda		
			No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes			
Exceptuada calificada							
Riesgo A1	444,416	919	105	474	321	1,819	
Riesgo A2	62,505	579	30	205	16	830	
Riesgo B1	5,744	26	51	61	16	154	
Riesgo B2	6,960	6	70	34	58	168	
Riesgo B3	5,674	61	27	36	53	177	
Riesgo C1	3,253	7	67	68	55	197	
Riesgo C2	3,954	77	38	96	237	448	
Riesgo D	8,529	703	56	322	1,454	2,535	
Riesgo E	8,922	3,628	649	274	1,877	6,428	
<b>Total</b>	<b>549,957</b>	<b>6,006</b>	<b>1,095</b>	<b>1,570</b>	<b>4,086</b>	<b>12,756</b>	
<b>Exceso</b>						<b>453</b>	
<b>Reservas Constituidas</b>						<b>13,209</b>	

**NOTAS:**

- 1). 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 2023.
- 2). 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.

3). El exceso en las reservas preventivas constituidas se explica por lo siguiente:

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$	9
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		44
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3		4
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		396
<b>Total</b>	<b>\$</b>	<b>453</b>

### 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 2023 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses” son:

<b>Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>			
	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	1,805	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
<b>Total</b>	<b>11,209,692</b>	<b>1,805</b>	

<b>Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>	ISR	PTU
Futuros castigos de crédito	4,793	1,137
Pagos anticipados	(620)	(147)
Comisiones cobradas por anticipado	-154	(37)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	786	184
Plan de pensiones	1,048	248
Provisiones y otros	730	135
Otros	(439)	4
<b>Efecto Neto en Diferido</b>	<b>6,144</b>	<b>1,524</b>

Al 31 de diciembre de 2023, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

<b>Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos</b> (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)						
Vencimiento	Préstamos			Financiamiento		Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	18,448	2,674	-	21,122
Largo	-	-	2,000	4,023	-	6,023
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>20,448</b>	<b>6,697</b>	<b>-</b>	<b>27,145</b>
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	12.87%	10.90%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	8,519	-	29	632	-	9,180
Largo	-	-	-	479	-	479
<b>Total</b>	<b>8,519</b>	<b>0</b>	<b>29</b>	<b>1,111</b>	<b>-</b>	<b>9,659</b>
Tasa Promedio	5.89%	0.00%	6.63%	5.96%	0.00%	
<b>Total Préstamos Interbancarios</b>	<b>8,519</b>	<b>0</b>	<b>20,477</b>	<b>7,808</b>	<b>0</b>	<b>36,804</b>

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 2023.

<b>Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional</b>	31 dic 2022	30 sep 2023	31 dic 2023
<b>Depósitos a la Vista</b>	<b>49.1%</b>	<b>52.2%</b>	<b>52.3%</b>
Metropolitano	22.3%	25.6%	27.4%
Noroeste – Centro	9.1%	8.8%	7.2%
Norte	7.0%	7.5%	7.0%
Bajío	5.2%	4.8%	5.0%
Sur	5.5%	5.5%	5.7%
<b>Depósitos Ventanilla</b>	<b>44.3%</b>	<b>39.9%</b>	<b>39.3%</b>
Metropolitano	21.4%	16.5%	18.0%
Noroeste - Centro	4.8%	4.4%	4.1%
Norte	8.6%	6.6%	7.5%
Bajío	5.1%	6.3%	6.0%
Sur	4.4%	6.1%	3.7%
<b>Total de Captación del Público</b>	<b>93.4%</b>	<b>92.1%</b>	<b>91.6%</b>
<b>Fondeo Profesional</b>	<b>6.6%</b>	<b>7.9%</b>	<b>8.4%</b>

<b>Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional</b> <b>Tasa Promedio</b> <b>(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>	Pesos	Dólares
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	5.64%	2.63%
Depósitos a plazo	10.04%	0.00%

<b>Scotiabank-Resultados por Intermediación</b> <b>(millones de pesos)</b>	31 dic 2023
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(961)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(15)
Resultado por valuación de divisas	(1,880)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	3,368
Resultado por compraventa de divisas	1,357
Costos de transacción	(4)
<b>Total</b>	<b>1,865</b>

## Emisión de Certificados Bursátiles

Al cierre de diciembre de 2023, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

<b>Cuarta*</b>	
Clave de Pizarra	SCOTIAB 23
Monto de la Emisión	\$7,125 millones
Fecha de Emisión y Colocación	18 agosto 2023
Plazo de Vigencia de la Emisión	927 días, aprox. 2.5 años
Garantía	Quirografaria
Tasa de interés	TIIIE28+0.04
Pago de Intereses	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) / "mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento

\* Programa autorizado por la CNBV en diciembre de 2018

## Emisión de Obligaciones Subordinadas

<b>(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>					
Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo	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
<b>Total de Obligaciones Subordinadas</b>				<b>8,908,000,000</b>	

## 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
99_SCOTIAB_4-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99_SCOTIAB_5-21	4,772,100	29-abr-21	26-abr-24	1093	Index (IDBTVER)	477,210,000
99_SCOTIAB_6-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1093	Index (IDBTVER)	57,230,000
99_SCOTIAB_9-21	3,913,200	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	391,320,000
99_SCOTIAB_10-21	3,787,250	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	378,725,000
99_SCOTIAB_1-22	533,200	28-feb-22	25-feb-25	1093	MSFDVTHY Index	53,320,000
99_SCOTIAB_2-22	512,600	28-feb-22	27-feb-24	729	Invesco QQQ Series 1	51,260,000
99_SCOTIAB_5-22	1,238,860	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	123,886,000
99_SCOTIAB_6-22	1,795,500	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	179,550,000
99_SCOTIAB_7-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_8-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_11-22	5,790,750	17-nov-22	14-nov-25	1093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	579,075,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-22	14-nov-25	1092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	803,800	19-dic-22	17-dic-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	80,380,000
99_SCOTIAB_1-23	120,200	03-mar-23	03-sep-24	550	iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)	12,020,000
99_SCOTIAB_2-23	5,849,350	27-jul-23	27-ene-25	550	Dólar - Peso (USDMXN)	584,935,000
99_SCOTIAB_3-23	423,600	31-ago-23	28-feb-25	547	Dólar - Peso (USDMXN)	42,360,000
83_SCOTIAB_4-23	146,267	21-nov-23	15-nov-24	360	S&P 500 Index (SPX)	14,626,700
99_SCOTIAB_5-23	2,536,050	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	253,605,000
99_SCOTIAB_6-23	1,736,600	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P / BMV IPC (MEXBOL)	173,660,000
99_SCOTIAB_7-23	481,400	15-dic-23	14-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	48,140,000
<b>Total Bonos Bancarios al 31 de diciembre de 2023</b>						<b>3,749,776,700</b>

## **Criterios Contables Especiales derivado de las inundaciones y daños ocasionados por el Huracán OTIS**

Mediante los oficios P-307/2023 de fecha 27 de octubre de 2023 y P-318/2023 de fecha 10 de noviembre de 2023, la Comisión emitió con carácter temporal, los criterios contables especiales (CCE) para las instituciones de crédito respecto de la cartera crediticia de consumo, vivienda y comercial, para los clientes que hayan sido afectados en las zonas indicadas por la autoridad competente en la Declaratoria de Emergencia, o bien, a las señaladas en la Declaratoria de Desastre Natural, y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 o Etapa 2 al 24 de octubre de 2023. El plazo para realizar los trámites de renovación o reestructuración finalizarán a más tardar el 30 de abril de 2024.

El programa de apoyo consiste en otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 6 meses y será aplicable a los tipos de crédito y clientes siguientes.

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

Los siguientes créditos no se consideraron como reestructuras y/o renovaciones y podrán permanecer en la misma categoría de riesgo de crédito:

- 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”,
- 2). Créditos con “pagos periódicos de principal e intereses” y,
- 3). Créditos que desde su inicio se estipule su carácter de revolventes.

Los créditos que sean reestructurados o renovados al amparo de los CCE fueron reportados a las Sociedades de Información Crediticias (SIC) como sigue:

- a) Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 al 24 de octubre de 2023, y que no cuenten con días de atraso, no presentaron clave de observación alguna en las SIC.
- b) Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 2 al 24 de octubre de 2023, y que cuenten con días de atraso, presentaron la clave de observación RA en las SIC.
- c) Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 con posterioridad al 24 de octubre de 2023, presentaron la clave de observación RA en las SIC.

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 para riesgos crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una estimación por la diferencia en un período que no exceda de 12 meses.

## Aplicación del programa OTIS

Derivado del impacto negativo generado por los fenómenos hidrometeorológicos con afectación severa en el estado de Guerrero, México, el Banco ha determinado apoyar a sus clientes mediante la implementación de diversos programas de apoyo que serán aplicables a todos sus clientes que se encuentren en dicho estado y se suscriban al programa a partir del 24 de octubre 2023 y hasta el 30 de abril de 2024, conforme a lo siguiente:

### a) CrediAuto

Diferimiento de 6 mensualidades sin capitalización de intereses. Los intereses e impuestos de esas mensualidades diferidas se prorratearon en los pagos mensuales siguientes incrementando el plazo del crédito en 6 meses más. Si el crédito llega a estar vigente (con saldo) en los 6 meses adicionales, se contratarán seguros de daños, vida y desempleo que cubran la extensión de plazo.

### b) Hipotecario

Diferimiento de 6 mensualidades (los seguros se capitalizan), en este período no se considerará gasto de cobranza por pago tardío; el monto de los intereses prorrogados se distribuirá en 36 mensualidades que el cliente comenzará a cubrir en su pago mensual a partir de la cuota 13 posterior a la aplicación del diferimiento.

### c) Préstamo personal y préstamo de nómina

Diferimiento de 6 meses del pago del crédito sin capitalización de intereses, el plazo del préstamo será extendido en este mismo número de meses, de acuerdo con la periodicidad del crédito, los intereses generados durante el período de apoyo se harán exigibles en las cuotas que se adicionaron al plazo original. Durante el plan no habrá afectación negativa en el historial de crédito, ni se generará marca negativa en buró de crédito.

### d) ScotiaLine

El apoyo consistió en no requerir el pago mínimo de la línea de crédito revolving del mes de noviembre 2023 al mes de abril 2024. Durante dicho período de diferimiento no se hará el cobro de la comisión de gastos de cobranza por pago tardío, no habrá afectación en el historial de crédito, ni se generará una marca negativa en él. Durante este período el saldo sigue generando intereses e IVA que serán exigibles y sumados al pago mínimo requerido en el estado de cuenta. El cliente podrá hacer disposiciones de su línea de crédito y el pago correspondiente a estas disposiciones será exigible al terminar dicho periodo.

### e) Tarjetas de crédito

Consiste en que no se requerirá el pago mínimo de la tarjeta de crédito de noviembre 2023 a abril 2024. Durante dicho período de diferimiento no se hará el cobro de la comisión de gastos de cobranza por pago tardío, no habrá afectación en el historial de crédito, ni se generará una marca negativa. Dado que el beneficio consiste en diferir el cobro de pago mínimo sin ninguna penalización, mientras no se cubra el pago para no generar intereses se generarán los intereses ordinarios correspondientes. Los intereses generados mes a mes formaran parte del saldo revolving y con base a dicho saldo se calculará el pago mínimo al finalizar el plan de apoyo.

Los créditos sujetos al criterio contable especial, no se consideraron como reestructuras conforme a lo establecido en el párrafo 35 del Criterio Contable B-6, Cartera de Crédito, tampoco fueron reportados como créditos en etapa 3 ante las sociedades de información crediticia.

A continuación, se presentan los importes que se hubieran registrado y presentado en el estado de situación financiera consolidado y en el estado consolidado de resultado integral por tipo de cartera, de no haberse aplicado el criterio contable especial, así como, el detalle de los conceptos y montos por tipo de cartera, por los cuales se haya realizado la afectación contable con motivo de la aplicación del criterio contable especial al 31 de diciembre de 2023.

	2023		
	Saldo con CCE OTIS	Efectos en Cartera y Estimación	Saldo sin CCE OTIS
Cartera comercial	\$ 245,529	-	245,529
Créditos de consumo	36,351	(3)	36,348
Créditos a la vivienda:	209,828	(9)	209,819
<b>Etapa 1</b>	<b>\$ 491,708</b>	<b>(12)</b>	<b>491,696</b>
Cartera comercial	235	-	235
Créditos de consumo	923	1	924
Créditos a la vivienda:	3,653	7	3,660
<b>Etapa 2</b>	<b>\$ 4,811</b>	<b>8</b>	<b>4,819</b>
Cartera comercial	6,415	-	6,415
Créditos de consumo	937	2	939
Créditos a la vivienda:	9,709	2	9,711
<b>Etapa 3</b>	<b>\$ 17,061</b>	<b>4</b>	<b>17,065</b>
Cartera de crédito	\$ 513,580	-	513,580
(+/-) Partidas diferidas	\$ 3,093	-	3,093
(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios	\$ (13,209)	(5)	(13,214)
Total cartera de crédito, neta	\$ 503,464	(5)	503,459
<b>Total activos</b>	<b>\$ 836,320</b>	<b>(5)</b>	<b>836,315</b>
Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados)	\$ (2,197)	(5)	(2,202)
<b>Resultado neto</b>	<b>\$ 12,279</b>	<b>(5)</b>	<b>11,274</b>
<b>Total capital contable</b>	<b>\$ 78,686</b>	<b>(5)</b>	<b>78,681</b>
<b>Total pasivo y capital contable</b>	<b>\$ 836,320</b>	<b>(5)</b>	<b>836,315</b>

## Reclasificaciones

Al 31 de diciembre de 2022, el Banco agrupaba en el rubro de “Pagos anticipados y otros activos, neto” dentro del activo, los gastos de emisión y el descuento por colocación de depósitos a plazo de mercado de dinero y de títulos de crédito emitidos para efectos de presentación del estado de situación financiera consolidado. La Administración del Banco decidió reclasificarlas debido a su importancia y naturaleza al rubro de “Captación tradicional”. Los efectos de estas reclasificaciones se aplicaron retrospectivamente en el estado de situación financiera consolidado al 31 de diciembre de 2022, de acuerdo con la NIF B-1, Cambios contables y correcciones de errores. Los efectos de las reclasificaciones antes mencionadas, en los rubros del estado de situación financiera consolidado, son como sigue:

Concepto	Originalmente reportadas	Reclasificadas retrospectivamente	Cifras después de reclasificaciones
<b>Activo</b>			
Pagos anticipados y otros activos, neto	3,116	(143)	3,973
<b>Pasivo</b>			
Del público en general:			
Mercado de dinero	31,238	(63)	31,175
Títulos de crédito emitidos	11,845	(80)	11,765

# CAPITALIZACIÓN

<b>Scotiabank</b> <b>Integración del Capital</b> <b>Revelación de la integración del Capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios.</b> <b>(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>		
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	13,468
2	Resultados de ejercicios anteriores	44,837
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	20,381
4	Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1 (solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones)	No aplica
5	Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital común de nivel 1)	No aplica
6	<b>Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>	78,686
<b>Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios</b>		
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
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)	1,533
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)	-

22	Monto que excede el umbral del 15%	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	9,076
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	8,502
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	574
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	<b>Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1</b>	10,609
29	<b>Capital común de nivel 1 (CET1)</b>	68,077
<b>Capital adicional de nivel 1: instrumentos</b>		
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,583
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,583
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 región 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1)	No aplica
35	del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
36	<b>Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>	3,583
<b>Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios</b>		
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	<b>Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1</b>	-
44	<b>Capital adicional de nivel 1 (AT1)</b>	3,583
45	<b>Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)</b>	71,660
<b>Capital de nivel 2: instrumentos y reservas</b>		
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	3,373
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	396
51	<b>Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios</b>	3,769
<b>Capital de nivel 2: ajustes regulatorios</b>		
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	<b>Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2</b>	-
58	<b>Capital de nivel 2 (T2)</b>	3,769
59	<b>Capital total (TC = T1 + T2)</b>	75,429
60	<b>Activos ponderados por riesgo totales</b>	471,664
<b>Razones de capital y suplementos</b>		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	14.43%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.19%

63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.99%
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)	17.53%
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)	7.43%
<b>Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)</b>		
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
<b>Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)</b>		
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)	-
<b>Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2</b>		
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)	396
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,156
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	-
<b>Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)</b>		
80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
81	Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	No aplica
82	Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual	-
83	Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-
84	Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual	-
85	Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-

**Scotiabank-Notas al formato de revelación de la integración de capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios**

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*	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. 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.
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.
12*	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 aquellas 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*	<p>El monto de la inversión en cualquier acción propia que:</p> <p>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 las sociedades 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.</p>
17*	<p>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 inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades 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*	<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 las sociedades 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*	<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 las sociedades 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*	<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	<p>No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.</p>

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	<b>Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.</b>
	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. 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. 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. 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. 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.
	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. 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 del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
	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. 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. 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. 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. 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. 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.
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. 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. 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	<b>Ajustes nacionales considerados:</b> 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.
	<b>Ajustes nacionales considerados:</b>
56	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 2023)		
Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
<b>Activo</b>		
BG1	Efectivo y equivalentes de efectivo	50,552
BG2	Cuentas de Margen	1,372
BG3	Inversiones en instrumentos financieros	185,048
BG4	Deudores por reporto	8,004
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos financieros derivados	42,742
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(650)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	503,464
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	26,938
BG11	Bienes adjudicados (neto)	585
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	2,623
BG13	Inversiones permanentes	4,229
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta	14
BG15	Impuestos a la utilidad diferidos (neto)	6,124
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)	2,575
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,646
	Activos Intangibles (neto)	4,610
<b>Pasivo</b>		
BG17	Captación tradicional	541,732
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	36,804
	Valores Asignados por liquidar	11,501
BG19	Acreedores por reporto	73,261
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	8,384
BG22	Instrumentos financieros derivados	39,827
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	-
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	31,071
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por Impuestos a la Utilidad	396
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,071
	Pasivos por arrendamiento	1,791

	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	9,060
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	6,293
<b>Capital contable</b>		
BG29	Capital contribuido	13,468
BG30	Capital ganado	65,217
<b>Cuentas de orden</b>		
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	258,234
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	486,328
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	78,303
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	15,338
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	8,383
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	-
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,601
BG41	Otras cuentas de registro	1,957,381

<b>Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General</b>				
<b>Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital neto</b>				
<b>(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>				
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	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
<b>ACTIVO</b>				
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	1,533	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,533
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	-	BG 15 Impuestos y PTU dif (neto) \$0
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	396	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$396
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	-	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 0
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	8,502	BG 16 Activos Intangibles \$4,610 más Gastos de Instalación \$3,892
21	Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	574	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 574
<b>PASIVO</b>				
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	3,583	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,583
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	3,373	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,373
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	-	

<b>CAPITAL CONTABLE</b>				
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	13,468	BG 29 Capital Social \$10,671 más Prima en Venta de Acciones \$2,797
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	44,837	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$44,837
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	702	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$702
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	19,679	BG 30 Reservas de Capital \$9,112 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$101) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$611) más Resultado Neto \$11,279
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	-	
<b>CUENTAS DE ORDEN</b>				
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
<b>CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL</b>				
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	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

<b>Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>		
Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	61,407	4,913
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	989	79
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA 's	2,371	190
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's, UMA 's o con rendimiento referido al INPC	30	2
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	7,196	576
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	2,164	173
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	60	5
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	12	1
<b>Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo</b>		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	27	2
Grupo I-B (ponderados al 4%)	-	-
Grupo II (ponderados al 0%)	-	-
Grupo II (ponderados al 10%)	-	-
Grupo II (ponderados al 20%)	-	-
Grupo II (ponderados al 50%)	-	-
Grupo II (ponderados al 100%)	-	-
Grupo II (ponderados al 120%)	-	-
Grupo II (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 2.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 10%)	856	68
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	5,288	423
Grupo III (ponderados al 25%)	-	-
Grupo III (ponderados al 50%)	435	35
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%)	4,058	325
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	246	20
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	471	38
Grupo VI (ponderados al 20%)	4,395	352
Grupo VI (ponderados al 25%)	2,815	225
Grupo VI (ponderados al 30%)	10,820	866
Grupo VI (ponderados al 40%)	11,209	897
Grupo VI (ponderados al 50%)	36,727	2,938
Grupo VI (ponderados al 70%)	35	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	25,978	2,078
Grupo VI (ponderados al 85%)	6,183	495
Grupo VI (ponderados al 100%)	47,812	3,825
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%)	115	9
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	18,709	1,497
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	9,223	738
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	121,093	9,687
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	126	10
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,638	131
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%)	790	63
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%)	7,158	573
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,592	287
Grupo IX (ponderados al 100%)	28,418	2,273
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	33	3
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 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	3,053	244
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	20	2
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	66	5

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional		
Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Indicador de Negocio	46,046	3,684

## CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

Al 31 de diciembre del 2023, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 14.52% (Índice regulatorio más suplemento de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local más Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales), 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	13,468,335,561
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.
	<b>Rendimientos / dividendos</b>	
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 de dividendos	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-Nota a los Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto

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.

## 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 diferentes a las anteriores	-
España	-	Luxemburgo	-		
Estados Unidos	-	México	-		

**Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)**

Referencia	RUBRO	Dic-23 <sup>1)</sup> T	Sep-23 T-1	Jun-23 T-2	Mar-23 T-3	Dic-22 T-4
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	16,280	7,799	7,585	7,638	7,719
1a	No aplica					
2	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo	471,664	461,662	456,829	459,745	475,011
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	3.25%	1.63%	1.63%	1.63%	1.63%
3a	No aplica					
4	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones	868,289	831,882	809,032	814,737	807,899
5	"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	1.88%	0.94%	0.94%	0.94%	0.94%
5a	No aplica					
6a	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No
6b	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No
6c	En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?	0%	0%	0%	0%	0%

**1).** El Banco al considerarse una institución de Importancia Sistémica Local debe de constituir el suplemento al capital neto en un plazo de cuatro años:

Fecha	Suplemento al Capital Neto
31 de diciembre de 2022	$\frac{1}{4}$ * Suplemento al Capital Neto
31 de diciembre de 2023	$\frac{2}{4}$ * Suplemento al Capital Neto
31 de diciembre de 2024	$\frac{3}{4}$ * Suplemento al Capital Neto
31 de diciembre de 2025	Suplemento al Capital Neto

<b>Scotiabank</b>		
<b>Composición del Suplemento al Capital Neto</b>		
<b>(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)</b>		
Referencia		Monto
	<b>Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes</b>	
1	Capital Fundamental	68,077
2	Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto	3,583
3	Capital Básico No Fundamental no elegible, como Suplemento al Capital Neto, emitido por la institución en tenencia de terceros	-
4	Otros ajustes	-
5	<b>Instrumentos elegibles de Capital Básico No Fundamental para el Suplemento al Capital Neto</b>	<b>3,583</b>
6	Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto	3,768
7	Porción amortizada de instrumentos de capital complementario, donde el vencimiento remanente > 1 año	-
8	"Capital complementario no elegible, como Suplemento al Capital Neto emitido por la institución en tenencia de terceros	
9	Otros ajustes	-
10	<b>Instrumentos elegibles de Capital Complementario, de acuerdo a las reglas para el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales</b>	<b>3,768</b>
11	<b>Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio</b>	<b>75,429</b>
	<b>Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio</b>	
12	Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco y subordinados a pasivos excluidos	-
13	"Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco los cuales no son subordinados a pasivos excluidos, pero que cumplen con todos los demás requisitos de la hoja de términos de Suplemento al Capital Neto	
14	Del cual: Monto elegible de Suplemento al Capital Neto, después de aplicar los límites superiores.	No aplica
15	Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos por vehículos de financiación, antes del 1 de enero de 2022	No aplica
16	Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar a una Institución de importancia sistémica local en resolución	No aplica
17	<b>Suplemento al Capital Neto surgido de instrumentos de capital no regulatorio antes de ajustes</b>	<b>-</b>
	<b>Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes</b>	
18	Suplemento al Capital Neto antes de deducciones	75,429
19	Deducciones de exposiciones que corresponden a cuentas elegibles para Suplemento al Capital Neto (no aplicable a una institución de importancia sistémica local con un solo punto de entrada).	No aplica
20	Deducciones de inversiones en otros pasivos elegibles de Suplemento al Capital Neto	-

21	Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto	-
22	Suplemento al Capital Neto después de deducciones	75,429
<b>"Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto"</b>		
23	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo ajustados como es permitido bajo el régimen Suplemento al Capital Neto <sup>4</sup>	471,664
24	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones	868,289
<b>Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos</b>		
25	"Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)	15.99%
26	"Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)	8.69%
27	Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto	14.43%
28	"Requerimientos de suplementos específicos del banco (suplemento de conservación de capital más requerimiento por suplemento de capital contracíclico más requerimientos por suplemento al capital neto, expresado como porcentaje de APSRT)	4.05%
29	" Del cual: Requerimiento por suplemento de conservación de capital	0.60%
30	Del cual: Requerimiento por suplemento de capital contracíclico específico de banco	0.00%
31	Del cual: Requerimiento por suplemento al capital neto	3.45%

## Scotiabank

### Composición del Suplemento al Capital Neto

Referencia	Explicación
<b>Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes</b>	
1	El Capital Fundamental calculado de conformidad con los artículos 2 Bis 5 y 2 Bis 6 de la CUB.
2	Capital Básico No Fundamental. Esta línea proporcionará información sobre el Capital No Fundamental, calculado de conformidad con los artículos 2 Bis 5 y 2 Bis 6 de la CUB.
3	Los instrumentos de capital Básico No Fundamental emitidos por la Institución en tenencia de terceros que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.
4	Otros elementos del Capital Básico No Fundamental que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.
5	<b>Instrumentos de Capital Básico No Fundamental de acuerdo al último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, para ser calculado como línea 2 menos líneas 3 y 4.</b>
6	Capital Complementario, calculado con base en lo establecido en el artículo 2 Bis 5 y 2 Bis 7.
7	Porción amortizada de Instrumentos de Capital Complementario donde el vencimiento remanente es mayor a un año. Esta línea reconoce que, en tanto el plazo remanente de un instrumento de capital complementario sea mayor al requerimiento de vencimiento residual de un año, el monto total podrá ser incluido en el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales, incluso si el instrumento es parcialmente del capital regulatorio vía el requerimiento para amortizar el instrumento en cinco años previo al vencimiento. Solo el monto no reconocido en el capital regulatorio, que cumpla con todos los criterios de elegibilidad del Suplemento al Capital Neto deberá ser reportados en esta línea.
8	Instrumentos de capital complementario emitidos por la Institución en tenencia de terceros que no son elegibles para el Suplemento al Capital Neto. De acuerdo con la fracción IV, del artículo 2 Bis 5 de la CUB y los Anexos 1-R y 1-S, para cumplir con los requerimientos mínimos de Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales hasta el 31 de diciembre de 2021
9	Otros elementos de capital complementario que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.

10	Instrumentos de capital Complementario elegibles de Suplemento al Capital Neto de acuerdo al último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, para ser calculado como: línea 6 - línea 7 – línea 8 - línea 9.
11	Suplemento al Capital Neto surgido del capital regulatorio para ser calculado como: línea 1 + línea 5 + línea 10.
<b>Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio</b>	
12	Instrumentos externos del Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por la institución y deuda subordinada excluida. El monto reportado en esta línea debe cumplir los requerimientos de subordinación señalados en el Anexo 1-R o Anexo 1-S.
13	Instrumentos externos emitidos directamente por institución que no son subordinados a pasivos excluidos, pero cumplen los otros requisitos de los Anexos 1-R o 1-S.
14	El monto reportado en la línea 13, después de la aplicación de los límites superiores 2.5% y 3.5% mostrados en el penúltimo párrafo de la sección 11 de la hoja de términos del TLAC
15	Instrumentos externos de TLAC emitidos con fines de financiamiento previo al 1 de enero de 2022. Montos emitidos después del 1 de enero de 2022 no son elegibles para efectos de Suplemento al Capital Neto y no deben ser reportados aquí. <b>No aplica.</b>
16	Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar una institución de importancia sistémica local en resolución, sujeta a las condiciones mostradas en el segundo párrafo de la sección 7 de la hoja de términos de TLAC. <b>No aplica.</b>
17	Elementos del capital no regulatorio del Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 12 + línea 13
<b>Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes</b>	
18	Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 11 + línea 17.
19	Deducciones de exposiciones de la institución de importancia sistémica local que corresponden a cuentas elegibles para Suplemento al Capital Neto. Todos los montos reportados en esta línea deben corresponder a deducciones aplicadas después de los ajustes adecuados acordados por el grupo de administración de crisis (CMG) (siguiendo el penúltimo párrafo de la sección 3 de la hoja de términos de TLAC, el CMG debe discutir y, donde sea adecuado y consistente con la estrategia de resolución, acordar la asignación de las deducciones).
20	"Deducciones de inversiones en otros pasivos de TLAC propios, monto para ser deducido de recursos de TLAC. <b>No aplica</b>
21	Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto.
22	"El Suplemento al Capital Neto (como puede ser el caso) después de deducciones. Para ser calculado como: línea 18 - línea 20 – línea 21.
<b>"Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto</b>	
23	APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.
24	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.
<b>Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos</b>	
25	Indicador Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto), para ser calculada como línea 22 dividido entre línea 23.
26	"Indicador Suplemento al Capital Neto (como porcentaje de Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento), para ser calculado como línea 22 entre línea 24.
27	Capital Fundamental (como porcentaje de APSRT) disponible después de cumplir con el requerimiento mínimo de capital y requerimiento Suplemento al Capital Neto de la institución. Para ser calculado como índice de capital fundamental adecuado, menos cualquier capital social (como un porcentaje de APSRT) usado para cumplir el capital fundamental, el capital básico, y el capital total mínimo, así como el requerimiento de Suplemento al Capital Neto.
28	Requerimientos de suplementos específicos del banco (suplemento de conservación de capital más suplemento de capital contracíclico más requerimiento por suplemento para institución de importancia sistémica local, expresado como un porcentaje de APSRT). Calculado como la suma de: i) el suplemento de conservación de capital de la institución de importancia sistémica local; el requerimiento por suplemento contracíclico específico de la institución de importancia sistémica local; y iii) los requerimientos por suplemento al capital neto.

29	"El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan al suplemento por conservación de capital), de acuerdo al nivel de importancia sistémica local.
30	El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan con requerimientos por suplemento de capital contracíclico específico de la institución de importancia sistémica local).
31	El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan con al requerimiento para absorción de pérdidas mayores.

## Gestión de Capital

Para evaluar la suficiencia de capital, Scotiabank parte de su plan anual de exposiciones para obtener una visión prospectiva de la institución que le permita identificar los riesgos a los que está expuesto y fundamentar su toma de decisiones al visualizar métricas e indicadores clave tales como: capital, liquidez, rentabilidad y pérdidas crediticias.

El Plan de Exposiciones es estructurado con base en una visión del escenario macroeconómico del país y los planes de las distintas líneas de negocio.

Al mismo tiempo, para asegurar el cumplimiento y el monitoreo continuo de la suficiencia de Capital, se ha documentado un "Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez", el cual tiene como propósito instrumentar indicadores de alerta temprana, los cuales son la base para que el Comité de Manejo de la Liquidez y el Capital lleve a cabo las evaluaciones y seguimientos de acuerdo a lo establecido en las Políticas correspondientes, según el impacto y la magnitud del evento de estrés.

De forma trimestral se incorporan a los reportes financieros las notas de capitalización. Estas notas contienen, entre otras, la siguiente información: composición e integración del capital, composición de los activos ponderados por riesgos totales y por tipo de riesgo, así como las estimaciones del Índice de Capital.

Asimismo, anualmente se realizan las pruebas de estrés que establece la Comisión Bancaria bajo diversos escenarios, con el objetivo de asegurar que el Banco cuente con el suficiente capital para continuar intermediando recursos y otorgando créditos ante estos escenarios de estrés, considerando sus estrategias de negocio. Adicionalmente se realiza un análisis de escenarios internos de estrés que, partiendo del Plan de Exposiciones como escenario base, integran diversas condiciones macroeconómicas adversas con el fin de revelar la exposición del Banco a los diferentes riesgos.

La institución realizó durante 2023 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 y regulatorios. 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 3 de abril de 2023 como Institución de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local a Scotiabank Inverlat, S.A., mediante oficio Núm. 141-5/35035/2023 su grado de importancia sistémica y el suplemento de conservación de capital adicional, la institución fue calificada como Grado I por lo que deberá continuar con un suplemento de capital de 60 puntos base.

En base a lo anterior y continuando con la constitución del requerimiento de capacidad total de absorción de pérdidas (TLAC, que corresponde al máximo entre el 6.5% de los APSR Totales y el 3.75% de los Activos Ajustados) la institución tiene que añadir una cuarta parte desde diciembre 2022, por lo que el capital mínimo regulatorio que debe mantener Scotiabank, es de 14.55% y 12.73% al 31 de diciembre de 2023 y 2022.

## 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.

Al 30 de junio de 2021, mediante asamblea extraordinaria de accionistas se aprobó como consecuencia de la fusión llevar a cabo un aumento en el capital social del Banco por la cantidad de 53,523,304 acciones correspondientes a la serie "F" con valor nominal de un peso cada una, y el remanente del capital contable de SECOSA que excede a los valores nominales de las acciones que serán emitidas, es decir, la cantidad de \$644, fue reconocido en un rubro denominado prima en emisión de acciones, y que respecto de esta partida, los accionistas de SECOSA no tendrán derecho preferencial, ya que todos los accionistas de la Sociedad, participan de ese importe en proporción a sus respectivos porcentajes de participación.

## 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 y aprueba periódicamente los objetivos, lineamientos y políticas de administración de riesgos del Banco, 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 equipos expertos por tipo de riesgo, lo anterior para garantizar una gestión adecuada 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 de diciembre de 2023 fue de \$17.49 millones y su promedio durante el cuarto trimestre de 2023 fue de \$17 millones mismo que corresponde a un 0.022% del capital neto (\$77,657 millones a noviembre 2023, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del cuarto trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre Diciembre 2023	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	1,202,701	1,168,131
Mercado de Dinero	60,249	59,047
Tipo de cambio		
Cash	4,937	4,103
Derivados	157,929	129,534
Capitales		
Derivados	9,874	9,480

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre Diciembre 2023	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	12.89	14.99
Tipo de cambio	6.83	9.15
Capitales	-	-
<b>VaR Global</b>	<b>17.49</b>	<b>17.00</b>

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 2023 muestra una pérdida máxima de \$184.43 millones. 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 2023, 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 periódica<sup>1</sup> 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 nominales, 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.

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de diciembre 2023 así como el promedio del cuarto trimestre de 2023 se muestran a continuación:

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>2</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US)	79,214	73,018
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	121,786	117,275

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.

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

<sup>2</sup>Cifras previas al cierre del cuarto trimestre 2023.

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el cuarto trimestre de 2023 de 149% y 107% respectivamente.

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 un análisis histórico para estimar una tasa de prepago aplicable al portafolio de créditos.

Tanto la sensibilidad del valor económico como de la sensibilidad de margen contemplan un impacto de  $\pm 100$  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.

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de diciembre 2023 y en promedio para el cuarto trimestre de 2023 es la siguiente:

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Valor Económico (+100 pbs)	(1,540)	(1,439)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(215)	(313)

Los Instrumentos financieros para cobrar o vender 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.

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender <sup>1)</sup>	102,024	97,369
Derivados de Cobertura	85,597	87,406

<sup>1)</sup>. 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 2023 y el promedio del cuarto trimestre del 2023 fueron \$3,129 millones y \$3,097 millones, 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.

La facultad para la autorización de créditos es responsabilidad del Consejo de Administración, quien delega esta función en los distintos niveles de resolución. Estos niveles de resolución funcionan mediante facultades mancomunadas con lo cual no se permite que un solo funcionario autorice un crédito, es decir, al menos dos funcionarios deben autorizar un crédito. Los niveles de autorización se asignan de acuerdo con la clasificación del riesgo, monto del crédito, tipo de cliente y/o naturaleza de la Presentación de Crédito (tales como crédito nuevo, incremento del crédito o revisión anual).

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.

En 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, A.M. Best y DBRS, 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.

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del cuarto trimestre corresponde a \$20 millones; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.

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.

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

Al cierre del cuarto trimestre de 2023, el Banco mantiene \$384 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

## 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.

<b>Métricas Riesgo de Crédito<sup>1)</sup></b> <b>(Cifras al 31 de diciembre 2023)</b>	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.31%	3.02%
Consumo	3.82%	15.84%
Cartera Comercial	0.56%	4.13%
<b>Total</b>	<b>0.69%</b>	<b>4.50%</b>

1). Excluye cartera en etapa de riesgo 3.y/o en incumplimiento El cálculo incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos inter-compañía.

<b>Parámetros de Riesgo<sup>1)</sup></b> <b>(Cifras a millones al 31 de diciembre 2023)</b>	E <sup>2)</sup>	PI	SP
Hipotecas	213,480	1.65%	17.06%
Consumo	54,990	4.75%	72.19%
Cartera Comercial	288,594	1.47%	44.07%

1). El (Exposición al Incumplimiento) calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en etapa de riesgo 3 o 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 2023.

## 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 2023 y en promedio durante el cuarto trimestre de 2023, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.42% y 0.36% 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 políticas y una evaluación 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 con la metodología aprobada por el Comité de Riesgos.

Es importante 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.

## Cálculo del requerimiento de capital por Riesgo Operacional

La Institución calcula su requerimiento de capital por riesgo operacional a través del Método del Indicador de Negocio, mismo que entró en vigor en enero 2023.

## Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de octubre - diciembre 2023, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$66.1 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de diciembre 2023 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$45.2 millones, donde \$3.5 millones corresponden al Riesgo Operacional y \$41.7 millones al Riesgo Legal, donde las contingencias cuentan 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: octubre 2023 – diciembre 2023 (T4 2023)**  
**Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez<sup>3</sup>**

	(Cifras en millones de pesos)	Calculo Individual T4 2023		Calculo Consolidado T4 2023	
		Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
<b>ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES</b>					
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	124,253.74	No aplica	124,253.74
<b>SALIDAS DE EFECTIVO</b>					
2	Financiamiento minorista no garantizado	166,420.65	13,390.89	166,420.65	13,390.89
3	Financiamiento estable	98,427.23	6,591.54	98,427.23	6,591.54
4	Financiamiento menos estable	67,993.42	6,799.34	67,993.42	6,799.34
5	Financiamiento mayorista no garantizado	264,979.77	96,865.03	264,979.77	96,865.03
6	Depósitos operacionales	127,099.64	31,011.06	127,099.64	31,011.06
7	Depósitos no operacionales	133,153.72	61,127.55	133,153.72	61,127.55
8	Deuda no garantizada	4,726.423253	4,726.423253	4,726.423253	4,726.423253
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	500.001	No aplica	500.001
10	Requerimientos adicionales:	234,019.41	16,861.04	234,019.41	16,861.04
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,066.35	5,395.23	7,066.35	5,395.23
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-	-	-
13	Líneas de crédito y liquidez	226,953.06	11,465.81	226,953.06	11,465.81
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	229.6504945	229.6504945	229.6504945	229.6504945
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,857.48	2,857.48	2,857.48	2,857.48
16	<b>TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	130,704.08	No aplica	130,704.08
<b>ENTRADAS DE EFECTIVO</b>					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	4,013.49	347.0314835	4,013.49	347.0314835
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	46,259.66	29,895.81	46,259.66	29,895.81
19	Otras entradas de efectivo	17,284.71	17,284.71	17,284.71	17,284.71
20	<b>TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO</b>	67,557.86	47,527.55	67,557.86	47,527.55
Importe ajustado					
21	<b>TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES</b>	No aplica	124,253.74	No aplica	124,253.74
22	<b>TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	83,176.53	No aplica	83,176.53
<b>23</b>	<b>COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ<sup>(1)</sup></b>	<b>No aplica</b>	<b>149.68</b>	<b>No aplica</b>	<b>149.68</b>

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

a) Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando.  
91 días naturales

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

### **Durante diciembre 2023, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):<sup>4</sup>**

#### Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$66,135 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$35,675 millones, 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 \$1,904 millones y \$3,129 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$11,286 millones.

#### Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$23,040 millones y por operaciones de call money de \$3,638 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$19,946 millones.

#### Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$122,779 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$77,238 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$34,743 millones 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 \$8,151 millones y \$2,646 millones en títulos de nivel 2.

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

**Promedio del tercer trimestre 2023: 154% – promedio del cuarto trimestre 2023: 149%** El coeficiente de cobertura de liquidez disminuyó 500 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$7,975 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN \$7,000 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de \$423 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en \$7,719 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en \$5,149, millones.

d) La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables<sup>5</sup>;

<sup>4</sup> 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.

<sup>5</sup> Activos líquidos computables bajo los lineamientos establecidos por Banco de México.

<b>Evolución de Activos Líquidos T4-2023</b>	Octubre	Noviembre	Diciembre
Efectivo	6%	7%	7%
Reservas en el Banco Central	38%	23%	28%
Nivel 1	54%	67%	63%
Nivel 2 <sup>a</sup>	2%	3%	2%
Nivel 2B	0%	0%	0%
<b>Total de Activos Líquidos Ponderados</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

<b>Concentración de fuentes de Financiamiento</b>	Octubre	Noviembre	Diciembre
<b>CAPTACION TRADICIONAL</b>			
Depósitos de exigibilidad inmediata	47%	50%	48%
Depósitos a plazo			
Del público en general	38%	35%	36%
Mercado de dinero	7%	7%	8%
Títulos de crédito emitidos	2%	2%	2%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	4%	5%	5%
De largo plazo	2%	1%	1%
<b>Total</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

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 con las políticas establecidas.

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

- 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.
- 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.
- Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
- 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.

<b>Exposición Potencial Futura (diciembre 2023)</b> <b>(Cifras en millones de pesos)</b>	
Con contrato de compensación	3,438
Sin contrato de compensación	10,044
Posibles llamadas de margen (diciembre 2023)	
Colateral en Tránsito	21
Downgrade (diciembre 2023)	
Baja calificación 3 niveles	3,129

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de diciembre 2023 es la siguiente:

<b>Scotiabank-Exposición en Derivados</b> <b>(cifras en millones de pesos)</b>	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	1,202,701
Tipo de cambio	157,621
Capitales	9,874
<b>Total</b>	<b>1,370,195</b>

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.

- j) El impacto en el Coeficiente de la incorporación de las Entidades Objeto de Consolidación, así como de las salidas derivadas del apoyo financiero a entidades y sociedades que formen parte del mismo grupo financiero, consorcio o grupo empresarial que, de acuerdo con las Políticas y Criterios, el consejo de administración de la Institución haya autorizado otorgar.

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el cuarto trimestre del 2023, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -5% al cierre de diciembre del 2023 y en promedio durante cuarto trimestre del 2023 fue de -5%.

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 <sup>6</sup>	Límite MM
Concepto	
Concentración de Depósitos (MXN)	9,500 MXN
Concentración de Depósitos (USD)	175 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.

<sup>6</sup> Sujeto a excepciones para algunos nombres.

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) La exposición al riesgo liquidez y las necesidades de financiamiento a nivel de la Institución, teniendo en cuenta las limitaciones legales, regulatorias y operacionales a la transferibilidad de liquidez.

Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con las siguientes exposiciones a finales de diciembre 2023.

Descripción <sup>7</sup>	Promedio T4 2023	Septiembre 2023
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	39,657	36,881
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	119,542	134,722
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	40	42
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	39	40
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	41	42
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	40	40

- c) 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 2023 y el promedio del cuarto trimestre de 2023 son:

Scotiabank <sup>8</sup>	Posición (Cierre) <sup>9</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	79,214	73,018
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	121,786	117,275

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.

<sup>7</sup> Sujeto a excepciones para algunos nombres.

<sup>8</sup> Sujeto a excepciones para algunos nombres.

<sup>9</sup> Cifras previas al cierre de diciembre 2023.

## 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 con 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:

- Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
- Apegarse a los sistemas de alertas tempranos, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.
- Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.
- 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.
- Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.
- 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 2023, 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 2023, 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 100 por ciento).

## Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)

Periodo Reportado: cuarto trimestre del 2023

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto<sup>10</sup>

(Cifras en millones de pesos)	Cifras Individuales					Cifras Consolidadas					
	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	
	Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		
<b>ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE</b>											
1	Capital:	81,249.57	0.00	0.00	0.00	81,249.57	81,249.57	0.00	0.00	0.00	81,249.57
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	81,249.57	0.00	0.00	0.00	81,249.57	81,249.57	0.00	0.00	0.00	81,249.57
3	Otros instrumentos de capital.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
4	Depósitos minoristas:	0.00	204,816.41	1,395.49	33.53	190,177.91	0.00	204,816.41	1,395.49	33.53	190,177.91
5	Depósitos estables.	0.00	90,437.99	635.41	21.33	86,541.06	0.00	90,437.99	635.41	21.33	86,541.06
6	Depósitos menos estables.	0.00	114,378.43	760.08	12.20	103,636.85	0.00	114,378.43	760.08	12.20	103,636.85
7	Financiamiento mayorista:	0.00	393,494.93	27,048.45	17,126.65	165,347.55	0.00	393,494.93	27,048.45	17,126.65	165,347.55
8	Depósitos operacionales.	0.00	33,139.72	0.00	0.00	16,569.86	0.00	33,139.72	0.00	0.00	16,569.86
9	Otro financiamiento mayorista.	0.00	360,355.21	27,048.45	17,126.65	148,777.69	0.00	360,355.21	27,048.45	17,126.65	148,777.69
10	Pasivos interdependientes	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11	Otros pasivos:	0.00	38,730.42	701.25	5,229.77	5,580.40	0.00	38,730.42	701.25	5,229.77	5,580.40
12	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
13	Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	0.00	38,730.42	701.25	5,229.77	5,580.40	0.00	38,730.42	701.25	5,229.77	5,580.40
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	81,249.57	637,041.76	29,145.18	22,389.95	442,355.43	81,249.57	637,041.76	29,145.18	22,389.95	442,355.43
<b>ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO</b>											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	7,785.54	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	7,785.54
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
17	Préstamos al corriente y valores:	0.00	126,800.78	39,630.46	321,987.84	354,346.36	0.00	126,800.78	39,630.46	321,987.84	354,346.36
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	5,293.05	0.00	0.00	529.30	0.00	5,293.05	0.00	0.00	529.30
19	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	14,673.72	3,811.52	5,070.90	9,177.72	0.00	14,673.72	3,811.52	5,070.90	9,177.72
20	Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	86,804.64	32,553.80	134,159.52	167,067.95	0.00	86,804.64	32,553.80	134,159.52	167,067.95
21	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
22	Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:	0.00	3,551.39	3,776.61	209,243.64	167,429.25	0.00	3,551.39	3,776.61	209,243.64	167,429.25
23	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	480.94	511.47	28,442.31	18,983.70	0.00	480.94	511.47	28,442.31	18,983.70

<sup>10</sup> Anexo 10 de las disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple. Cifras Previas.

24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	16,958.92	0.00	1,956.08	10,142.13	0.00	16,958.92	0.00	1,956.08	10,142.13
25	Activos interdependientes.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
26	Otros Activos:	0.00	48,770.21	2,450.81	4,431.57	39,891.80	0.00	48,770.21	2,450.81	4,431.57	39,891.80
27	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00
28	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	No Aplica	1,735.01	0.00	0.00	1,474.76	No Aplica	1,735.01	0.00	0.00	1,474.76
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,211.36	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,211.36
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,860.36	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,860.36
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		47,035.20	2,450.81	4,431.57	32,345.32	0.00	47,035.20	2,450.81	4,431.57	32,345.32
32	Operaciones fuera de balance.	No Aplica	226,487.98	0.00	0.00	11,324.40	No Aplica	226,487.98	0.00	0.00	11,324.40
33	Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	413,348.10	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	413,348.10
34	<b>Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>107.02</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>107.02</b>

- a) Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto y la evolución de sus principales componentes.

### Durante diciembre 2023, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:

- Fondeo Estable Disponible:  
Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$183,374 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$137,188 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$85,518 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$14,552 millones y \$15,275 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$7,631 millones.
- Fondeo Estable Requerido:  
Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$353,581 millones y por operaciones mercado de dinero de \$21,130 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$14,036 millones, deducciones de capital por \$10,610 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$6,470 millones.

- b) Los cambios de las principales componentes dentro del trimestre que se reporte.

### Promedio del tercer trimestre del 2023: 109.03% – Promedio del cuarto trimestre del 2023: 107.02%

El coeficiente de financiamiento neto disminuyó 201pb respecto al tercer trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

- El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 6,408 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 3,556 millones.
- El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas incrementaron \$10,768 millones.
- La evolución de la composición del Monto de Financiamiento Estable Disponible y del Monto de Financiamiento Estable Requerido.

<b>Monto Computable (MXN MM)</b>	Octubre	Noviembre	Diciembre
Financiamiento Estable Disponible	441,223	437,609	445,735
Financiamiento Estable Requerido	406,439	416,047	417,559
<b>Coeficiente de Fondeo Estable Neto</b>	<b>108.56%</b>	<b>105.18%</b>	<b>106.75%</b>

d) El impacto en el Coeficiente de Financiamiento Estable Neto de la incorporación de las entidades objeto de consolidación. Las entidades objeto de consolidación de acuerdo con las reglas contables, y con aprobación del consejo de administración son las siguientes:

- Inmobiliaria Scotia Inverlat, S.A. de C.V.
- Scotia Servicios de Apoyo, S.A. de C.V.
- Scotia Inverlat Derivados

Derivado a que sus actividades son limitadas ya sea a posiciones de clientes, o un volumen reducido, el impacto en el CFEN es menor al 1%.

## Posiciones en Acciones

Al cierre de diciembre de 2023 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$15.56 millones de pesos, con una minusvalía de \$(0.11) millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	220,000	2.78	2.63	0.15
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	3,232	0.37	0.38	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	1,100	2.05	2.08	(0.03)
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	5,900	4.07	4.24	(0.17)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	300,000	4.72	4.77	(0.05)
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	1,200	1.57	1.57	-
<b>Total</b>			<b>531,432.00</b>	<b>15.56</b>	<b>15.67</b>	<b>(0.11)</b>

Al cierre del cuarto trimestre del año 2023, se reflejó una pérdida acumulada proveniente de las ventas por \$0.30 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	188,524	-	(0.04)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	500	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	35,016	0.01	(0.02)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	3,532	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	175	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	337,300	-	(0.46)	(0.46)
Scotiabank	Pública	1-GAP-B	6,000	0.13	-	0.13
Scotiabank	Pública	1-OMA-B	2,500	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	341,835	-	(1.32)	(1.32)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	508,387	0.09	(0.03)	0.06
Scotiabank	Pública	1B-NAFTRAC- ISHRS	236,000	0.13	-	0.13
Scotiabank	Pública	1A-BAC-*	495	-	-	-
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	117	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	4,503	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	3,500	0.49	-	0.49
Scotiabank	Pública	1I-MCHI-*	2,010	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	22,357	0.17	-	0.17
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	267,064	-	(0.03)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	5,265	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	12,094	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	2,118	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	161,631	0.03	(0.02)	0.01
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	98,337	-	(0.15)	(0.15)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	87,334	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-AMX-B	120,000	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1A-BABA-N	203	-	-	-
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	19	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	3,005	0.02	(0.01)	0.01
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	100	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	2,216	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	1,100	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	CF-FIBRAPL-14	1,065	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	649	-	-	-

Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	30,000	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	90,069	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	21,212	0.01	(0.03)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	47,000	0.32	-	0.32
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	20,000	0.27	-	0.27
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	25,597	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1-GFNORTE-O	20,000	0.11	-	0.11
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	80,000	-	(0.08)	(0.08)
Scotiabank	Pública	1-CUERVO-*	5,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1A-BABA-N	626	-	(0.05)	(0.05)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	1,200	-	(0.04)	(0.04)
Scotiabank	Pública	CF-FIBRAPL-14	24,000	0.02	-	0.02
<b>Total</b>			<b>2,819,655</b>	<b>2.04</b>	<b>(2.34)</b>	<b>(0.30)</b>

La posición accionaria de títulos por cobrar o vender 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	BLADDEX COM	8,095	-	-	-
<b>Total</b>			<b>9,317</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

Al 31 de diciembre de 2023, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$4.78 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$ 3.52 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.27 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición	Coefficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado	15.82	-	15.82	22.23%	3.52
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	15.82	-	15.82	8.00%	1.26
Índices accionarios	-	-	-	4.00%	0.01
Requerimiento por riesgos específico	-	-	-	4.00%	0.01
<b>Total Requerimiento de capital</b>					<b>4.78</b>

**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-23	dic-23
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)	755,925	789,130
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,521)	(10,610)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	745,404	778,520
Exposiciones a instrumentos financieros derivados			
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	9,981	6,359
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	4,913	5,352
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)	(2,479)	(2,626)
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 notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos		
10	(Compensaciones realizadas al notional 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)	12,415	9,085
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	2,690	8,004
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(2,690)	(998)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	4	11
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)	4	7,017
Otras exposiciones fuera de balance			
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	257,626	258,234
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(183,567)	(185,583)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	74,059	72,651
Capital y exposiciones totales			
20	Capital de Nivel 1	74,087	71,660
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	831,882	867,273
Coeficiente de apalancamiento			
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	8.91%	8.26%

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

Referencia	DESCRIPCION	sep-23	dic-23
1	Activos totales	807,087	839,876
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	(548)	(574)
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	(36,056)	(33,657)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(2,686)	(987)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	74,059	72,651
7	Otros ajustes	(9,973)	(10,036)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	831,882	867,273

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

Referencia	DESCRIPCION	sep-23	dic-23
1	Activos totales	807,087	839,876
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(48,472)	(42,742)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(2,690)	(8,004)
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	755,925	789,130

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

CONCEPTO/PERIODO	sep-23	dic-23	Variación
Capital Básico <sup>1)</sup>	74,087	71,660	(2,426)
Activos Ajustados <sup>2)</sup>	831,882	867,273	35,391
Razón de Apalancamiento <sup>3)</sup>	8.91%	8.26%	-65 pb

1). Reportado en la fila 20

2). Reportado en la fila 21 y

3). Reportado en la fila 22, de la Tabla I.1

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 2023.

El indicador se ubicó en 8.26%, 65pb menor al trimestre anterior, debido al incremento en los activos ajustados por \$35,391MM o 36pb; principalmente por las exposiciones dentro del balance netas y a una disminución del capital nivel 1 por \$2,426MM o 29pb, debido principalmente a la provisión de dividendos; compensada parcialmente por 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 remplazo (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) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><b>a)</b> 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.</li> <li><b>b)</b> La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.</li> <li><b>c)</b> El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.</li> <li><b>d)</b> 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.</li> <li><b>e)</b> 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.</li> </ul> <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	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.
	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.
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7	Monto de márgenes de variación en efectivo entregados 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.
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)
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> <ul style="list-style-type: none"> <li><b>a)</b> Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.</li> <li><b>b)</b> Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.</li> <li><b>c)</b> 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.</li> <li><b>d)</b> 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.</li> </ul> <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	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. 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.
16	Suma de las líneas 12 a 15
17	Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.
18	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%. El monto se debe registrar con signo negativo.
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	Explicación
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.
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	Importe
23 de abril de 2013	\$ 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.

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de octubre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de \$2,400'000,000.00 (Dos mil cuatrocientos millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.254768944692 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientas veinte millones trescientas mil cuatrocientos treinta y tres) 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".

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de diciembre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de \$2,000'000,000.00 (Dos mil millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.212307453910 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientos veinte millones trescientos mil cuatrocientos treinta y tres) 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 "Resultado de Ejercicios Anteriores".

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 8 de febrero del 2023, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de \$2,850,000,000.00 (Dos mil ochocientos cincuenta millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.302538121822 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientos veinte millones trescientos mil cuatrocientos treinta y tres) 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 "Resultado de Ejercicios Anteriores".

El 31 de mayo de 2023, la Asamblea General Ordinaria de Accionistas acordó decretar dividendos provenientes de utilidades retenidas por la cantidad de \$5,000 a razón de \$0.530768634776 por acción, mismos que fueron provisionados y registrados en el rubro de "Acreedores diversos y cuentas por pagar" y fueron pagados el 26 de enero 2024.

## Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de diciembre del 2023, 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\$99,112 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$50,552 millones de pesos.

Adicionalmente:

- Se cuenta con líneas comprometidas con Instituciones Extranjeras por USD \$250 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 2023, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.

# Instrumentos Financieros Derivados

# 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 con 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 Riesgos 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.

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 la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura", en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las 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 o Bonos 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)
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)

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, 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 nominales, 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 (Swaps) en especie y por diferenciales.	✓	✓				

- 1). Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (CurrencySwaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (ForwardStarting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.
- 2). (MR) Mercados reconocidos
- 3). (ME) Mercados extrabursátiles

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.

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 Algorithmics 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 2023 y en promedio para el cuarto trimestre de 2023 es de:

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>11</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	79,214	73,018
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	121,786	117,275

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

<sup>11</sup> Cifras previas al cierre de diciembre 2023.

## 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/Peak & Wall Street).

### Instrumentos valuados a valor razonable

Product Name	Underlying	Product Currency	Valuation Model	Valuation Input	Daily Pricing Source
Cross Currency Interest Rate Swap	(All Interest Rate)	MXN,CAD,USD, EUR,JPY,GBP	Swap	Interest Rate Curve	VALMER
				FX Rate	VALMER
Interest Rate Swap	(All Interest Rate)	MXN,CAD,USD, EUR,JPY,GBP	Swap	Interest Rate Curve	VALMER
Interest Rate Cap/Floor	(All Interest Rate)	MXN,USD	Cap/Floor Black's	Interest Rate Curve	VALMER
				Surface	Bloomberg/Reuters
OTC Binary Interest rate Option	(All Interest Rate)	MXN,USD	Cap/Floor Black's	Interest Rate Curve	VALMER
				Surface	Bloomberg/Reuters
IRS Futures	TIIE Fondo	MXN	Price	Price	VALMER
Listed Interest Rate Swap (CME)	TIIE Fondo	MXN	Swap	Interest Rate Curve	VALMER
OTC European Index Call Spread Option	OTC European Index Call Spread Option	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Call Spread Option	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
Dividend					
OTC European Basket Option	Equity Index, Common Stock	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Basket Asian AN/Alytic Multi-Factor	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
Dividend					
OTC European Equity Option	Common Stock, Equity Index, ETF and Bond Index whith Target Volatility (Vol Under 15%)	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Equity Option	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
Dividend					
OTC Index Binary Equity Option	Common Stock, Equity Index, ETF	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Equity Option	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
Dividend					

Product Name	Underlying	Product Currency	Valuation Model	Valuation Input	Daily Pricing Source
OTC Single Stock Autocallable Option	Common Stock, Equity Index, ETF	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	EqOpt Autocallable Note	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
				Dividend	
Bond Futures	(All Interest Rate)	MXN	Price	OPICS	VALMER
Equity Index Future	Equity Index	MXN	Price	OPICS	VALMER
Equity Future	Equity Stock	MXN	Price	OPICS	VALMER
Interest Rate Future	(All Interest Rate)	MXN	Price	OPICS	VALMER
Listed Equity Index Future Option	Equity Index	MXN	Price	OPICS	VALMER
Listed Single Stock Option	Common Stock	MXN	Price	OPICS	VALMER
FX Futures	FX Spot	USD,BRL,CLP,COP, MXN,PEN,AUD,EUR, JPY,GBP,CHF,CAD	Price	OPICS	VALMER
OTC Foreign Exchange (FX) American Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Cox, Ross and Rubinstein	Curve	VALMER
				FX Rate	
				Surface	
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Merton, Reiner and Rubinstein	Curve	VALMER
				FX Rate	
				Surface	
OTC Foreign Exchange (FX) European Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Garman and Kohlhagen	Curve	VALMER
				FX Rate	
				Surface	
OTC FX Binary Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Black-Scholes	Curve	VALMER
				FX Rate	
				Surface	
Precious Metals European Option	Gold/Silver Bullion	Gold/Silver	Black 76	Curve	VALMER
				Price	
				Surface	
Precious Metals Forward	Gold/Silver Bullion	Gold/Silver	Forward OTC Model	Curve	VALMER
				Price	
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery Forward	FX Spot	MXN,USD,CAD,EUR, BRL,CLP,COP,PEN, AUD,JPY,GBP,CHF	Forex	Curve	VALMER
				FX Rate	

## Instrumentos valuados a costo

Product Name	Underlying	Product Currency	Valuation Model	Valuation Input	Daily Pricing Source
Listed Structured Notes	Common Stock	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Price	Price	VALMER

## 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.

## **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 reprecación 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 TIE.

### 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.

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 con base en un análisis de regresión.

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 del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

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

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 el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de diciembre 2023 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el cuarto trimestre de 2023 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 actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

### Cobertura de Flujos de efectivo:

La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de "Otro Resultado Integral" (ORI) y cualquier ganancia o pérdida remanente debe tratarse como ineffectividad de cobertura y reconocerse de inmediato en la utilidad o pérdida neta.

El componente que forma parte de "Otro Resultado 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 valuar 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 valuar 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 en los 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 cubiertos 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 2023 y promedio del cuarto trimestre 2023 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>12</sup>	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	121,786	117,275

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:

$$SD = \sum_{i=1}^n SD_i$$
$$SD_i = (T_{ii} - T_{ij})$$

<sup>12</sup> Cifras previas al cierre de diciembre 2023.

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

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

En donde:

Parámetro	Descripción
<i>SD</i>	Salida de efectivo por derivados.
<i>T<sub>ii</sub></i>	Umbral con la Contraparte i en el estado i
<i>T<sub>ij</sub></i>	Umbral con la Contraparte i en el estado j
<i>MTM</i>	Mark to Market

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	79,214	76,084	76,082	76,080
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(3,130)	(3,132)	(3,134)

#### d. 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 Black & Scholes.

#### 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 portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que gamma5 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio 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 portafolio 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 portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

## **Rho**

Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio 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 portafolio 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 portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.

## **Theta**

Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio 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, 2023:

<b>Scotiabank</b>	0 - 3 Años	3 - 5 Años	5 - 10 Años	10 - 30 Años	Total
Swaps	(54,553.88)	4,533.34	(4,476.53)	(1,289.01)	(55,786.08)
CCS	13,447.78	71.44	(131.67)	0.05	13,387.60
Caps&Floors	(0.03)	-	-	-	(0.03)
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-
<b>Total DERIVADOS</b>	<b>(41,106.13)</b>	<b>4,604.78</b>	<b>(4,608.20)</b>	<b>(1,288.96)</b>	<b>(42,398.51)</b>

1). Cifras expresadas en pesos

### Análisis de sensibilidad

#### Supuestos de Cálculo.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, 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:

- a) Bajo el escenario probable una pérdida de (34.36) Millones de pesos.
- b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (68.72) Millones de pesos.
- c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (169.69) Millones de pesos.

Los escenarios de stress 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.

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	(0.04)	(49.43)	50.00	(2.12)	100.00	(4.24)	200.00	(8.48)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	(0.03)	(0.59)	0.10	-	0.40	(0.01)	1.00	(0.03)
a FX %	Forwards	17.93	322.36	0.10	(32.24)	0.20	(64.47)	0.50	(161.18)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
<b>Total</b>					<b>(34.36)</b>		<b>(68.72)</b>		<b>(169.69)</b>

## 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 2023 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	457,120.00	11,582.00	117,965.00
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	1,635.00	64.00	364.00
Options META.OQ	-	-	-
Options MEXIPC.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>458,755.00</b>	<b>11,646.00</b>	<b>118,329.00</b>

1). Cifras expresadas en pesos

## Análisis de Stress

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

<b>Escenarios a la baja</b>	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options BNPIU5.INDX	(45,712.00)	(137,136.00)	(228,560.00)
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	(163.5)	(490.5)	(817.5)
Options META.OQ	-	-	-
Options MEXIPC.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>(45,875.50)</b>	<b>(137,626.50)</b>	<b>(229,377.50)</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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

<b>Escenarios al alza</b>	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	22,856.00	68,568.00	91,424.00
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	81.75	245.25	327.00
Options META.OQ	-	-	-
Options MEXIPC.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>22,937.75</b>	<b>68,813.25</b>	<b>91,751.00</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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:

<b>Scotiabank</b>	Monto
Probable	(45,875.50)
Poco Probable	(137,626.50)
Muy poco Probable	(229,377.50)

1). Cifras expresadas en pesos

## 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 2023 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	USD	-	(1,070,000)
CLIENTE 2	MXN	375,000,000	(639,000,000)
CLIENTE 3	USD	595,000	-
CLIENTE 4	USD	5,830,000	-
CLIENTE 5	MXN	43,905,000	(126,340,000)
CLIENTE 6	MXN	10,700,000	(23,300,000)
CLIENTE 7	USD	10,625,000	(16,500,000)
CLIENTE 8	MXN	145,503,132	(2,254,357,869)
CLIENTE 9	USD	29,940,000	(41,210,000)
CLIENTE 10	USD	35,760,000	(24,570,000)
CLIENTE 11	USD	130,900,000	(830,000,000)
CLIENTE 12	USD	280,000	-
CLIENTE 13	USD	17,790,000	(3,840,000)
CLIENTE 14	USD	23,650,000	(35,560,000)
CLIENTE 15	USD	-	(250,000)
CLIENTE 16	MXN	74,000,000	(222,400,000)
CLIENTE 17	MXN	121,400,000	(350,000,000)
CLIENTE 18	USD	91,100,000	(52,940,000)
CLIENTE 19	MXN	214,900,000	(419,500,000)
CLIENTE 20	MXN	565,567,142	(366,930,007)
CLIENTE 21	MXN	1,200,000	-
CLIENTE 22	USD	5,110,000	(11,420,000)
CLIENTE 23	MXN	18,000,000	-
CLIENTE 24	USD	8,280,000	(12,230,000)
CLIENTE 25	USD	-	(2,180,000)
CLIENTE 26	MXN	-	(35,566,000)
CLIENTE 27	USD	1,990,000	(510,000)
CLIENTE 28	USD	21,990,000	(9,010,000)
<b>TOTAL</b>		<b>1,954,015,274</b>	<b>(5,478,683,876)</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
C74745	14/12/2023	Active		usd/mxn	214,465,512	4,446,770,828	
C74746	14/12/2023	Active		mxn/usd	4,446,770,828	214,465,512	
C84064	15/12/2023	Active		usd/mxn	200,000,000	3,944,000,000	
C84182	15/12/2023	Active		mxn/usd	3,944,000,000	200,000,000	
C84183	15/12/2023	Active		usd/mxn	200,000,000	3,944,000,000	
C84907	15/12/2023	Active		mxn/usd	3,944,000,000	200,000,000	
C89369	21/11/2023	Active		usd/mxn	100,000,000	1,738,000,000	
C89370	21/11/2023	Active		mxn/usd	1,738,000,000	100,000,000	
C89638	31/10/2023	Active		mxn/usd	1,369,600,000	80,000,000	
C89639	31/10/2023	Active		usd/mxn	80,000,000	1,369,600,000	
C89780	16/10/2023	Active		usd/mxn	250,000,000	4,432,500,000	
C89781	16/10/2023	Active		mxn/usd	4,432,500,000	250,000,000	
C90097	06/11/2023	Active		usd/mxn	250,000,000	4,491,250,000	
C90098	06/11/2023	Active		mxn/usd	4,491,250,000	250,000,000	
C90136	30/11/2023	Active		mxn/usd	804,600,000	45,000,000	
C90137	30/11/2023	Active		usd/mxn	45,000,000	804,600,000	
C90490	21/12/2023	Active		usd/mxn	250,000,000	4,352,500,000	
C90491	21/12/2023	Active		mxn/usd	4,352,500,000	250,000,000	
C90640	30/11/2023	Active		usd/mxn	30,000,000	528,450,000	
C90641	30/11/2023	Active		mxn/usd	528,450,000	30,000,000	
C90642	29/12/2023	Active		usd/mxn	100,000,000	1,761,500,000	
C90643	29/12/2023	Active		mxn/usd	1,761,500,000	100,000,000	
C90740	30/11/2023	Active		mxn/usd	432,000,000	25,000,000	
C90741	30/11/2023	Active		usd/mxn	25,000,000	432,000,000	
C90743	28/11/2023	Active		mxn/usd	1,738,542,448	100,785,069	
C90745	28/11/2023	Active		usd/mxn	100,785,069	1,738,542,448	
C90917	06/12/2023	Active		mxn/usd	1,730,812,397	100,863,193	
C90918	06/12/2023	Active		usd/mxn	100,863,193	1,730,812,397	
C90951	29/12/2023	Active		mxn/usd	1,489,440,000	87,000,000	
C90952	29/12/2023	Active		usd/mxn	87,000,000	1,489,440,000	
C91072	28/12/2023	Active		usd/mxn	200,000,000	3,455,000,000	
C91082	28/12/2023	Active		mxn/usd	3,455,000,000	200,000,000	
E81354	08/11/2023	Active		mxn			57,150,000
E81410	08/11/2023	Active		mxn			57,150,000
MNF308	23/11/2023	Active		mxn		100,000,000	
MNF456	13/10/2023	Active		usd		10,000,000	
MNL820	24/11/2023	Active		mxn		500,000,000	
MWG752	27/10/2023	Active		mxn		225,000,000	
MXI671	20/11/2023	Active		mxn		101,915,686	
MXK215	25/10/2023	Active		mxn		250,000,000	
MYX297	15/12/2023	Active		usd		200,000,000	
P16936	29/12/2023	Active		mxn			119,000,000
P16937	29/12/2023	Active		mxn			119,000,000
P16938	29/12/2023	Active		mxn			59,000,000
P16939	29/12/2023	Active		mxn			59,000,000
P16990	29/12/2023	Active		mxn			41,000,000
P16991	29/12/2023	Active		mxn			41,000,000
P16992	29/12/2023	Active		mxn			91,000,000
P16993	29/12/2023	Active		mxn			91,000,000

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
P16994	25/10/2023	Active		mxn			6,484,323
P16995	25/10/2023	Active		mxn			6,484,323
P17024	22/12/2023	Active		mxn			2,497,698,288
P17033	25/10/2023	Active		mxn			3,916,191
P17034	25/10/2023	Active		mxn			3,916,191
P17046	28/12/2023	Active		mxn			600,000,000
P17047	28/12/2023	Active		mxn			600,000,000
P17063	16/10/2023	Active		mxn			500,000,000
P17064	16/10/2023	Active		mxn			500,000,000
P17096	10/10/2023	Active		mxn			300,000,000
P17097	10/10/2023	Active		mxn			300,000,000
P17238	23/10/2023	Active		mxn			10,000,000
P17523	19/10/2023	Active		mxn			300,000,000
P17524	19/10/2023	Active		mxn			300,000,000
P17535	08/11/2023	Active		mxn			35,000,000
P17536	08/11/2023	Active		mxn			35,000,000
P17795	02/10/2023	Active		mxn			17,249,780
P17798	02/10/2023	Active		mxn			17,249,780
P17885	30/11/2023	Active		mxn			29,362,253
P17886	30/11/2023	Active		mxn			29,362,253
P17921	30/11/2023	Active		mxn			490,720,416
P17922	30/11/2023	Active		mxn			490,720,416
P18009	30/11/2023	Active		mxn			16,084,956
P18010	30/11/2023	Active		mxn			16,084,956
P18028	01/12/2023	Active		mxn			18,000,000
P18091	23/10/2023	Active		mxn			10,000,000
P18094	22/12/2023	Active		mxn			2,497,698,288
P18138	01/12/2023	Active		mxn			18,000,000
P18396	03/10/2023	Active		mxn			70,000,000
P18397	03/10/2023	Active		mxn			70,000,000
P18398	03/10/2023	Active		mxn			70,000,000
P18399	03/10/2023	Active		mxn			70,000,000
P18409	31/10/2023	Active		mxn			250,000,000
P18410	31/10/2023	Active		mxn			250,000,000
P18746	15/12/2023	Active		usd			7,999,431
P18747	15/12/2023	Active		usd			7,999,431
P18839	15/12/2023	Active		usd			7,669,055
P18840	15/12/2023	Active		usd			7,669,055
P19023	10/12/2023	Active		usd			14,181,707
P19026	10/12/2023	Active		usd			14,181,707
P19063	10/12/2023	Active		usd			68,852,894
P19064	10/12/2023	Active		usd			68,852,894
SDQ863	05/11/2023	Active	13,200,000	usd	13,200,000	13,200,000	
SDR894	19/10/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SDR897	19/10/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SDR904	10/10/2023	Active	12,000,000	mxn	12,000,000	12,000,000	
SDR905	10/10/2023	Active	12,000,000	mxn	12,000,000	12,000,000	
SDR948	21/11/2023	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDR952	14/11/2023	Active	43,055,667	mxn	43,055,667	43,055,667	
SDR953	14/11/2023	Active	43,055,667	mxn	43,055,667	43,055,667	
SDS016	21/11/2023	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDS047	21/11/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SDS049	21/11/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SDS132	14/12/2023	Active	14,000,000	mxn	14,000,000	14,000,000	
SDS141	14/12/2023	Active	14,000,000	mxn	14,000,000	14,000,000	
SDS145	14/12/2023	Active	8,932,948	mxn	8,932,948	8,932,948	
SDS146	14/12/2023	Active	2,464,000	mxn	2,464,000	2,464,000	
SDS160	14/12/2023	Active	8,932,948	mxn	8,932,948	8,932,948	
SDS163	14/12/2023	Active	2,464,000	mxn	2,464,000	2,464,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDS195	25/10/2023	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SDS254	26/12/2023	Active	7,039,358	mxn	7,039,358	7,039,358	
SDS255	26/12/2023	Active	7,039,358	mxn	7,039,358	7,039,358	
SDS265	28/12/2023	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SDS274	28/12/2023	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SDS290	29/12/2023	Active	3,854,600	mxn	3,854,600	3,854,600	
SDS291	29/12/2023	Active	3,854,600	mxn	3,854,600	3,854,600	
SDS313	23/10/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDS326	23/10/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDS358	27/10/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDS368	21/12/2023	Active	175,917	usd	175,917	175,917	
SDS383	21/12/2023	Active	111,306	usd	111,306	111,306	
SDS386	21/12/2023	Active	84,625	usd	84,625	84,625	
SDS387	21/12/2023	Active	103,612	usd	103,612	103,612	
SDS388	29/12/2023	Active	3,145,000	mxn	3,145,000	3,145,000	
SDS392	21/12/2023	Active	83,794	usd	83,794	83,794	
SDS396	29/12/2023	Active	3,145,000	mxn	3,145,000	3,145,000	
SDS398	21/12/2023	Active	73,771	usd	73,771	73,771	
SDS400	21/12/2023	Active	135,166	usd	135,166	135,166	
SDS401	21/12/2023	Active	113,380	usd	113,380	113,380	
SDS405	21/12/2023	Active	49,915	usd	49,915	49,915	
SDS407	26/10/2023	Active	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDS411	26/10/2023	Active	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDS415	21/12/2023	Active	2,268,514	usd	2,268,514	2,268,514	
SDS424	21/12/2023	Active	2,268,514	usd	2,268,514	2,268,514	
SDS430	21/12/2023	Active	175,917	usd	175,917	175,917	
SDS434	01/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDS440	21/12/2023	Active	111,306	usd	111,306	111,306	
SDS445	21/12/2023	Active	84,625	usd	84,625	84,625	
SDS447	21/12/2023	Active	103,612	usd	103,612	103,612	
SDS448	21/12/2023	Active	83,794	usd	83,794	83,794	
SDS456	21/12/2023	Active	73,771	usd	73,771	73,771	
SDS458	21/12/2023	Active	135,166	usd	135,166	135,166	
SDS460	21/12/2023	Active	113,380	usd	113,380	113,380	
SDS463	21/12/2023	Active	49,915	usd	49,915	49,915	
SDS470	31/10/2023	Active	5,900,000	mxn	5,900,000	5,900,000	
SDS556	25/10/2023	Active	405,086	mxn	405,086	405,086	
SDS559	25/10/2023	Active	317,800	usd	317,800	317,800	
SDS580	31/10/2023	Active	5,900,000	mxn	5,900,000	5,900,000	
SDS591	30/11/2023	Active	1,285,556	mxn	1,285,556	1,285,556	
SDS594	25/10/2023	Active	317,800	usd	317,800	317,800	
SDS595	30/11/2023	Active	1,200,000	mxn	1,200,000	1,200,000	
SDS605	25/10/2023	Active	405,086	mxn	405,086	405,086	
SDS611	30/11/2023	Active	1,200,000	mxn	1,200,000	1,200,000	
SDS617	30/11/2023	Active	1,285,556	mxn	1,285,556	1,285,556	
SDS772	07/11/2023	Active	2,557,597	mxn	2,557,597	2,557,597	
SDS777	07/11/2023	Active	2,557,597	mxn	2,557,597	2,557,597	
SDS784	08/11/2023	Active	739,084	mxn	739,084	739,084	
SDS785	08/11/2023	Active	739,084	mxn	739,084	739,084	
SDS821	10/11/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDS841	20/11/2023	Active	101,915,686	mxn	101,915,686	101,915,686	
SDS847	10/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDS860	09/11/2023	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SDS865	10/11/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDS892	09/11/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDS967	20/11/2023	Active	25,000,000	mxn	25,000,000	25,000,000	
SDS970	20/11/2023	Active	25,000,000	mxn	25,000,000	25,000,000	
SDS982	21/11/2023	Active	856,148	mxn	856,148	856,148	
SDS987	21/11/2023	Active	856,148	mxn	856,148	856,148	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDT014	23/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT015	23/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT053	09/11/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDT057	31/10/2023	Active	8,300,000	mxn	8,300,000	8,300,000	
SDT061	31/10/2023	Active	8,300,000	mxn	8,300,000	8,300,000	
SDT101	23/11/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SDT120	23/11/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SDT195	10/10/2023	Active	12,840,829	mxn	12,840,829	12,840,829	
SDT202	10/10/2023	Active	12,840,829	mxn	12,840,829	12,840,829	
SDT215	21/11/2023	Active	10,468,499	mxn	10,468,499	10,468,499	
SDT219	21/11/2023	Active	10,468,499	mxn	10,468,499	10,468,499	
SDT224	10/11/2023	Active	17,458,650	mxn	17,458,650	17,458,650	
SDT238	06/12/2023	Active	28,564,000	mxn	28,564,000	28,564,000	
SDT258	10/11/2023	Active	17,458,650	mxn	17,458,650	17,458,650	
SDT260	06/12/2023	Active	28,564,000	mxn	28,564,000	28,564,000	
SDT355	06/12/2023	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000	
SDT391	30/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT455	13/10/2023	Active	10,000,000	usd	10,000,000	10,000,000	
SDT458	13/10/2023	Active	10,000,000	usd	10,000,000	10,000,000	
SDT484	10/11/2023	Active	26,435,027	mxn	26,435,027	26,435,027	
SDT485	04/12/2023	Active	37,999,500	mxn	37,999,500	37,999,500	
SDT488	04/12/2023	Active	37,999,500	mxn	37,999,500	37,999,500	
SDT504	13/12/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDT515	13/10/2023	Active	10,000,000	usd	10,000,000	10,000,000	
SDT521	10/11/2023	Active	26,435,027	mxn	26,435,027	26,435,027	
SDT540	20/12/2023	Active	555,000	usd	555,000	555,000	
SDT542	23/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT563	03/11/2023	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SDT567	20/12/2023	Active	555,000	usd	555,000	555,000	
SDT644	29/12/2023	Active	2,798,346	mxn	2,798,346	2,798,346	
SDT670	29/12/2023	Active	2,798,346	mxn	2,798,346	2,798,346	
SDT688	13/10/2023	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SDT708	14/12/2023	Active	12,217,774	mxn	12,217,774	12,217,774	
SDT716	17/10/2023	Active	313,000,000	mxn	313,000,000	313,000,000	
SDT728	14/12/2023	Active	12,217,774	mxn	12,217,774	12,217,774	
SDT731	27/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT774	18/10/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT797	31/12/2023	Active	523,636	mxn	523,636	523,636	
SDT809	16/10/2023	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000	
SDT843	18/10/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT874	31/12/2023	Active	523,636	mxn	523,636	523,636	
SDT936	31/12/2023	Active	2,783,850	usd	2,783,850	2,783,850	
SDT947	11/12/2023	Active	5,941,185	mxn	5,941,185	5,941,185	
SDT951	31/12/2023	Active	2,783,850	usd	2,783,850	2,783,850	
SDU024	11/12/2023	Active	5,941,185	mxn	5,941,185	5,941,185	
SDU345	02/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU394	02/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU402	29/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU465	06/11/2023	Active	100,000,000	usd	100,000,000	100,000,000	
SDU485	02/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU558	04/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU614	04/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU701	10/12/2023	Active	22,495,593	mxn	22,495,593	22,495,593	
SDU704	10/12/2023	Active	22,495,593	mxn	22,495,593	22,495,593	
SDU947	31/10/2023	Active	2,100,000	mxn	2,100,000	2,100,000	
SDU951	31/10/2023	Active	2,100,000	mxn	2,100,000	2,100,000	
SDU999	05/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV006	14/11/2023	Active	6,500,000	mxn	6,500,000	6,500,000	
SDV016	14/11/2023	Active	6,500,000	mxn	6,500,000	6,500,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDV045	05/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV125	07/11/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDV126	05/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV133	07/11/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDV204	05/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV262	10/12/2023	Active	12,815,210	mxn	12,815,210	12,815,210	
SDV267	10/12/2023	Active	12,815,210	mxn	12,815,210	12,815,210	
SDV378	09/10/2023	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SDV410	30/11/2023	Active	20,500,000	mxn	20,500,000	20,500,000	
SDV429	30/11/2023	Active	20,500,000	mxn	20,500,000	20,500,000	
SDV434	30/11/2023	Active	4,500,000	mxn	4,500,000	4,500,000	
SDV447	09/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV455	30/11/2023	Active	4,500,000	mxn	4,500,000	4,500,000	
SDV504	09/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV570	09/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV604	02/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV692	09/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV737	10/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV776	10/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV803	10/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV841	10/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV875	10/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV879	30/10/2023	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SDW015	29/12/2023	Active	119,000,000	mxn	119,000,000	119,000,000	
SDW016	12/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW077	29/12/2023	Active	59,000,000	mxn	59,000,000	59,000,000	
SDW079	18/10/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW107	18/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW146	11/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW194	19/10/2023	Active	170,000,000	mxn	170,000,000	170,000,000	
SDW217	23/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW261	23/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW296	23/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW313	23/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW365	24/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW420	25/10/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW475	21/11/2023	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SDW504	25/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW547	26/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW590	26/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW687	26/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW726	27/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW794	31/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW824	31/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW841	26/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW928	03/11/2023	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SDX033	15/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SDX062	29/12/2023	Active	91,000,000	mxn	91,000,000	91,000,000	
SDX072	29/12/2023	Active	41,000,000	mxn	41,000,000	41,000,000	
SDX094	08/10/2023	Active	25,000,000	mxn	25,000,000	25,000,000	
SDX098	08/10/2023	Active	25,000,000	mxn	25,000,000	25,000,000	
SDX104	24/11/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX115	24/11/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX143	11/12/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX297	26/10/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX803	24/11/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDX805	24/11/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDX863	24/11/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDY519	29/12/2023	Active	249,685,346	mxn	249,685,346	249,685,346	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDY730	29/12/2023	Active	249,685,346	mxn	249,685,346	249,685,346	
SEB264	10/11/2023	Active	10,057,313	mxn	10,057,313	10,057,313	
SEB278	10/11/2023	Active	10,057,313	mxn	10,057,313	10,057,313	
SEV434	06/10/2023	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SEV438	06/10/2023	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SEW250	13/10/2023	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SEW484	16/10/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SEW517	16/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SEX410	20/10/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SEX721	24/10/2023	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SEY075	26/10/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SEZ741	07/11/2023	Active	1,100,000,000	mxn	1,100,000,000	1,100,000,000	
SEZ980	08/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SFB386	20/11/2023	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SFB387	20/11/2023	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SFB816	26/11/2023	Active	15,000,000	usd	15,000,000	15,000,000	
SFB819	22/11/2023	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000	
SFB820	22/11/2023	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000	
SFC170	23/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SFC625	29/11/2023	Active	26,000,000	mxn	26,000,000	26,000,000	
SFD150	06/11/2023	Active	100,000,000	usd	100,000,000	100,000,000	
SFE436	08/12/2023	Active	15,000,000	usd	15,000,000	15,000,000	
SFE459	05/12/2023	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000	
SFE914	07/12/2023	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SFF079	08/12/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SFF081	08/12/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SFF716	13/12/2023	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SFR970	26/12/2023	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SFX196	29/12/2023	Active	3,023,448	mxn	3,023,448	3,023,448	
SFX226	29/12/2023	Active	3,023,448	mxn	3,023,448	3,023,448	
SGX319	05/12/2023	Active	477,971	mxn	477,971	477,971	
SGX323	05/12/2023	Active	477,971	mxn	477,971	477,971	
SHE807	27/10/2023	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SHE819	27/10/2023	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SHE824	27/10/2023	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SHF760	30/11/2023	Active	27,400,000	mxn	27,400,000	27,400,000	
SHF762	30/11/2023	Active	27,400,000	mxn	27,400,000	27,400,000	
SHL174	20/11/2023	Active	101,915,686	mxn	101,915,686	101,915,686	
SHL252	20/11/2023	Active	101,915,686	mxn	101,915,686	101,915,686	
SHL469	19/10/2023	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000	
SHL893	25/10/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHL917	25/10/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHL937	25/10/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHO494	14/11/2023	Active	1,030,000,000	mxn	1,030,000,000	1,030,000,000	
SHO568	14/11/2023	Active	405,000,000	mxn	405,000,000	405,000,000	
SHO570	14/11/2023	Active	610,000,000	mxn	610,000,000	610,000,000	
SHO823	16/11/2023	Active	340,000,000	mxn	340,000,000	340,000,000	
SHO824	16/11/2023	Active	340,000,000	mxn	340,000,000	340,000,000	
SHP114	16/11/2023	Active	1,015,000,000	mxn	1,015,000,000	1,015,000,000	
SHP116	16/11/2023	Active	405,000,000	mxn	405,000,000	405,000,000	
SHP119	16/11/2023	Active	610,000,000	mxn	610,000,000	610,000,000	
SHP680	23/11/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHP681	23/11/2023	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SHP682	23/11/2023	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SHQ290	29/11/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHQ491	29/11/2023	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SHQ891	01/12/2023	Active	1,420,000,000	mxn	1,420,000,000	1,420,000,000	
SHQ894	01/12/2023	Active	1,650,000,000	mxn	1,650,000,000	1,650,000,000	
SHQ896	01/12/2023	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SHQ897	01/12/2023	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SHQ971	01/12/2023	Active	473,000,000	mxn	473,000,000	473,000,000	
SHQ972	01/12/2023	Active	473,000,000	mxn	473,000,000	473,000,000	
SHS016	13/12/2023	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SHS403	15/12/2023	Active	170,000,000	mxn	170,000,000	170,000,000	
SHS538	18/12/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHS816	15/12/2023	Active	200,000,000	usd	200,000,000	200,000,000	
SHT142	22/12/2023	Active	725,000,000	mxn	725,000,000	725,000,000	
SHV646	16/11/2023	Active	16,445,789	usd	16,445,789	16,445,789	
SHV647	16/11/2023	Active	16,445,789	usd	16,445,789	16,445,789	
SHX944	10/10/2023	Active	340,000,000	mxn	340,000,000	340,000,000	
SHX945	10/10/2023	Active	340,000,000	mxn	340,000,000	340,000,000	
SHY657	18/10/2023	Active	860,000,000	mxn	860,000,000	860,000,000	
SHY661	18/10/2023	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SHY666	18/10/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIA998	01/11/2023	Active	665,000,000	mxn	665,000,000	665,000,000	
SIA999	01/11/2023	Active	665,000,000	mxn	665,000,000	665,000,000	
SIB420	03/11/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIB579	06/11/2023	Active	1,250,000,000	mxn	1,250,000,000	1,250,000,000	
SIB933	07/11/2023	Active	555,000,000	mxn	555,000,000	555,000,000	
SIE025	21/11/2023	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000	
SIET61	22/11/2023	Active	700,000,000	mxn	700,000,000	700,000,000	
SIG115	29/11/2023	Active	800,000,000	mxn	800,000,000	800,000,000	
SIG142	29/11/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SIH154	05/12/2023	Active	1,375,000,000	mxn	1,375,000,000	1,375,000,000	
SIJ230	11/12/2023	Active	265,000,000	mxn	265,000,000	265,000,000	
SIJ231	11/12/2023	Active	265,000,000	mxn	265,000,000	265,000,000	
SIJ306	11/12/2023	Active	815,000,000	mxn	815,000,000	815,000,000	
SIJ494	20/12/2023	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SIJ505	20/12/2023	Active	670,000,000	mxn	670,000,000	670,000,000	
SIJ506	20/12/2023	Active	670,000,000	mxn	670,000,000	670,000,000	
SIJ804	21/12/2023	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SIK321	04/12/2023	Active	10,714,982	usd	10,714,982	10,714,982	
SIK323	04/12/2023	Active	10,714,982	usd	10,714,982	10,714,982	
SIK326	14/11/2023	Active	14,598,757	usd	14,598,757	14,598,757	
SIK328	14/11/2023	Active	14,598,757	usd	14,598,757	14,598,757	
SIK459	08/12/2023	Active	402,562	usd	402,562	402,562	
SIK529	08/12/2023	Active	402,562	usd	402,562	402,562	
SIL134	09/10/2023	Active	7,000,000,000	mxn	7,000,000,000	7,000,000,000	
SIL137	09/10/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIL139	09/10/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIL162	09/10/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIL165	09/10/2023	Active	3,800,000,000	mxn	3,800,000,000	3,800,000,000	
SIL169	09/10/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIM208	10/10/2023	Active	1,350,000,000	mxn	1,350,000,000	1,350,000,000	
SIM223	10/10/2023	Active	1,350,000,000	mxn	1,350,000,000	1,350,000,000	
SIM636	12/10/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIM664	12/10/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIN617	19/10/2023	Active	800,000,000	mxn	800,000,000	800,000,000	
SIO340	03/11/2023	Active	4,500,000	usd	4,500,000	4,500,000	
SIO461	03/11/2023	Active	4,500,000	usd	4,500,000	4,500,000	
SIO611	07/11/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000	
SIO638	07/11/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000	
SIO874	08/11/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000	
SIP006	08/11/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000	
SIP008	30/10/2023	Active	1,550,000,000	mxn	1,550,000,000	1,550,000,000	
SIP207	11/11/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000	
SIP216	11/11/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000	
SIP292	31/10/2023	Active	1,165,000,000	mxn	1,165,000,000	1,165,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SIP411	12/11/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000	
SIP481	12/11/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000	
SIP525	07/11/2023	Active	11,000,000	mxn	11,000,000	11,000,000	
SIP534	08/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP535	09/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP536	15/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP538	16/11/2023	Active	9,000,000	mxn	9,000,000	9,000,000	
SIP540	14/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP549	13/11/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIP551	10/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP572	07/11/2023	Active	11,000,000	mxn	11,000,000	11,000,000	
SIP573	08/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP574	09/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP575	10/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP576	13/11/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIP577	14/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP578	15/11/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SIP579	16/11/2023	Active	9,000,000	mxn	9,000,000	9,000,000	
SJD703	27/11/2023	Active	3,240,000,000	mxn	3,240,000,000	3,240,000,000	
SJD706	27/11/2023	Active	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SJD707	27/11/2023	Active	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SJE304	05/10/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SJE508	13/10/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJE512	13/10/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJF622	19/12/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJF643	19/12/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJG281	19/12/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJG319	19/12/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJG676	23/11/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJG729	23/11/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJH193	19/12/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJH218	05/10/2023	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
SJH219	19/12/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJH223	05/10/2023	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
SJH352	03/10/2023	Active	40,900,000	mxn	40,900,000	40,900,000	
SJH355	03/10/2023	Active	40,900,000	mxn	40,900,000	40,900,000	
SJH512	19/12/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJH699	19/12/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJH876	09/10/2023	Active	3,500,000	usd	3,500,000	3,500,000	
SJI063	09/10/2023	Active	3,500,000	usd	3,500,000	3,500,000	
SJI327	09/11/2023	Active	4,400,000	mxn	4,400,000	4,400,000	
SJI334	09/11/2023	Active	4,400,000	mxn	4,400,000	4,400,000	
SJI692	29/12/2023	Active	1,130,000,000	mxn	1,130,000,000	1,130,000,000	
SJI738	15/11/2023	Active	1,500,000	usd	1,500,000	1,500,000	
SJI749	15/11/2023	Active	1,500,000	usd	1,500,000	1,500,000	
SJJ896	11/12/2023	Active	13,000,000	mxn	13,000,000	13,000,000	
SJJ906	11/12/2023	Active	13,000,000	mxn	13,000,000	13,000,000	
SJK398	24/11/2023	Active	3,800,000	mxn	3,800,000	3,800,000	
SJK408	24/11/2023	Active	3,800,000	mxn	3,800,000	3,800,000	
SJK917	27/12/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SJK956	27/12/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SJL650	27/10/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SJL651	27/10/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJM824	08/12/2023	Active	2,700,000	mxn	2,700,000	2,700,000	
SJM828	08/12/2023	Active	2,700,000	mxn	2,700,000	2,700,000	
SJN060	07/11/2023	Active	383,138,994	mxn	383,138,994	383,138,994	
SJN513	15/12/2023	Active	500,000	usd	500,000	500,000	
SJN556	15/12/2023	Active	500,000	usd	500,000	500,000	
SJN762	13/11/2023	Active	2,250,000,000	mxn	2,250,000,000	2,250,000,000	
SJP405	22/12/2023	Active	2,100,000	mxn	2,100,000	2,100,000	
SJP419	22/12/2023	Active	2,100,000	mxn	2,100,000	2,100,000	
SJV316	22/12/2023	Active	3,900,000,000	mxn	3,900,000,000	3,900,000,000	
SJW364	25/12/2023	Active	1,600,000,000	mxn	1,600,000,000	1,600,000,000	
SJX379	29/12/2023	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023122003028	B	CADMXN	12/21/2023	233,911	12.79	(2,991,406)
2023122003026	S	CADMXN	12/21/2023	(233,911)	12.79	2,990,948
2023122003027	B	CADMXN	12/22/2023	233,911	12.79	(2,991,507)
2023122003029	S	CADMXN	12/22/2023	(233,911)	12.79	2,991,951
2023120103105	B	EURMXN	12/01/2023	4,140,000	18.69	(77,379,332)
2023120103106	S	EURMXN	12/04/2023	(4,140,000)	18.70	77,424,405
2023121303031	B	EURMXN	12/14/2023	700,000	18.72	(13,102,255)
2023121303032	S	EURMXN	12/19/2023	(700,000)	18.74	13,115,655
2023122803804	S	EURMXN	01/02/2024	(50,000)	18.78	938,910
2023122803805	B	EURMXN	01/16/2024	50,000	18.83	(941,671)
2023122903032	B	EURMXN	01/02/2024	962,139	18.68	(17,976,423)
2023122903034	S	EURMXN	01/02/2024	(962,139)	18.68	17,971,369
2023122903035	B	EURMXN	01/03/2024	962,139	18.68	(17,975,456)
2023122903033	S	EURMXN	01/03/2024	(962,139)	18.69	17,979,209
2023100203158	B	USDMXN	10/03/2023	541,075	17.52	(9,478,937)
2023100203184	B	USDMXN	10/03/2023	51,000,000	17.54	(894,540,000)
2023100203159	S	USDMXN	10/04/2023	(541,075)	17.52	9,480,345
2023100203172	SON	USDMXN	10/04/2023	(20,000,000)	16.99	339,774,000
2023100203173	SO	USDMXN	10/04/2023	0	17.56	11,496,000
2023100203185	S	USDMXN	10/04/2023	(51,000,000)	17.54	894,677,700
2023100203175	B	USDMXN	10/04/2023	20,000,000	17.56	(351,270,000)
2023100303013	S	USDMXN	10/04/2023	(39,134,353)	17.77	695,417,461
2023100303015	B	USDMXN	10/04/2023	675,429	17.74	(11,982,963)
2023100303462	B	USDMXN	10/04/2023	110,000,000	17.97	(1,976,700,000)
2023100303016	S	USDMXN	10/05/2023	(675,429)	17.74	11,984,743
2023100303143	SON	USDMXN	10/05/2023	(40,000,000)	17.22	688,620,000
2023100303144	SO	USDMXN	10/05/2023	0	17.82	24,280,000
2023100303463	S	USDMXN	10/05/2023	(110,000,000)	17.97	1,976,999,750
2023100303014	B	USDMXN	10/05/2023	39,128,408	17.77	(695,417,461)
2023100303138	B	USDMXN	10/05/2023	20,000,000	17.82	(356,450,000)
2023100303625	SO	USDMXN	10/30/2023	(1,336,966)	18.07	24,159,501
2023100303628	SO	USDMXN	10/30/2023	(1,000,000)	18.07	18,070,083
2023100303632	S	USDMXN	10/30/2023	(5,656,844)	18.07	102,219,816
2023100303641	SO	USDMXN	10/30/2023	(1,336,966)	18.07	24,159,501
2023100303643	SO	USDMXN	10/30/2023	(1,000,000)	18.07	18,070,083
2023100303389	BO	USDMXN	11/17/2023	2,000,000	18.05	(36,095,360)
2023100303391	BO	USDMXN	11/17/2023	2,000,000	18.05	(36,095,402)
2023100303392	BO	USDMXN	11/17/2023	2,000,000	18.05	(36,097,130)
2023100303393	BO	USDMXN	11/17/2023	2,000,000	18.05	(36,095,402)
2023100303396	BO	USDMXN	11/17/2023	1,555,743	18.05	(28,073,695)
2023100303398	BO	USDMXN	11/17/2023	2,000,000	18.05	(36,095,360)
2023100303401	BO	USDMXN	11/17/2023	2,000,000	18.05	(36,097,130)
2023100303633	B	USDMXN	12/28/2023	5,656,844	18.27	(103,349,544)
2023100403228	S	USDMXN	10/05/2023	(9,000,000)	18.07	162,585,000
2023100403004	B	USDMXN	10/05/2023	547,021	17.95	(9,819,425)
2023100403005	S	USDMXN	10/06/2023	(547,021)	17.95	9,820,881
2023100403116	SON	USDMXN	10/06/2023	(30,000,000)	17.66	529,839,000
2023100403117	SO	USDMXN	10/06/2023	0	18.10	13,266,000
2023100403245	S	USDMXN	10/06/2023	(30,000,000)	17.95	538,500,000
2023100403119	B	USDMXN	10/06/2023	30,000,000	18.10	(543,105,000)
2023100403229	B	USDMXN	10/06/2023	9,000,000	18.07	(162,609,750)
2023100403234	B	USDMXN	10/06/2023	10,000,000	17.98	(179,770,000)
2023100403243	B	USDMXN	10/06/2023	30,000,000	17.95	(538,500,000)
2023100403341	BO	USDMXN	10/20/2023	880,000	18.02	(15,853,515)
2023100403244	S	USDMXN	01/08/2024	(30,000,000)	18.24	547,065,000
2023100403246	B	USDMXN	04/08/2024	30,000,000	18.52	(555,720,000)
2023100403235	S	USDMXN	10/07/2024	(10,000,000)	19.14	191,380,000
2023100503090	S	USDMXN	10/06/2023	(16,000,000)	18.10	289,520,000
2023100503008	B	USDMXN	10/06/2023	47,021	18.04	(848,282)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023100503009	S	USDMXN	10/10/2023	(47,021)	18.05	848,799
2023100503177	SON	USDMXN	10/10/2023	(20,000,000)	17.63	352,640,000
2023100503178	SO	USDMXN	10/10/2023	0	18.21	11,590,000
2023100503540	S	USDMXN	10/10/2023	(20,000,000)	18.26	365,100,000
2023100503091	B	USDMXN	10/10/2023	16,000,000	18.11	(289,701,600)
2023100503179	B	USDMXN	10/10/2023	10,000,000	18.21	(182,115,000)
2023100503180	B	USDMXN	10/10/2023	10,000,000	18.21	(182,115,000)
2023100503541	B	USDMXN	12/11/2023	20,000,000	18.45	(368,940,000)
2023100503686	S	USDMXN	12/20/2023	(19,288,000)	18.15	350,104,203
2023100503679	B	USDMXN	12/20/2023	19,288,000	18.51	(356,998,313)
2023100503680	S	USDMXN	03/25/2024	(19,288,000)	18.80	362,679,883
2023100503687	B	USDMXN	03/25/2024	19,288,000	18.43	(355,504,843)
2023100603008	B	USDMXN	10/10/2023	47,021	18.34	(862,343)
2023100603379	B	USDMXN	10/10/2023	64,000,000	18.15	(1,161,472,000)
2023100603009	S	USDMXN	10/11/2023	(47,021)	18.34	862,477
2023100603380	S	USDMXN	10/11/2023	(64,000,000)	18.15	1,161,660,800
2023101003016	B	USDMXN	10/11/2023	47,021	18.06	(849,220)
2023101003196	B	USDMXN	10/11/2023	69,000,000	18.04	(1,245,036,000)
2023101003017	S	USDMXN	10/12/2023	(47,021)	18.06	849,354
2023101003197	S	USDMXN	10/12/2023	(69,000,000)	18.05	1,245,243,000
2023101003199	B	USDMXN	10/12/2023	15,000,000	17.97	(269,595,000)
2023101003360	B	USDMXN	10/12/2023	20,000,000	17.99	(359,800,000)
2023101003361	S	USDMXN	01/12/2024	(20,000,000)	18.28	365,500,000
2023101003200	S	USDMXN	10/15/2024	(15,000,000)	19.12	286,800,000
2023101103122	S	USDMXN	10/12/2023	(6,000,000)	17.84	107,032,350
2023101103008	B	USDMXN	10/12/2023	47,021	17.83	(838,203)
2023101103009	S	USDMXN	10/13/2023	(47,021)	17.83	838,337
2023101103044	S	USDMXN	10/13/2023	(20,000,000)	17.80	356,000,000
2023101103207	S	USDMXN	10/13/2023	(30,000,000)	17.82	534,600,000
2023101103053	B	USDMXN	10/13/2023	20,000,000	17.80	(356,000,000)
2023101103123	B	USDMXN	10/13/2023	6,000,000	17.84	(107,050,800)
2023101103045	B	USDMXN	11/13/2023	20,000,000	17.90	(357,940,000)
2023101103208	B	USDMXN	11/13/2023	30,000,000	17.92	(537,510,000)
2023101103054	S	USDMXN	04/15/2024	(20,000,000)	18.38	367,520,000
2023101203003	B	USDMXN	10/13/2023	47,021	17.95	(843,872)
2023101203116	B	USDMXN	10/13/2023	54,000,000	17.96	(969,570,000)
2023101203004	S	USDMXN	10/16/2023	(47,021)	17.96	844,289
2023101203117	S	USDMXN	10/16/2023	(54,000,000)	17.96	970,066,800
2023101303000	B	USDMXN	10/16/2023	47,021	17.87	(840,233)
2023101303132	B	USDMXN	10/16/2023	107,000,000	17.97	(1,923,111,000)
2023101303001	S	USDMXN	10/17/2023	(47,021)	17.87	840,373
2023101303133	S	USDMXN	10/17/2023	(107,000,000)	17.98	1,923,440,025
2023101603080	S	USDMXN	10/17/2023	(10,944,444)	18.00	197,000,000
2023101603084	S	USDMXN	10/17/2023	(10,944,444)	18.00	197,000,000
2023101603002	B	USDMXN	10/17/2023	47,021	17.98	(845,540)
2023101603076	B	USDMXN	10/17/2023	10,944,444	18.00	(197,000,000)
2023101603146	B	USDMXN	10/17/2023	888,889	17.96	(15,968,593)
2023101603448	B	USDMXN	10/17/2023	75,000,000	17.94	(1,345,350,000)
2023101603003	S	USDMXN	10/18/2023	(47,021)	17.99	845,677
2023101603077	S	USDMXN	10/18/2023	(10,942,621)	18.00	197,000,000
2023101603147	S	USDMXN	10/18/2023	(888,889)	17.97	15,971,200
2023101603179	S	USDMXN	10/18/2023	(15,000,000)	17.98	269,655,000
2023101603181	S	USDMXN	10/18/2023	(5,000,000)	17.99	89,930,000
2023101603183	S	USDMXN	10/18/2023	(20,000,000)	17.98	359,520,000
2023101603187	S	USDMXN	10/18/2023	(10,000,000)	17.96	179,560,000
2023101603449	S	USDMXN	10/18/2023	(75,000,000)	17.94	1,345,571,250
2023101603081	B	USDMXN	10/18/2023	10,942,621	18.00	(197,000,000)
2023101603085	B	USDMXN	10/18/2023	10,942,621	18.00	(197,000,000)
2023101603180	B	USDMXN	10/18/2024	15,000,000	19.11	(286,710,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023101603182	B	USDMXN	10/18/2024	5,000,000	19.12	(95,615,000)
2023101603184	B	USDMXN	10/18/2024	20,000,000	19.11	(382,260,000)
2023101603188	B	USDMXN	10/18/2024	10,000,000	19.09	(190,940,000)
2023101703004	B	USDMXN	10/18/2023	50,668	18.02	(913,201)
2023101703117	B	USDMXN	10/18/2023	54,000,000	17.92	(967,680,000)
2023101703005	S	USDMXN	10/19/2023	(50,668)	18.03	913,351
2023101703082	S	USDMXN	10/19/2023	(20,000,000)	17.94	358,850,000
2023101703118	S	USDMXN	10/19/2023	(54,000,000)	17.92	967,842,000
2023101703461	S	USDMXN	10/19/2023	(14,785,036)	17.91	264,800,000
2023101703462	B	USDMXN	10/20/2023	14,782,643	17.91	(264,800,000)
2023101703083	B	USDMXN	04/19/2024	20,000,000	18.52	(370,400,000)
2023101803042	B	USDMXN	10/19/2023	835,705	18.19	(15,197,433)
2023101803496	B	USDMXN	10/19/2023	103,000,000	18.26	(1,880,780,000)
2023101803043	S	USDMXN	10/20/2023	(835,705)	18.19	15,199,877
2023101803497	S	USDMXN	10/20/2023	(103,000,000)	18.26	1,881,086,425
2023101903007	B	USDMXN	10/20/2023	53,888	18.29	(985,615)
2023101903201	B	USDMXN	10/20/2023	27,000,000	18.31	(494,370,000)
2023101903008	S	USDMXN	10/23/2023	(53,888)	18.30	986,093
2023101903202	S	USDMXN	10/23/2023	(27,000,000)	18.32	494,615,700
2023102003017	B	USDMXN	10/23/2023	653,888	18.30	(11,963,232)
2023102003257	B	USDMXN	10/23/2023	50,000,000	18.23	(911,300,000)
2023102003516	B	USDMXN	10/23/2023	59,000,000	18.23	(1,075,629,000)
2023102003018	S	USDMXN	10/24/2023	(653,888)	18.30	11,965,226
2023102003185	S	USDMXN	10/24/2023	(30,000,000)	18.28	548,295,000
2023102003258	S	USDMXN	10/24/2023	(50,000,000)	18.23	911,462,500
2023102003517	S	USDMXN	10/24/2023	(59,000,000)	18.23	1,075,811,900
2023102003186	B	USDMXN	11/24/2023	30,000,000	18.38	(551,265,000)
2023102303006	B	USDMXN	10/24/2023	653,888	18.27	(11,944,908)
2023102303215	B	USDMXN	10/24/2023	79,000,000	18.11	(1,430,887,500)
2023102303007	S	USDMXN	10/25/2023	(653,888)	18.27	11,946,852
2023102303216	S	USDMXN	10/25/2023	(79,000,000)	18.12	1,431,128,450
2023102403000	B	USDMXN	10/25/2023	659,222	18.17	(11,976,600)
2023102403056	B	USDMXN	10/25/2023	36,000	18.19	(654,781)
2023102403505	B	USDMXN	10/25/2023	62,000,000	18.26	(1,132,120,000)
2023102403001	S	USDMXN	10/26/2023	(659,222)	18.17	11,978,528
2023102403057	S	USDMXN	10/26/2023	(36,000)	18.19	654,887
2023102403229	SON	USDMXN	10/26/2023	(20,000,000)	17.21	344,234,000
2023102403230	SO	USDMXN	10/26/2023	0	18.24	20,596,000
2023102403506	S	USDMXN	10/26/2023	(62,000,000)	18.26	1,132,306,000
2023102403241	B	USDMXN	10/26/2023	20,000,000	18.24	(364,830,000)
2023102503029	B	USDMXN	10/26/2023	695,222	18.36	(12,763,567)
2023102503218	B	USDMXN	10/26/2023	59,000,000	18.29	(1,079,110,000)
2023102503030	S	USDMXN	10/27/2023	(695,222)	18.36	12,765,531
2023102503219	S	USDMXN	10/27/2023	(59,000,000)	18.29	1,079,282,575
2023102503130	B	USDMXN	10/27/2023	10,000,000	18.31	(183,080,000)
2023102503089	SON	USDMXN	10/30/2023	(200,000,000)	18.36	3,671,000,000
2023102503060	BON	USDMXN	10/30/2023	200,000,000	18.35	(3,670,000,000)
2023102503070	SON	USDMXN	01/29/2024	(200,000,000)	18.63	3,726,240,000
2023102503095	BON	USDMXN	01/29/2024	200,000,000	18.63	(3,726,120,000)
2023102503532	BO	USDMXN	03/15/2024	72,000	18.76	(1,350,803)
2023102503131	S	USDMXN	04/29/2024	(10,000,000)	18.89	188,880,000
2023102603030	B	USDMXN	10/27/2023	695,222	18.29	(12,716,262)
2023102603096	B	USDMXN	10/27/2023	29,000,000	18.28	(530,120,000)
2023102603031	S	USDMXN	10/30/2023	(695,222)	18.30	12,722,288
2023102603097	S	USDMXN	10/30/2023	(29,000,000)	18.29	530,375,200
2023102603144	SON	USDMXN	10/30/2023	(200,000,000)	18.35	3,670,000,000
2023102603147	SO	USDMXN	10/30/2023	0	18.22	26,580,000
2023102603332	SON	USDMXN	10/30/2023	(200,000,000)	18.35	3,670,000,000
2023102603335	SO	USDMXN	10/30/2023	0	18.20	31,100,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023102603146	BO	USDMXN	10/30/2023	0	18.22	(25,580,000)
2023102603145	BON	USDMXN	10/30/2023	200,000,000	18.36	(3,671,000,000)
2023102603334	BO	USDMXN	10/30/2023	0	18.20	(30,100,000)
2023102603333	BON	USDMXN	10/30/2023	200,000,000	18.36	(3,671,000,000)
2023102703494	B	USDMXN	10/30/2023	30,000,000	18.11	(543,150,000)
2023102703495	S	USDMXN	10/31/2023	(30,000,000)	18.11	543,237,000
2023103003123	B	USDMXN	10/31/2023	50,000,000	17.99	(899,500,000)
2023103003391	B	USDMXN	10/31/2023	30,000,000	18.09	(542,760,000)
2023103003124	S	USDMXN	11/01/2023	(50,000,000)	17.99	899,642,500
2023103003392	S	USDMXN	11/01/2023	(30,000,000)	18.09	542,846,250
2023103103021	B	USDMXN	11/01/2023	695,222	18.08	(12,567,079)
2023103103097	B	USDMXN	11/01/2023	16,750,000	18.05	(302,337,500)
2023103103022	S	USDMXN	11/03/2023	(695,222)	18.08	12,571,007
2023103103098	S	USDMXN	11/03/2023	(16,750,000)	18.06	302,434,650
2023110103004	B	USDMXN	11/03/2023	695,222	17.96	(12,484,026)
2023110103218	B	USDMXN	11/03/2023	50,500,000	17.96	(906,727,500)
2023110103005	S	USDMXN	11/06/2023	(695,222)	17.97	12,489,736
2023110103219	S	USDMXN	11/06/2023	(50,500,000)	17.96	907,149,175
2023110103536	S	USDMXN	11/06/2023	(150,000,000)	17.91	2,685,900,000
2023110103543	B	USDMXN	11/06/2023	150,000,000	17.90	(2,685,000,000)
2023110103546	SON	USDMXN	02/06/2024	(150,000,000)	18.17	2,725,950,000
2023110103540	BON	USDMXN	02/06/2024	50,000,000	18.17	(908,650,000)
2023110103541	BON	USDMXN	02/06/2024	50,000,000	18.17	(908,650,000)
2023110103542	BON	USDMXN	02/06/2024	50,000,000	18.17	(908,650,000)
2023110303418	S	USDMXN	11/03/2023	(1,010,309)	17.41	17,586,350
2023110303395	S	MXNUSD	11/03/2023	(8,779,296)	17.40	504,589
2023110303403	B	USDMXN	11/03/2023	505,720	17.36	(8,779,296)
2023110303410	B	USDMXN	11/03/2023	505,720	17.36	(8,779,296)
2023110303792	S	USDMXN	11/06/2023	(3,300,000)	17.44	57,547,669
2023110303047	B	USDMXN	11/06/2023	695,222	17.37	(12,072,620)
2023110303348	B	USDMXN	11/06/2023	60,000,000	17.37	(1,042,200,000)
2023110303048	S	USDMXN	11/07/2023	(695,222)	17.37	12,074,271
2023110303349	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000,000)	17.37	1,042,344,000
2023110303396	B	MXNUSD	11/07/2023	8,779,296	17.41	(504,349)
2023110303404	S	USDMXN	11/07/2023	(505,720)	17.37	8,784,454
2023110303411	S	USDMXN	11/07/2023	(505,423)	17.37	8,779,296
2023110303636	S	USDMXN	11/07/2023	(30,000,000)	17.43	522,960,000
2023110303742	S	USDMXN	11/07/2023	(30,000,000)	17.44	523,200,000
2023110303874	S	USDMXN	11/07/2023	(30,000,000)	17.46	523,680,000
2023110303419	B	USDMXN	11/07/2023	1,010,309	17.42	(17,596,347)
2023110303793	B	USDMXN	11/07/2023	3,300,000	17.44	(57,555,960)
2023110303156	S	USDMXN	11/08/2023	(25,000,000)	17.38	434,500,000
2023110303209	S	USDMXN	11/08/2023	(25,778,337)	17.38	448,027,500
2023110303161	B	USDMXN	11/08/2023	25,000,000	17.42	(435,500,000)
2023110303554	SO	USDMXN	12/06/2023	(26,000,000)	17.59	457,441,400
2023110303558	SO	USDMXN	12/06/2023	(26,000,000)	17.59	457,441,400
2023110303637	B	USDMXN	12/07/2023	30,000,000	17.52	(525,480,000)
2023110303875	B	USDMXN	01/08/2024	30,000,000	17.63	(528,990,000)
2023110303559	SO	USDMXN	01/10/2024	(34,000,000)	17.59	598,192,600
2023110303560	SO	USDMXN	02/07/2024	(40,000,000)	17.59	703,756,000
2023110303743	B	USDMXN	02/07/2024	30,000,000	17.71	(531,225,000)
2023110303162	S	USDMXN	10/02/2024	(25,000,000)	18.39	459,650,000
2023110303157	B	USDMXN	10/02/2024	25,000,000	18.35	(458,675,000)
2023110303210	B	USDMXN	10/02/2024	25,969,641	18.35	(476,465,000)
2023110603065	B	USDMXN	11/07/2023	885,685	17.55	(15,540,496)
2023110603116	B	USDMXN	11/07/2023	25,000,000	17.54	(438,375,000)
2023110603066	S	USDMXN	11/08/2023	(885,685)	17.55	15,542,173
2023110603117	S	USDMXN	11/08/2023	(25,000,000)	17.54	438,426,250
2023110603088	SO	USDMXN	12/13/2023	(280,000)	17.60	4,929,212

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023110603621	SO	USDMXN	12/19/2023	(170,000)	17.63	2,997,699
2023110703006	B	USDMXN	11/08/2023	664,022	17.50	(11,623,521)
2023110703007	S	USDMXN	11/09/2023	(664,022)	17.51	11,625,165
2023110703113	SO	USDMXN	12/20/2023	(500,000)	17.65	8,823,129
2023110703116	SO	USDMXN	12/20/2023	(500,000)	17.65	8,823,129
2023110703173	BO	USDMXN	12/20/2023	500,000	17.64	(8,822,309)
2023110703182	BO	USDMXN	12/20/2023	500,000	17.64	(8,822,309)
2023110803000	B	USDMXN	11/09/2023	664,022	17.53	(11,640,296)
2023110803114	B	USDMXN	11/09/2023	16,400,000	17.49	(286,836,000)
2023110803001	S	USDMXN	11/10/2023	(664,022)	17.53	11,641,964
2023110803004	S	USDMXN	11/10/2023	(30,000,000)	17.53	525,900,000
2023110803115	S	USDMXN	11/10/2023	(16,400,000)	17.49	286,880,280
2023110803379	S	USDMXN	11/10/2023	(50,000,000)	17.54	877,000,000
2023110803380	B	USDMXN	12/11/2023	50,000,000	17.63	(881,495,000)
2023110803005	B	USDMXN	01/10/2024	30,000,000	17.71	(531,225,000)
2023110903018	B	USDMXN	11/10/2023	664,022	17.51	(11,627,326)
2023110903116	B	USDMXN	11/10/2023	100,000,000	17.49	(1,749,000,000)
2023110903122	B	USDMXN	11/10/2023	39,000,000	17.49	(682,110,000)
2023110903019	S	USDMXN	11/13/2023	(664,022)	17.52	11,632,602
2023110903117	S	USDMXN	11/13/2023	(100,000,000)	17.50	1,749,812,500
2023110903123	S	USDMXN	11/13/2023	(39,000,000)	17.50	682,426,875
2023110903302	B	USDMXN	11/13/2023	30,000,000	17.48	(524,490,000)
2023110903086	S	USDMXN	11/16/2023	(20,300,000)	17.50	355,159,645
2023110903087	B	USDMXN	01/29/2024	20,300,000	17.71	(359,564,745)
2023110903303	S	USDMXN	06/13/2024	(30,000,000)	18.13	543,765,000
2023111003003	B	USDMXN	11/13/2023	664,022	17.81	(11,823,591)
2023111003126	B	USDMXN	11/13/2023	66,000,000	17.82	(1,176,153,000)
2023111003004	S	USDMXN	11/14/2023	(664,022)	17.81	11,825,367
2023111003127	S	USDMXN	11/14/2023	(66,000,000)	17.82	1,176,351,000
2023111003315	B	USDMXN	11/14/2023	5,000,000	17.76	(88,800,000)
2023111003316	S	USDMXN	11/14/2024	(5,000,000)	18.85	94,250,000
2023111303263	S	USDMXN	11/13/2023	(18,931,211)	17.59	333,000,000
2023111303247	B	USDMXN	11/13/2023	18,872,202	17.65	(333,000,000)
2023111303248	S	USDMXN	11/14/2023	(18,869,047)	17.65	333,000,000
2023111303060	B	USDMXN	11/14/2023	850,993	17.69	(15,050,150)
2023111303253	B	USDMXN	11/14/2023	76,000,000	17.63	(1,339,880,000)
2023111303264	B	USDMXN	11/14/2023	18,927,875	17.59	(333,000,000)
2023111303061	S	USDMXN	11/15/2023	(850,993)	17.69	15,052,533
2023111303254	S	USDMXN	11/15/2023	(76,000,000)	17.63	1,340,102,300
2023111303272	S	USDMXN	11/15/2023	(30,000,000)	17.64	529,290,000
2023111303602	S	USDMXN	11/15/2023	(20,000,000)	17.59	351,890,000
2023111303267	B	USDMXN	11/15/2023	30,000,000	17.64	(529,200,000)
2023111303268	S	USDMXN	01/16/2024	(30,000,000)	17.83	534,786,000
2023111303603	B	USDMXN	02/15/2024	20,000,000	17.87	(357,470,000)
2023111303273	B	USDMXN	05/15/2024	30,000,000	18.19	(545,820,000)
2023111403056	B	USDMXN	11/15/2023	850,993	17.40	(14,806,569)
2023111403057	S	USDMXN	11/16/2023	(850,993)	17.40	14,808,979
2023111403274	S	USDMXN	11/16/2023	(30,000,000)	17.38	521,370,000
2023111403716	S	USDMXN	11/16/2023	(30,000,000)	17.38	521,370,000
2023111403688	S	USDMXN	12/07/2023	(50,000,000)	17.43	871,465,000
2023111403689	B	USDMXN	12/18/2023	50,000,000	17.46	(873,100,000)
2023111403275	B	USDMXN	01/16/2024	30,000,000	17.56	(526,845,000)
2023111403717	B	USDMXN	01/16/2024	30,000,000	17.56	(526,845,000)
2023111503002	B	USDMXN	11/16/2023	250,993	17.37	(4,359,032)
2023111503592	B	USDMXN	11/16/2023	89,000,000	17.32	(1,541,480,000)
2023111503003	S	USDMXN	11/17/2023	(250,993)	17.37	4,359,747
2023111503593	S	USDMXN	11/17/2023	(89,000,000)	17.32	1,541,729,200
2023111503676	S	USDMXN	11/17/2023	(20,000,000)	17.31	346,200,000
2023111503662	B	USDMXN	11/17/2023	20,000,000	17.31	(346,200,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023111503663	S	USDMXN	05/17/2024	(20,000,000)	17.85	356,960,000
2023111503677	B	USDMXN	06/17/2024	20,000,000	17.94	(358,790,000)
2023111603009	B	USDMXN	11/17/2023	410,883	17.22	(7,076,874)
2023111603054	B	USDMXN	11/17/2023	32,000,000	17.28	(552,960,000)
2023111603010	S	USDMXN	11/21/2023	(410,883)	17.23	7,081,445
2023111603055	S	USDMXN	11/21/2023	(32,000,000)	17.29	553,326,400
2023111603563	S	USDMXN	11/21/2023	(50,000,000)	17.24	862,000,000
2023111603564	B	USDMXN	11/28/2023	50,000,000	17.26	(862,990,000)
2023111603298	SO	USDMXN	03/27/2024	(2,000,000)	17.68	35,350,000
2023111603301	SO	USDMXN	03/27/2024	(2,000,000)	17.68	35,350,000
2023111603290	BO	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	17.67	(17,665,210)
2023111603291	BO	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	17.67	(17,670,310)
2023111703456	S	USDMXN	11/21/2023	(2,000,000)	17.21	34,422,325
2023111703007	B	USDMXN	11/21/2023	410,883	17.23	(7,078,779)
2023111703036	B	USDMXN	11/21/2023	67,000,000	17.21	(1,153,070,000)
2023111703008	S	USDMXN	11/22/2023	(410,883)	17.23	7,079,884
2023111703037	S	USDMXN	11/22/2023	(67,000,000)	17.21	1,153,257,600
2023111703146	S	USDMXN	11/22/2023	(1,254,719)	17.22	21,604,128
2023111703234	S	USDMXN	11/22/2023	(864,000)	17.22	14,874,970
2023111703426	B	USDMXN	11/22/2023	50,000,000	17.21	(860,350,000)
2023111703457	B	USDMXN	12/19/2023	2,000,000	17.29	(34,582,479)
2023111703652	BO	USDMXN	12/20/2023	27,950	17.33	(484,421)
2023111703660	BO	USDMXN	12/20/2023	21,500	17.33	(372,688)
2023111703427	S	USDMXN	12/22/2023	(50,000,000)	17.29	864,600,000
2023111703236	B	USDMXN	06/27/2024	864,000	17.86	(15,427,092)
2023111703147	B	USDMXN	09/13/2024	1,254,719	18.08	(22,691,147)
2023112103036	B	USDMXN	11/22/2023	410,883	17.11	(7,028,494)
2023112103410	B	USDMXN	11/22/2023	35,000,000	17.19	(601,615,000)
2023112103415	B	USDMXN	11/22/2023	38,000,000	17.20	(653,600,000)
2023112103037	S	USDMXN	11/24/2023	(410,883)	17.11	7,030,742
2023112103254	SON	USDMXN	11/24/2023	(30,000,000)	17.12	513,465,000
2023112103255	SO	USDMXN	11/24/2023	0	17.22	3,105,000
2023112103411	S	USDMXN	11/24/2023	(35,000,000)	17.19	601,814,500
2023112103416	S	USDMXN	11/24/2023	(38,000,000)	17.21	653,818,500
2023112103461	S	USDMXN	11/24/2023	(20,000,000)	17.24	344,800,000
2023112103256	B	USDMXN	11/24/2023	30,000,000	17.22	(516,570,000)
2023112103572	S	USDMXN	12/20/2023	(20,000,000)	17.30	346,060,000
2023112103573	B	USDMXN	03/20/2024	20,000,000	17.57	(351,326,000)
2023112103462	B	USDMXN	03/25/2024	20,000,000	17.59	(351,850,000)
2023112203035	S	USDMXN	11/24/2023	(177,301)	17.21	3,050,660
2023112203037	S	USDMXN	11/24/2023	(40,000,000)	17.22	688,800,000
2023112203032	B	USDMXN	11/24/2023	71,938,184	17.19	(1,236,617,379)
2023112203396	S	USDMXN	11/27/2023	(10,000,000)	17.19	171,940,000
2023112203505	S	USDMXN	11/27/2023	(15,000,000)	17.19	257,850,000
2023112203036	B	USDMXN	11/27/2023	177,301	17.21	(3,052,215)
2023112203038	B	USDMXN	11/27/2023	40,000,000	17.23	(689,144,000)
2023112203337	B	USDMXN	11/27/2023	30,000,000	17.21	(516,300,000)
2023112203509	B	USDMXN	11/27/2023	10,000,000	17.19	(171,900,000)
2023112203513	B	USDMXN	11/27/2023	30,000,000	17.19	(515,655,000)
2023112203033	S	USDMXN	11/28/2023	(71,889,254)	17.20	1,236,617,379
2023112203338	S	USDMXN	01/29/2024	(30,000,000)	17.39	521,760,000
2023112203514	S	USDMXN	01/29/2024	(30,000,000)	17.37	521,145,000
2023112203506	B	USDMXN	05/28/2024	15,000,000	17.72	(265,860,000)
2023112203510	S	USDMXN	08/27/2024	(10,000,000)	17.99	179,870,000
2023112203397	B	USDMXN	08/27/2024	10,000,000	17.99	(179,920,000)
2023112403034	S	USDMXN	11/27/2023	(177,301)	17.11	3,033,213
2023112403045	S	USDMXN	11/27/2023	(43,000,000)	17.11	735,730,000
2023112403047	S	USDMXN	11/27/2023	(30,000,000)	17.11	513,300,000
2023112403311	SON	USDMXN	11/28/2023	(20,000,000)	17.59	351,794,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023112403035	B	USDMXN	11/28/2023	177,301	17.11	(3,033,811)
2023112403046	B	USDMXN	11/28/2023	43,000,000	17.11	(735,854,700)
2023112403048	B	USDMXN	11/28/2023	30,000,000	17.11	(513,387,000)
2023112403312	BO	USDMXN	11/28/2023	0	17.13	(9,274,000)
2023112403313	B	USDMXN	11/28/2023	20,000,000	17.13	(342,520,000)
2023112703151	S	USDMXN	11/28/2023	(100,000,000)	17.10	1,709,900,000
2023112703161	S	USDMXN	11/28/2023	(5,708,431)	17.13	97,758,321
2023112703174	S	USDMXN	11/28/2023	(30,000,000)	17.14	514,050,000
2023112703120	B	USDMXN	11/28/2023	705,414	17.07	(12,044,380)
2023112703134	B	USDMXN	11/28/2023	115,708,431	17.08	(1,976,300,000)
2023112703121	S	USDMXN	11/29/2023	(705,414)	17.08	12,046,347
2023112703438	S	USDMXN	11/29/2023	(50,000,000)	17.14	857,000,000
2023112703503	S	USDMXN	11/29/2023	(10,000,000)	17.14	171,400,000
2023112703175	B	USDMXN	11/29/2023	30,000,000	17.14	(514,135,500)
2023112703430	B	USDMXN	11/29/2023	30,000,000	17.14	(514,320,000)
2023112703446	B	USDMXN	11/29/2023	50,000,000	17.14	(857,000,000)
2023112703135	S	USDMXN	12/05/2023	(115,572,424)	17.10	1,976,300,000
2023112703152	B	USDMXN	12/05/2023	100,000,000	17.12	(1,711,900,000)
2023112703162	B	USDMXN	12/05/2023	5,708,431	17.15	(97,874,429)
2023112703431	S	USDMXN	01/29/2024	(30,000,000)	17.32	519,570,000
2023112703453	SON	USDMXN	02/27/2024	(50,000,000)	17.39	869,743,500
2023112703441	BON	USDMXN	02/27/2024	50,000,000	17.39	(869,450,000)
2023112703504	B	USDMXN	08/29/2024	10,000,000	17.93	(179,305,000)
2023112803015	S	USDMXN	11/29/2023	(159,586)	17.19	2,743,272
2023112803036	S	USDMXN	11/29/2023	(48,000,000)	17.21	825,840,000
2023112803538	S	USDMXN	11/29/2023	(25,000,000)	17.15	428,625,000
2023112803016	B	USDMXN	11/30/2023	159,586	17.19	(2,743,738)
2023112803037	B	USDMXN	11/30/2023	48,000,000	17.21	(825,975,600)
2023112803049	B	USDMXN	11/30/2023	30,000,000	17.18	(515,325,000)
2023112803539	B	USDMXN	11/30/2023	25,000,000	17.15	(428,695,000)
2023112803050	S	USDMXN	12/29/2023	(30,000,000)	17.26	517,806,000
2023112903021	S	USDMXN	11/30/2023	(159,586)	17.19	2,743,683
2023112903263	S	USDMXN	11/30/2023	(124,000,000)	17.17	2,129,328,000
2023112903272	S	USDMXN	11/30/2023	(50,000,000)	17.17	858,250,000
2023112903278	S	USDMXN	11/30/2023	(50,000,000)	17.17	858,250,000
2023112903471	S	USDMXN	11/30/2023	(96,834)	17.21	1,666,305
2023112903292	B	USDMXN	11/30/2023	29,096,834	17.18	(500,000,000)
2023112903460	B	USDMXN	11/30/2023	21,000,000	17.21	(361,473,000)
2023112903293	S	USDMXN	12/01/2023	(29,092,136)	17.19	500,000,000
2023112903461	S	USDMXN	12/01/2023	(21,000,000)	17.22	361,530,750
2023112903022	B	USDMXN	12/01/2023	159,586	17.20	(2,744,153)
2023112903264	B	USDMXN	12/01/2023	124,000,000	17.17	(2,129,669,000)
2023112903273	B	USDMXN	12/01/2023	50,000,000	17.17	(858,387,500)
2023112903279	B	USDMXN	12/01/2023	50,000,000	17.17	(858,387,500)
2023112903472	B	USDMXN	12/01/2023	96,834	17.21	(1,666,585)
2023112903574	B	USDMXN	12/01/2023	10,000,000	17.22	(172,180,000)
2023112903794	B	USDMXN	12/01/2023	8,000,000	17.26	(138,040,000)
2023112903575	S	USDMXN	06/03/2024	(10,000,000)	17.75	177,470,000
2023112903795	S	USDMXN	12/02/2024	(8,000,000)	18.30	146,400,000
2023113003032	S	USDMXN	12/01/2023	(164,284)	17.41	2,860,006
2023113003287	S	USDMXN	12/01/2023	(54,000,000)	17.38	938,250,000
2023113003668	S	USDMXN	12/01/2023	(100,000,000)	17.40	1,740,400,000
2023113003220	S	USDMXN	12/04/2023	(30,000,000)	17.37	521,100,000
2023113003033	B	USDMXN	12/04/2023	164,284	17.42	(2,861,392)
2023113003103	B	USDMXN	12/04/2023	98,533,384	17.48	(1,722,363,552)
2023113003288	B	USDMXN	12/04/2023	54,000,000	17.38	(938,698,200)
2023113003669	B	USDMXN	12/04/2023	100,000,000	17.41	(1,741,245,000)
2023113003270	S	USDMXN	12/20/2023	(30,000,000)	17.42	522,735,000
2023113003104	S	USDMXN	03/04/2024	(98,533,384)	17.74	1,747,735,899

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023113003221	B	USDMXN	03/04/2024	30,000,000	17.63	(528,780,000)
2023113003271	B	USDMXN	03/20/2024	30,000,000	17.68	(530,445,000)
2023120103303	S	USDMXN	12/04/2023	(697,668)	17.17	11,976,666
2023120103306	S	USDMXN	12/04/2023	(243,000,000)	17.28	4,199,040,000
2023120103304	B	USDMXN	12/05/2023	697,668	17.17	(11,978,689)
2023120103307	B	USDMXN	12/05/2023	243,000,000	17.28	(4,199,720,400)
2023120403004	S	USDMXN	12/05/2023	(833,676)	17.28	14,405,866
2023120403314	S	USDMXN	12/05/2023	(146,800,000)	17.45	2,560,926,000
2023120403320	S	USDMXN	12/05/2023	(86,182,000)	17.41	1,499,997,710
2023120403325	S	USDMXN	12/05/2023	(18,000)	17.45	314,045
2023120403005	B	USDMXN	12/06/2023	833,676	17.28	(14,408,253)
2023120403315	B	USDMXN	12/06/2023	146,800,000	17.45	(2,561,344,380)
2023120403321	B	USDMXN	12/06/2023	86,182,000	17.41	(1,500,243,329)
2023120403326	B	USDMXN	12/06/2023	18,000	17.45	(314,098)
2023120403160	S	USDMXN	12/20/2023	(30,000,000)	17.42	522,570,000
2023120403161	B	USDMXN	03/20/2024	30,000,000	17.68	(530,295,000)
2023120503031	S	USDMXN	12/06/2023	(193,768)	17.45	3,381,084
2023120503041	S	USDMXN	12/06/2023	(100,000,000)	17.49	1,748,500,000
2023120503044	S	USDMXN	12/06/2023	(56,000,000)	17.47	978,432,000
2023120503046	S	USDMXN	12/07/2023	(50,000,000)	17.49	874,250,000
2023120503048	S	USDMXN	12/07/2023	(50,000,000)	17.49	874,600,000
2023120503264	S	USDMXN	12/07/2023	(100,000,000)	17.49	1,748,500,000
2023120503032	B	USDMXN	12/07/2023	193,768	17.45	(3,381,733)
2023120503042	B	USDMXN	12/07/2023	100,000,000	17.49	(1,748,840,000)
2023120503045	B	USDMXN	12/07/2023	56,000,000	17.48	(978,616,800)
2023120503147	B	USDMXN	12/07/2023	30,000,000	17.43	(522,900,000)
2023120503604	B	USDMXN	12/07/2023	50,000,000	17.41	(870,500,000)
2023120503265	B	USDMXN	12/08/2023	100,000,000	17.49	(1,748,810,000)
2023120503605	S	USDMXN	12/14/2023	(50,000,000)	17.43	871,530,000
2023120503049	B	USDMXN	12/21/2023	50,000,000	17.53	(876,675,000)
2023120503047	B	USDMXN	02/07/2024	50,000,000	17.66	(883,200,000)
2023120503148	S	USDMXN	03/07/2024	(30,000,000)	17.69	530,655,000
2023120603028	S	USDMXN	12/07/2023	(193,768)	17.25	3,343,072
2023120603031	S	USDMXN	12/07/2023	(32,000,000)	17.30	553,600,000
2023120603164	S	USDMXN	12/07/2023	(50,000,000)	17.27	863,500,000
2023120603029	B	USDMXN	12/08/2023	193,768	17.26	(3,343,677)
2023120603032	B	USDMXN	12/08/2023	32,000,000	17.30	(553,696,000)
2023120603165	B	USDMXN	12/08/2023	50,000,000	17.27	(863,648,750)
2023120603397	B	USDMXN	12/08/2023	50,000,000	17.28	(864,000,000)
2023120603398	S	USDMXN	12/20/2023	(50,000,000)	17.32	865,760,000
2023120603178	B	USDMXN	02/08/2024	50,000,000	17.45	(872,250,000)
2023120603167	S	USDMXN	03/08/2024	(30,000,000)	17.54	526,050,000
2023120603179	S	USDMXN	03/08/2024	(50,000,000)	17.53	876,260,000
2023120603168	B	USDMXN	04/08/2024	30,000,000	17.62	(528,675,000)
2023120703022	S	USDMXN	12/08/2023	(665,000)	17.30	11,501,541
2023120703030	S	USDMXN	12/08/2023	(153,000,000)	17.31	2,647,665,000
2023120703180	S	USDMXN	12/08/2023	(30,000,000)	17.43	522,900,000
2023120703220	S	USDMXN	12/11/2023	(50,000,000)	17.35	867,500,000
2023120703023	B	USDMXN	12/11/2023	665,000	17.30	(11,507,559)
2023120703031	B	USDMXN	12/11/2023	153,000,000	17.31	(2,649,019,050)
2023120703181	B	USDMXN	12/11/2023	30,000,000	17.44	(523,164,000)
2023120703215	B	USDMXN	12/11/2023	50,000,000	17.35	(867,500,000)
2023120703108	B	USDMXN	02/08/2024	100,000,000	17.51	(1,751,000,000)
2023120703189	S	USDMXN	02/12/2024	(50,000,000)	17.53	876,440,000
2023120703216	S	USDMXN	02/12/2024	(50,000,000)	17.53	876,440,000
2023120703109	S	USDMXN	03/08/2024	(100,000,000)	17.59	1,759,000,000
2023120703190	B	USDMXN	03/11/2024	50,000,000	17.61	(880,400,000)
2023120703221	B	USDMXN	03/11/2024	50,000,000	17.61	(880,400,000)
2023120803598	S	USDMXN	12/08/2023	(50,000,000)	17.36	868,000,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023120803601	B	USDMXN	12/08/2023	50,000,000	17.36	(868,000,000)
2023120803167	S	USDMXN	12/11/2023	(20,000)	17.35	347,026
2023120803602	S	USDMXN	12/13/2023	(50,000,000)	17.37	868,675,000
2023120803168	B	USDMXN	12/13/2023	20,000	17.36	(347,142)
2023120803599	B	USDMXN	12/13/2023	50,000,000	17.37	(868,600,000)
2023121103146	S	USDMXN	12/13/2023	(250,000,000)	17.42	4,355,000,000
2023121103148	S	USDMXN	12/13/2023	(685,000)	17.45	11,956,033
2023121103596	S	USDMXN	12/14/2023	(50,000,000)	17.40	870,200,000
2023121103147	B	USDMXN	12/14/2023	250,000,000	17.42	(4,355,725,000)
2023121103149	B	USDMXN	12/14/2023	685,000	17.46	(11,958,045)
2023121103597	B	USDMXN	12/21/2023	50,000,000	17.42	(871,220,000)
2023121103243	SO	USDMXN	01/08/2024	(177,000)	17.51	3,098,565
2023121303007	S	USDMXN	12/14/2023	(227,099)	17.32	3,933,709
2023121303009	S	USDMXN	12/14/2023	(40,000,000)	17.33	693,000,000
2023121303128	S	USDMXN	12/14/2023	(55,000,000)	17.39	956,450,000
2023121303212	S	USDMXN	12/15/2023	(70,000,000)	17.38	1,216,600,000
2023121303406	S	USDMXN	12/15/2023	(30,000,000)	17.42	522,450,000
2023121303488	S	USDMXN	12/15/2023	(30,000,000)	17.41	522,300,000
2023121303008	B	USDMXN	12/15/2023	227,099	17.32	(3,934,399)
2023121303010	B	USDMXN	12/15/2023	40,000,000	17.33	(693,118,000)
2023121303056	B	USDMXN	12/15/2023	108,902,334	17.36	(1,890,000,000)
2023121303129	B	USDMXN	12/15/2023	55,000,000	17.39	(956,615,000)
2023121303075	B	USDMXN	12/19/2023	53,209,905	17.37	(923,990,000)
2023121303057	S	USDMXN	12/22/2023	(108,771,970)	17.38	1,890,000,000
2023121303213	B	USDMXN	12/22/2023	70,000,000	17.40	(1,218,070,000)
2023121303489	B	USDMXN	01/16/2024	30,000,000	17.50	(525,045,000)
2023121303407	B	USDMXN	02/15/2024	30,000,000	17.59	(527,775,000)
2023121303400	BO	USDMXN	02/16/2024	1,169,791	17.59	(20,577,552)
2023121303076	S	USDMXN	02/26/2024	(52,616,024)	17.56	923,990,000
2023121403032	S	USDMXN	12/15/2023	(404,433)	17.37	7,023,903
2023121403035	S	USDMXN	12/15/2023	(50,000,000)	17.37	868,350,000
2023121403388	S	USDMXN	12/15/2023	(46,000,000)	17.30	795,800,000
2023121403719	S	USDMXN	12/18/2023	(15,000,000)	17.17	257,520,000
2023121403755	S	USDMXN	12/18/2023	(30,000,000)	17.20	516,120,000
2023121403033	B	USDMXN	12/18/2023	404,433	17.38	(7,027,543)
2023121403036	B	USDMXN	12/18/2023	50,000,000	17.38	(868,792,500)
2023121403389	B	USDMXN	12/18/2023	46,000,000	17.31	(796,207,100)
2023121403515	B	USDMXN	02/20/2024	30,000,000	17.47	(524,100,000)
2023121403516	S	USDMXN	03/19/2024	(30,000,000)	17.55	526,365,000
2023121403756	B	USDMXN	03/19/2024	30,000,000	17.46	(523,830,000)
2023121403720	B	USDMXN	12/18/2024	15,000,000	18.21	(273,082,500)
2023121503009	S	USDMXN	12/15/2023	(100,000,000)	17.29	1,728,500,000
2023121503011	B	USDMXN	12/15/2023	100,000,000	17.29	(1,728,500,000)
2023121503006	S	USDMXN	12/18/2023	(404,433)	17.27	6,985,200
2023121503314	S	USDMXN	12/18/2023	(57,000,000)	17.20	980,400,000
2023121503316	S	USDMXN	12/18/2023	(20,000,000)	17.21	344,100,000
2023121503012	S	USDMXN	12/19/2023	(100,000,000)	17.30	1,729,645,000
2023121503319	S	USDMXN	12/19/2023	(40,000,000)	17.20	688,000,000
2023121503007	B	USDMXN	12/19/2023	404,433	17.27	(6,986,452)
2023121503010	B	USDMXN	12/19/2023	100,000,000	17.29	(1,729,420,000)
2023121503315	B	USDMXN	12/19/2023	57,000,000	17.20	(980,573,850)
2023121503317	B	USDMXN	12/19/2023	20,000,000	17.21	(344,160,000)
2023121503324	B	USDMXN	12/19/2023	40,000,000	17.20	(688,000,000)
2023121503320	B	USDMXN	02/20/2024	40,000,000	17.38	(695,100,000)
2023121503325	S	USDMXN	04/19/2024	(40,000,000)	17.54	701,760,000
2023121503134	B	USDMXN	05/20/2024	15,000,000	17.65	(264,780,000)
2023121503135	S	USDMXN	12/19/2024	(15,000,000)	18.26	273,937,500
2023121803212	S	USDMXN	12/18/2023	(75,000,000)	17.28	1,296,000,000
2023121803215	B	USDMXN	12/18/2023	75,000,000	17.28	(1,296,000,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121803191	S	USDMXN	12/19/2023	(614,338)	17.26	10,602,309
2023121803204	S	USDMXN	12/19/2023	(81,000,000)	17.26	1,398,060,000
2023121803206	S	USDMXN	12/19/2023	(57,937,000)	17.26	999,992,620
2023121803209	S	USDMXN	12/19/2023	(63,000)	17.26	1,087,179
2023121803216	S	USDMXN	12/19/2023	(75,000,000)	17.28	1,296,217,500
2023121803213	B	USDMXN	12/19/2023	75,000,000	17.28	(1,296,217,500)
2023121803192	B	USDMXN	12/20/2023	614,338	17.26	(10,604,266)
2023121803205	B	USDMXN	12/20/2023	81,000,000	17.26	(1,398,311,100)
2023121803207	B	USDMXN	12/20/2023	57,937,000	17.26	(1,000,172,225)
2023121803210	B	USDMXN	12/20/2023	63,000	17.26	(1,087,380)
2023121803263	S	USDMXN	09/18/2024	(30,000,000)	18.04	541,200,000
2023121803266	B	USDMXN	09/18/2024	30,000,000	18.06	(541,807,365)
2023121803267	S	USDMXN	12/18/2024	(30,000,000)	18.32	549,700,635
2023121803264	B	USDMXN	12/18/2024	30,000,000	18.30	(549,090,000)
2023121903040	B	USDMXN	12/20/2023	766,089	17.13	(13,122,201)
2023121903041	S	USDMXN	12/21/2023	(766,089)	17.13	13,124,490
2023121903219	S	USDMXN	05/21/2024	(15,000,000)	17.51	262,620,000
2023121903220	B	USDMXN	09/23/2024	15,000,000	17.88	(268,170,000)
2023122003030	S	USDMXN	12/21/2023	(233,911)	17.06	3,991,334
2023122003034	S	USDMXN	12/21/2023	(40,000,000)	17.06	682,400,000
2023122003037	S	USDMXN	12/21/2023	(24,000,000)	17.06	409,440,000
2023122003040	S	USDMXN	12/21/2023	(50,000,000)	17.08	854,000,000
2023122003423	S	USDMXN	12/22/2023	(40,000,000)	17.06	682,200,000
2023122003427	S	USDMXN	12/22/2023	(15,000,000)	17.06	255,870,000
2023122003712	S	USDMXN	12/22/2023	(20,000,000)	17.11	342,200,000
2023122003031	B	USDMXN	12/22/2023	233,911	17.07	(3,992,036)
2023122003035	B	USDMXN	12/22/2023	40,000,000	17.06	(682,518,000)
2023122003038	B	USDMXN	12/22/2023	24,000,000	17.06	(409,510,800)
2023122003041	B	USDMXN	12/22/2023	50,000,000	17.08	(854,147,500)
2023122003099	B	USDMXN	12/22/2023	50,000,000	17.08	(854,000,000)
2023122003421	B	USDMXN	12/22/2023	40,000,000	17.06	(682,200,000)
2023122003100	S	USDMXN	12/29/2023	(50,000,000)	17.10	855,025,000
2023122003422	S	USDMXN	01/22/2024	(40,000,000)	17.14	685,700,000
2023122003185	B	USDMXN	01/23/2024	76,881,564	17.14	(1,317,750,000)
2023122003508	BO	USDMXN	02/06/2024	5,400,000	17.20	(92,883,533)
2023122003424	B	USDMXN	02/22/2024	40,000,000	17.23	(689,240,000)
2023122003186	S	USDMXN	03/22/2024	(76,139,712)	17.31	1,317,750,000
2023122003522	BO	USDMXN	04/05/2024	4,000,000	17.37	(69,481,468)
2023122003523	BO	USDMXN	04/05/2024	4,000,000	17.37	(69,484,268)
2023122003524	BO	USDMXN	04/05/2024	400,000	17.37	(6,948,267)
2023122003528	BO	USDMXN	05/06/2024	4,000,000	17.46	(69,851,194)
2023122003534	BO	USDMXN	05/06/2024	2,000,000	17.46	(34,926,397)
2023122003536	BO	USDMXN	05/06/2024	2,400,000	17.46	(41,912,712)
2023122003539	BO	USDMXN	05/06/2024	2,400,000	17.46	(41,912,712)
2023122003428	B	USDMXN	05/22/2024	15,000,000	17.50	(262,432,500)
2023122003713	B	USDMXN	12/23/2024	20,000,000	18.18	(363,540,000)
2023122103026	S	USDMXN	12/22/2023	(34,000,000)	17.08	580,720,000
2023122103028	S	USDMXN	12/22/2023	(719,940)	17.06	12,285,563
2023122103027	B	USDMXN	12/26/2023	34,000,000	17.09	(581,107,600)
2023122103029	B	USDMXN	12/26/2023	719,940	17.08	(12,293,991)
2023122203312	S	USDMXN	12/26/2023	(280,060)	16.98	4,755,257
2023122203416	B	USDMXN	12/26/2023	560,119	16.99	(9,515,080)
2023122203417	S	USDMXN	12/27/2023	(560,119)	16.99	9,516,592
2023122203313	B	USDMXN	12/27/2023	280,060	16.98	(4,756,083)
2023122203618	BO	USDMXN	01/30/2024	400,000	17.08	(6,831,721)
2023122203624	BO	USDMXN	03/22/2024	380,000	17.23	(6,548,520)
2023122203329	BO	USDMXN	04/25/2024	5,700,000	17.33	(98,781,006)
2023122203337	BO	USDMXN	05/28/2024	5,400,000	17.43	(94,112,772)
2023122203676	SO	USDMXN	06/12/2024	(15,100,000)	17.59	265,545,580

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023122203680	SO	USDMXN	06/12/2024	(15,100,000)	17.59	265,545,580
2023122203682	SO	USDMXN	07/10/2024	(15,000,000)	17.59	263,787,000
2023122203685	SO	USDMXN	08/14/2024	(15,000,000)	17.59	263,787,000
2023122203688	SO	USDMXN	09/11/2024	(15,000,000)	17.59	263,787,000
2023122203690	BO	USDMXN	01/31/2025	2,850,000	18.16	(51,750,300)
2023122203691	BO	USDMXN	02/28/2025	2,840,000	18.24	(51,795,920)
2023122203692	BO	USDMXN	03/21/2025	2,960,000	18.30	(54,176,880)
2023122603024	S	USDMXN	12/27/2023	(169,940)	16.97	2,884,447
2023122603027	S	USDMXN	12/27/2023	(46,000,000)	16.96	779,930,000
2023122603029	S	USDMXN	12/27/2023	(40,000,000)	16.96	678,200,000
2023122603269	S	USDMXN	12/28/2023	(181,951)	16.96	3,086,333
2023122603284	S	USDMXN	12/28/2023	(559,409)	16.96	9,488,874
2023122603025	B	USDMXN	12/28/2023	169,940	16.98	(2,885,028)
2023122603028	B	USDMXN	12/28/2023	46,000,000	16.96	(780,063,400)
2023122603030	B	USDMXN	12/28/2023	40,000,000	16.96	(678,316,000)
2023122603245	BO	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	17.23	(17,226,579)
2023122603247	BO	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	17.23	(17,227,279)
2023122603248	BO	USDMXN	03/27/2024	402,182	17.23	(6,928,791)
2023122703092	B	MXNUSD	12/27/2023	68,387,820	16.96	(4,033,189)
2023122703088	B	USDMXN	12/27/2023	4,032,301	16.96	(68,387,820)
2023122703001	S	USDMXN	12/28/2023	(425,114)	16.95	7,204,087
2023122703003	S	USDMXN	12/28/2023	(56,000,000)	16.94	948,612,000
2023122703060	S	USDMXN	12/28/2023	(12,000,000)	16.95	203,400,000
2023122703089	S	USDMXN	12/28/2023	(4,031,611)	16.96	68,387,820
2023122703093	S	MXNUSD	12/28/2023	(68,387,820)	16.96	4,032,493
2023122703036	S	USDMXN	12/29/2023	(353,460,972)	16.98	6,000,000,000
2023122703002	B	USDMXN	12/29/2023	425,114	16.95	(7,205,472)
2023122703004	B	USDMXN	12/29/2023	56,000,000	16.94	(948,771,600)
2023122703061	B	USDMXN	12/29/2023	12,000,000	16.95	(203,434,200)
2023122703079	B	USDMXN	12/29/2023	100,000,000	16.95	(1,695,000,000)
2023122703081	B	USDMXN	12/29/2023	100,000,000	16.95	(1,695,000,000)
2023122703083	B	USDMXN	12/29/2023	100,000,000	16.97	(1,697,000,000)
2023122703340	SON	USDMXN	01/02/2024	(70,880,095)	16.93	1,200,000,000
2023122703080	S	USDMXN	03/27/2024	(100,000,000)	17.20	1,719,750,000
2023122703082	S	USDMXN	03/27/2024	(100,000,000)	17.20	1,719,750,000
2023122703084	S	USDMXN	03/27/2024	(100,000,000)	17.22	1,721,850,000
2023122703037	B	USDMXN	03/27/2024	348,391,592	17.22	(6,000,000,000)
2023122803289	S	USDMXN	12/29/2023	(338,733,432)	16.98	5,750,000,000
2023122803295	S	USDMXN	12/29/2023	(14,727,541)	16.98	250,000,000
2023122803313	S	USDMXN	12/29/2023	(338,733,432)	16.98	5,750,000,000
2023122803065	B	USDMXN	12/29/2023	244,892	16.90	(4,138,613)
2023122803068	B	USDMXN	12/29/2023	32,000,000	16.93	(541,600,000)
2023122803066	S	USDMXN	01/02/2024	(244,892)	16.91	4,140,357
2023122803069	S	USDMXN	01/02/2024	(32,000,000)	16.93	541,913,600
2023122803153	S	USDMXN	01/02/2024	(50,000,000)	16.91	845,400,000
2023122803358	SO	USDMXN	01/16/2024	(275,000)	16.95	4,660,235
2023122803673	BO	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	16.99	(16,987,592)
2023122803674	BO	USDMXN	01/16/2024	2,000,000	16.99	(33,972,486)
2023122803677	BO	USDMXN	01/16/2024	476,043	16.99	(8,086,919)
2023122803689	BO	USDMXN	01/16/2024	2,000,000	16.99	(33,972,486)
2023122803515	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96	(33,929,142)
2023122803517	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.97	(33,930,342)
2023122803518	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96	(33,929,740)
2023122803541	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96	(33,929,142)
2023122803543	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.97	(33,930,342)
2023122803546	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96	(33,929,740)
2023122803554	BO	USDMXN	01/18/2024	338,891	16.97	(5,751,448)
2023122803702	SO	USDMXN	02/28/2024	(159,963)	17.08	2,732,583
2023122803154	B	USDMXN	03/04/2024	50,000,000	17.08	(853,975,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023122803290	B	USDMXN	03/27/2024	333,875,276	17.22	(5,750,000,000)
2023122803297	B	USDMXN	03/27/2024	14,516,316	17.22	(250,000,000)
2023122803314	B	USDMXN	03/27/2024	333,875,276	17.22	(5,750,000,000)
2023122903036	B	USDMXN	01/02/2024	962,139	16.90	(16,261,922)
2023122903103	B	USDMXN	01/02/2024	60,000,000	16.90	(1,014,240,000)
2023122903037	S	USDMXN	01/03/2024	(962,139)	16.90	16,263,810
2023122903104	S	USDMXN	01/03/2024	(60,000,000)	16.91	1,014,384,000
2023122903298	S	USDMXN	01/03/2024	(80,000,000)	16.91	1,352,800,000
2023122903300	B	USDMXN	01/03/2024	80,000,000	16.91	(1,352,800,000)
2023122903534	B	USDMXN	01/03/2024	10,000,000	16.94	(169,420,000)
2023122903536	B	USDMXN	01/03/2024	10,000,000	16.96	(169,550,000)
2023122903049	SO	USDMXN	01/17/2024	(91,779)	16.93	1,554,046
2023122903301	S	USDMXN	02/06/2024	(80,000,000)	17.00	1,360,160,000
2023122903299	B	USDMXN	03/04/2024	80,000,000	17.08	(1,366,160,000)
2023122903535	S	USDMXN	01/03/2025	(10,000,000)	17.98	179,830,000
2023122903537	S	USDMXN	01/03/2025	(10,000,000)	18.00	179,960,000
2023122903342	BO	USDMXN	03/28/2025	2,950,000	18.15	(53,542,500)
2023122903346	BO	USDMXN	03/28/2025	2,950,000	18.15	(53,542,500)
2023100303018	BO	EURUSD	10/03/2023	3,000,000	1.05	(3,143,460)
2023100503032	BO	EURUSD	10/05/2023	3,000,000	1.05	(3,155,406)
2023101103116	B	EURUSD	10/13/2023	1,000,000	1.06	(1,061,360)
2023101103121	S	EURUSD	10/13/2023	(1,000,000)	1.06	1,062,000
2023101703040	B	EURUSD	10/19/2023	2,000,000	1.06	(2,116,520)
2023101703034	S	EURUSD	10/19/2023	(1,000,000)	1.06	1,056,900
2023101703041	S	EURUSD	10/19/2023	(1,000,000)	1.06	1,058,190
2023101903470	BO	EURUSD	10/20/2023	700,000	1.06	(741,563)
2023101903569	BO	EURMXN	11/21/2023	800,000	19.49	(15,588,247)
2023102003514	B	EURUSD	10/24/2023	1,000,000	1.06	(1,059,240)
2023102003536	B	EURUSD	10/24/2023	1,000,000	1.06	(1,059,240)
2023102003540	B	EURUSD	10/24/2023	1,000,000	1.06	(1,059,170)
2023102003530	S	EURUSD	10/24/2023	(1,000,000)	1.06	1,059,210
2023102003534	S	EURUSD	10/24/2023	(1,000,000)	1.06	1,059,240
2023102003542	S	EURUSD	10/24/2023	(1,000,000)	1.06	1,059,190
2023102403032	B	EURUSD	10/26/2023	1,000,000	1.06	(1,060,940)
2023102403044	S	EURUSD	10/26/2023	(1,000,000)	1.06	1,059,610
2023102603601	BO	EURMXN	11/09/2023	225,700	19.21	(4,336,705)
2023102603600	BO	EURMXN	01/18/2024	205,200	19.52	(4,005,479)
2023102703106	B	EURUSD	10/31/2023	1,000,000	1.06	(1,058,710)
2023102703144	B	EURUSD	10/31/2023	1,000,000	1.06	(1,059,410)
2023102703117	S	EURUSD	10/31/2023	(1,000,000)	1.06	1,058,960
2023102703118	S	EURUSD	10/31/2023	(1,000,000)	1.06	1,058,710
2023110103033	B	EURUSD	11/03/2023	1,000,000	1.05	(1,054,220)
2023110103083	B	EURUSD	11/03/2023	1,000,000	1.06	(1,055,990)
2023110103161	B	EURUSD	11/03/2023	1,000,000	1.05	(1,054,220)
2023110103042	S	EURUSD	11/03/2023	(1,000,000)	1.05	1,054,800
2023110103089	S	EURUSD	11/03/2023	(1,000,000)	1.06	1,055,400
2023110103194	S	EURUSD	11/03/2023	(1,000,000)	1.05	1,053,680
2023110103370	S	EURMXN	11/06/2023	(1,800,000)	18.91	34,032,240
2023110103371	B	EURMXN	11/10/2023	1,800,000	18.92	(34,059,585)
2023110303470	S	EURMXN	11/07/2023	(231,100)	18.69	4,320,345
2023110303472	S	EURMXN	11/07/2023	(1,161,200)	18.70	21,713,395
2023110303474	S	EURMXN	11/07/2023	(1,107,700)	18.70	20,712,328
2023110303471	B	EURMXN	11/10/2023	231,100	18.71	(4,322,839)
2023110303473	B	EURMXN	01/19/2024	1,161,200	18.99	(22,047,396)
2023110303475	B	EURMXN	02/20/2024	1,107,700	19.12	(21,174,874)
2023110703257	BO	EURUSD	11/08/2023	3,000,000	1.07	(3,205,647)
2023110803139	B	EURUSD	11/10/2023	1,000,000	1.07	(1,069,730)
2023110803199	B	EURUSD	11/10/2023	1,000,000	1.07	(1,071,180)
2023110803162	S	EURUSD	11/10/2023	(1,000,000)	1.07	1,069,750

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023110803187	S	EURUSD	11/10/2023	(1,000,000)	1.07	1,070,560
2023110903207	BO	EURMXN	11/10/2023	4,000,000	18.72	(74,864,724)
2023110903266	BO	EURMXN	11/10/2023	5,000,000	18.71	(93,563,905)
2023110903094	B	EURUSD	11/13/2023	1,000,000	1.07	(1,071,290)
2023110903152	S	EURUSD	11/13/2023	(1,000,000)	1.07	1,071,440
2023111003128	BO	EURUSD	11/13/2023	1,000,000	1.07	(1,066,719)
2023111303177	B	EURUSD	11/15/2023	1,000,000	1.07	(1,068,940)
2023111303232	B	EURUSD	11/15/2023	1,000,000	1.07	(1,069,270)
2023111303141	S	EURUSD	11/15/2023	(1,000,000)	1.07	1,068,820
2023111303144	S	EURUSD	11/15/2023	(1,000,000)	1.07	1,068,950
2023111403127	B	EURUSD	11/16/2023	1,000,000	1.08	(1,082,890)
2023111403041	S	EURUSD	11/16/2023	(1,000,000)	1.08	1,082,580
2023111503043	B	EURUSD	11/17/2023	1,000,000	1.08	(1,084,490)
2023111503200	B	EURUSD	11/17/2023	1,000,000	1.09	(1,085,160)
2023111503109	S	EURUSD	11/17/2023	(1,000,000)	1.08	1,084,630
2023111503131	S	EURUSD	11/17/2023	(1,000,000)	1.08	1,083,880
2023111503571	BO	EURMXN	01/19/2024	200,000	19.04	(3,808,111)
2023111503572	BO	EURMXN	02/16/2024	230,000	19.15	(4,405,249)
2023111503575	BO	EURMXN	03/22/2024	40,000	19.30	(771,814)
2023111503576	BO	EURMXN	04/02/2024	200,000	19.34	(3,868,548)
2023111503577	BO	EURMXN	05/14/2024	290,000	19.52	(5,659,812)
2023111503580	BO	EURMXN	06/21/2024	40,000	19.67	(786,966)
2023111503581	BO	EURMXN	07/19/2024	200,000	19.79	(3,958,341)
2023111503582	BO	EURMXN	08/16/2024	230,000	19.91	(4,578,432)
2023111503583	BO	EURMXN	09/27/2024	40,000	20.08	(803,123)
2023111503585	BO	EURMXN	10/02/2024	200,000	20.10	(4,019,646)
2023111503586	BO	EURMXN	11/15/2024	300,000	20.28	(6,083,714)
2023111503587	BO	EURMXN	12/20/2024	30,000	20.44	(613,062)
2023112103060	B	EURUSD	11/24/2023	1,000,000	1.10	(1,095,720)
2023112103066	B	EURUSD	11/24/2023	1,000,000	1.09	(1,094,620)
2023112103047	S	EURUSD	11/24/2023	(1,000,000)	1.09	1,094,630
2023112103097	S	EURUSD	11/24/2023	(1,000,000)	1.09	1,094,550
2023112703194	B	EURUSD	11/29/2023	1,000,000	1.09	(1,093,080)
2023112703351	S	EURUSD	11/29/2023	(1,000,000)	1.09	1,093,760
2023112803030	B	EURUSD	11/30/2023	1,000,000	1.10	(1,097,720)
2023112803053	B	EURUSD	11/30/2023	1,000,000	1.10	(1,098,650)
2023112803054	B	EURUSD	11/30/2023	1,000,000	1.10	(1,098,690)
2023112803034	S	EURUSD	11/30/2023	(1,000,000)	1.10	1,098,200
2023112803136	S	EURUSD	11/30/2023	(2,000,000)	1.10	2,195,000
2023112903251	B	EURUSD	12/01/2023	1,000,000	1.10	(1,096,540)
2023112903324	S	EURUSD	12/01/2023	(1,000,000)	1.10	1,097,000
2023113003120	B	EURUSD	12/04/2023	1,000,000	1.09	(1,091,580)
2023113003051	S	EURUSD	12/04/2023	(1,000,000)	1.09	1,089,270
2023120103039	B	EURMXN	12/05/2023	1,000,000	18.71	(18,709,240)
2023120103037	S	EURMXN	12/05/2023	(1,000,000)	18.71	18,714,050
2023120403297	B	EURUSD	12/06/2023	1,000,000	1.08	(1,082,270)
2023120403267	S	EURUSD	12/06/2023	(1,000,000)	1.08	1,082,530
2023120503274	S	EURMXN	12/06/2023	(25,000,000)	18.85	471,213,523
2023120503275	B	EURMXN	03/05/2024	25,000,000	19.20	(480,001,620)
2023120603070	B	EURUSD	12/08/2023	1,000,000	1.08	(1,079,210)
2023120603120	B	EURUSD	12/08/2023	1,000,000	1.08	(1,079,690)
2023120603058	S	EURUSD	12/08/2023	(1,000,000)	1.08	1,079,840
2023120603112	S	EURUSD	12/08/2023	(1,000,000)	1.08	1,079,840
2023120703452	B	EURUSD	12/11/2023	1,000,000	1.08	(1,081,060)
2023120703577	S	EURUSD	12/11/2023	(1,000,000)	1.08	1,080,100
2023121103166	B	EURUSD	12/13/2023	1,000,000	1.07	(1,074,670)
2023121103162	S	EURUSD	12/13/2023	(1,000,000)	1.07	1,074,940
2023121403633	BO	EURMXN	12/15/2023	2,000,000	18.85	(37,698,136)
2023121503335	B	EURUSD	12/19/2023	1,000,000	1.09	(1,090,760)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121503376	S	EURUSD	12/19/2023	(1,000,000)	1.09	1,091,350
2023122103354	BO	EURUSD	12/22/2023	400,000	1.10	(439,274)
2023122203289	S	EURUSD	12/28/2023	(65,000,000)	1.10	71,613,100
2023122203290	B	EURUSD	03/05/2024	65,000,000	1.11	(71,827,425)
2023122603292	BO	EURMXN	12/27/2023	2,000,000	18.73	(37,452,016)
2023122603430	BO	EURMXN	12/27/2023	2,000,000	18.73	(37,452,412)
2023102303376	BO	GBPUSD	10/24/2023	5,000,000	1.23	(6,125,335)
2023102303441	BO	GBPUSD	10/24/2023	500,000	1.22	(612,359)
2023101003088	BO	JPYMXN	10/11/2023	10,100,000	0.12	(1,223,756)
2023100203340	SO	USDMXN	10/17/2023	(275,000)	17.54	4,823,197
2023100203419	BO	USDMXN	10/18/2023	80,745	17.74	(1,432,213)
2023100203341	SO	USDMXN	10/20/2023	(273,000)	17.55	4,790,489
2023100203420	BO	USDMXN	11/15/2023	150,255	17.82	(2,677,721)
2023100203269	SO	USDMXN	07/26/2024	(187,416)	18.53	3,472,790
2023100303189	BO	USDMXN	10/10/2023	199,000	17.95	(3,573,041)
2023100303197	SO	USDMXN	10/13/2023	(100,000)	17.90	1,790,239
2023100303199	SO	USDMXN	10/19/2023	(100,000)	17.92	1,791,983
2023100303198	SO	USDMXN	10/26/2023	(100,000)	17.94	1,794,098
2023100303200	SO	USDMXN	11/01/2023	(100,000)	17.96	1,795,913
2023100303297	BO	USDMXN	11/01/2023	595,000	17.96	(10,686,250)
2023100303170	SO	USDMXN	01/03/2024	(154,143)	18.16	2,799,008
2023100303169	SO	USDMXN	01/17/2024	(153,950)	18.21	2,803,096
2023100303493	SO	USDMXN	01/17/2024	(166,667)	18.23	3,038,575
2023100303494	SO	USDMXN	02/14/2024	(166,667)	18.32	3,053,446
2023100303496	SO	USDMXN	03/13/2024	(166,667)	18.41	3,067,864
2023100303167	SO	USDMXN	03/26/2024	(249,485)	18.44	4,601,405
2023100303495	SO	USDMXN	04/17/2024	(166,667)	18.52	3,086,409
2023100303497	SO	USDMXN	05/15/2024	(166,667)	18.61	3,101,089
2023100303498	SO	USDMXN	06/12/2024	(166,667)	18.70	3,116,056
2023100303196	SO	USDMXN	06/18/2024	(256,131)	18.74	4,800,142
2023100303149	SO	USDMXN	06/28/2024	(78,900)	18.71	1,476,485
2023100303499	SO	USDMXN	07/17/2024	(166,667)	18.81	3,134,829
2023100303500	SO	USDMXN	08/14/2024	(166,667)	18.90	3,149,350
2023100303501	SO	USDMXN	09/18/2024	(166,667)	19.01	3,167,736
2023100303502	SO	USDMXN	10/16/2024	(166,667)	19.09	3,181,777
2023100303503	SO	USDMXN	11/13/2024	(166,667)	19.16	3,193,686
2023100303504	SO	USDMXN	12/18/2024	(166,667)	19.25	3,208,570
2023100403610	S	USDMXN	10/05/2023	(20,000,000)	17.98	359,684,220
2023100403611	B	USDMXN	10/06/2023	20,000,000	17.99	(359,744,000)
2023100403339	BO	USDMXN	10/18/2023	24,352	18.02	(438,704)
2023100403177	BO	USDMXN	11/01/2023	595,000	18.05	(10,742,029)
2023100403624	BO	USDMXN	11/08/2023	101,750	18.08	(1,839,821)
2023100403163	SO	USDMXN	12/21/2023	(131,738)	18.23	2,400,990
2023100403162	SO	USDMXN	01/23/2024	(240,031)	18.33	4,399,141
2023100403157	SO	USDMXN	02/20/2024	(239,132)	18.41	4,402,747
2023100403338	SO	USDMXN	03/19/2024	(232,371)	18.50	4,299,810
2023100503379	SO	USDMXN	10/17/2023	(100,000)	18.22	1,822,243
2023100503068	SO	USDMXN	10/23/2023	(2,000,000)	18.19	36,380,400
2023100503342	SO	USDMXN	10/23/2023	(422,000)	18.14	7,655,007
2023100503069	SO	USDMXN	10/24/2023	(2,000,000)	18.19	36,386,330
2023100503377	SO	USDMXN	10/24/2023	(100,000)	18.24	1,824,336
2023100503507	BO	USDMXN	10/30/2023	506,852	18.30	(9,276,653)
2023100503278	SO	USDMXN	10/31/2023	(200,000)	18.27	3,654,769
2023100503378	SO	USDMXN	10/31/2023	(100,000)	18.26	1,826,479
2023100503380	SO	USDMXN	11/07/2023	(100,000)	18.29	1,828,711
2023100503381	SO	USDMXN	11/14/2023	(100,000)	18.31	1,830,911
2023100503527	SO	USDMXN	11/15/2023	(135,243)	18.33	2,479,286
2023100503382	SO	USDMXN	11/21/2023	(100,000)	18.33	1,833,087
2023100503383	SO	USDMXN	11/28/2023	(100,000)	18.35	1,835,274

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023100503502	SO	USDMXN	11/28/2023	(2,400,000)	18.39	44,127,664
2023100503150	SO	USDMXN	11/30/2023	(100,000)	18.32	1,831,717
2023100503385	SO	USDMXN	12/05/2023	(100,000)	18.37	1,837,462
2023100503151	SO	USDMXN	12/07/2023	(100,000)	18.34	1,833,898
2023100503384	SO	USDMXN	12/13/2023	(100,000)	18.40	1,839,983
2023100503386	SO	USDMXN	12/19/2023	(100,000)	18.42	1,841,923
2023100503387	SO	USDMXN	12/26/2023	(100,000)	18.43	1,843,273
2023100503388	SO	USDMXN	01/02/2024	(100,000)	18.45	1,844,867
2023100503389	SO	USDMXN	01/09/2024	(100,000)	18.48	1,848,065
2023100503390	SO	USDMXN	01/16/2024	(100,000)	18.50	1,850,392
2023100503391	SO	USDMXN	01/23/2024	(100,000)	18.53	1,852,572
2023100503452	SO	USDMXN	04/02/2024	(100,000)	18.82	1,882,051
2023100503665	SO	USDMXN	06/27/2024	(100,000)	19.09	1,909,300
2023100503135	SO	USDMXN	07/26/2024	(168,000)	19.18	3,222,144
2023100603481	SO	USDMXN	10/24/2023	(133,000)	18.39	2,445,741
2023100603340	BO	USDMXN	11/01/2023	595,000	18.22	(10,842,750)
2023100603556	BO	USDMXN	11/01/2023	15,200	18.26	(277,488)
2023100603558	BO	USDMXN	11/08/2023	38,600	18.28	(705,495)
2023100603585	BO	USDMXN	11/08/2023	47,900	18.27	(875,121)
2023100603562	BO	USDMXN	11/28/2023	3,764	18.34	(69,033)
2023100603569	BO	USDMXN	03/11/2024	1,228	18.67	(22,931)
2023100903347	S	USDMXN	10/11/2023	(595,000)	18.22	10,838,342
2023100903420	BO	USDMXN	10/18/2023	56,496	18.21	(1,028,677)
2023100903419	BO	USDMXN	10/25/2023	56,496	18.23	(1,029,884)
2023100903371	SO	USDMXN	10/27/2023	(273,000)	18.35	5,009,876
2023100903348	B	USDMXN	11/01/2023	595,000	18.28	(10,878,117)
2023100903421	BO	USDMXN	11/01/2023	56,496	18.25	(1,031,141)
2023100903054	SO	USDMXN	11/08/2023	(26,250)	18.36	482,004
2023100903422	BO	USDMXN	11/08/2023	56,496	18.27	(1,032,394)
2023100903477	BO	USDMXN	11/08/2023	26,250	18.31	(480,717)
2023100903423	BO	USDMXN	11/15/2023	56,496	18.30	(1,033,645)
2023100903476	BO	USDMXN	11/15/2023	21,650	18.34	(397,005)
2023100903424	BO	USDMXN	11/22/2023	56,496	18.32	(1,034,889)
2023100903425	BO	USDMXN	11/29/2023	56,496	18.34	(1,036,133)
2023100903427	BO	USDMXN	12/06/2023	56,496	18.36	(1,037,377)
2023100903428	BO	USDMXN	12/13/2023	56,496	18.38	(1,038,622)
2023100903429	BO	USDMXN	12/20/2023	56,496	18.41	(1,039,871)
2023100903431	BO	USDMXN	12/27/2023	56,496	18.44	(1,041,622)
2023100903430	BO	USDMXN	01/03/2024	56,496	18.46	(1,042,875)
2023100903432	BO	USDMXN	01/10/2024	56,496	18.47	(1,043,731)
2023100903434	BO	USDMXN	01/17/2024	56,496	18.50	(1,044,928)
2023100903433	BO	USDMXN	01/24/2024	56,496	18.52	(1,046,182)
2023100903435	BO	USDMXN	01/31/2024	56,496	18.54	(1,047,436)
2023100903436	BO	USDMXN	02/07/2024	56,496	18.56	(1,048,690)
2023100903437	BO	USDMXN	02/14/2024	56,496	18.58	(1,049,945)
2023100903438	BO	USDMXN	02/21/2024	56,496	18.61	(1,051,201)
2023100903439	BO	USDMXN	02/28/2024	56,496	18.63	(1,052,457)
2023100903440	BO	USDMXN	03/06/2024	56,496	18.65	(1,053,714)
2023100903441	BO	USDMXN	03/13/2024	56,496	18.67	(1,054,973)
2023100903442	BO	USDMXN	03/20/2024	56,496	18.70	(1,056,241)
2023100903443	BO	USDMXN	03/27/2024	56,496	18.72	(1,057,485)
2023100903444	BO	USDMXN	04/03/2024	56,496	18.74	(1,058,730)
2023100903426	BO	USDMXN	04/10/2024	56,496	18.76	(1,059,974)
2023101003538	S	USDMXN	10/11/2023	(500,000)	17.99	8,994,168
2023101003212	S	USDMXN	10/12/2023	(1,000,000)	18.00	18,002,450
2023101003350	S	USDMXN	10/12/2023	(1,000,000)	17.98	17,980,000
2023101003389	S	USDMXN	10/12/2023	(511,463)	17.99	9,198,892
2023101003397	S	USDMXN	10/12/2023	(750,000)	17.99	13,492,500
2023101003398	S	USDMXN	10/12/2023	(13,888,975)	17.99	249,909,883

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023101003515	S	USDMXN	10/12/2023	(225,000)	18.00	4,049,775
2023101003517	S	USDMXN	10/12/2023	(225,000)	18.00	4,049,618
2023101003520	S	USDMXN	10/12/2023	(200,000)	18.00	3,599,600
2023101003522	S	USDMXN	10/12/2023	(200,000)	18.00	3,599,640
2023101003524	S	USDMXN	10/12/2023	(200,000)	18.00	3,599,640
2023101003526	S	USDMXN	10/12/2023	(200,000)	18.00	3,599,580
2023101003528	S	USDMXN	10/12/2023	(200,000)	18.00	3,599,560
2023101003531	S	USDMXN	10/12/2023	(150,000)	18.00	2,699,685
2023101003532	S	USDMXN	10/12/2023	(200,000)	18.00	3,599,600
2023101003534	S	USDMXN	10/12/2023	(200,000)	18.00	3,599,820
2023101003604	S	USDMXN	10/12/2023	(595,000)	18.01	10,713,332
2023101003750	S	USDMXN	10/12/2023	(5,000,000)	17.94	89,700,000
2023101003755	S	USDMXN	10/12/2023	(549,824)	17.94	9,863,842
2023101003059	B	USDMXN	10/12/2023	595,000	18.03	(10,726,380)
2023101003134	B	USDMXN	10/12/2023	1,000,000	18.00	(18,000,830)
2023101003145	B	USDMXN	10/12/2023	5,000,000	17.99	(89,935,000)
2023101003147	B	USDMXN	10/12/2023	5,000,000	17.99	(89,925,000)
2023101003149	B	USDMXN	10/12/2023	2,000,000	17.99	(35,970,000)
2023101003151	B	USDMXN	10/12/2023	880,000	17.98	(15,823,368)
2023101003280	B	USDMXN	10/12/2023	1,000,000	17.97	(17,970,000)
2023101003362	B	USDMXN	10/12/2023	256,946	17.98	(4,620,421)
2023101003365	B	USDMXN	10/12/2023	268,341	17.98	(4,825,444)
2023101003366	B	USDMXN	10/12/2023	268,976	17.99	(4,838,776)
2023101003369	B	USDMXN	10/12/2023	275,616	17.99	(4,957,979)
2023101003372	B	USDMXN	10/12/2023	249,106	17.99	(4,481,496)
2023101003376	B	USDMXN	10/12/2023	249,552	17.98	(4,487,926)
2023101003378	B	USDMXN	10/12/2023	233,658	17.99	(4,202,409)
2023101003380	B	USDMXN	10/12/2023	152,764	17.99	(2,747,879)
2023101003382	B	USDMXN	10/12/2023	153,146	17.99	(2,754,565)
2023101003384	B	USDMXN	10/12/2023	153,357	17.99	(2,758,417)
2023101003541	B	USDMXN	10/12/2023	8,975	18.00	(161,579)
2023101003724	B	USDMXN	10/12/2023	5,549,824	17.93	(99,503,349)
2023101003516	B	USDMXN	10/18/2023	225,000	18.02	(4,053,984)
2023101003653	BO	USDMXN	10/18/2023	58,800	18.01	(1,058,906)
2023101003112	BO	USDMXN	10/24/2023	4,000	18.09	(72,355)
2023101003115	SO	USDMXN	10/25/2023	(40,000)	18.09	723,663
2023101003518	B	USDMXN	10/25/2023	225,000	18.04	(4,058,663)
2023101003714	S	USDMXN	10/30/2023	(234,603)	17.97	4,216,429
2023101003716	S	USDMXN	10/30/2023	(3,440,574)	17.98	61,855,525
2023101003720	S	USDMXN	10/30/2023	(775,000)	17.98	13,933,593
2023101003725	S	USDMXN	10/30/2023	(5,549,824)	17.98	99,805,061
2023101003521	B	USDMXN	11/01/2023	200,000	18.06	(3,612,070)
2023101003605	B	USDMXN	11/01/2023	595,000	18.07	(10,750,444)
2023101003763	BO	USDMXN	11/01/2023	16,600	18.00	(298,852)
2023101003523	B	USDMXN	11/08/2023	200,000	18.08	(3,616,456)
2023101003766	BO	USDMXN	11/08/2023	49,800	18.02	(897,635)
2023101003539	B	USDMXN	11/10/2023	500,000	18.08	(9,040,682)
2023101003111	SO	USDMXN	11/15/2023	(5,027)	18.14	91,199
2023101003525	B	USDMXN	11/15/2023	200,000	18.10	(3,620,789)
2023101003762	BO	USDMXN	11/15/2023	51,000	18.05	(920,447)
2023101003765	BO	USDMXN	11/15/2023	16,600	18.05	(299,588)
2023101003399	B	USDMXN	11/21/2023	13,888,975	18.12	(251,636,045)
2023101003527	B	USDMXN	11/22/2023	200,000	18.13	(3,625,132)
2023101003715	B	USDMXN	11/28/2023	234,603	18.06	(4,237,814)
2023101003529	B	USDMXN	11/29/2023	200,000	18.15	(3,629,516)
2023101003721	B	USDMXN	12/01/2023	775,000	18.08	(14,011,513)
2023101003429	BO	USDMXN	12/05/2023	50,000	18.17	(908,259)
2023101003535	B	USDMXN	12/06/2023	200,000	18.17	(3,633,960)
2023101003431	BO	USDMXN	12/08/2023	50,000	18.17	(908,731)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023101003662	BO	USDMXN	12/08/2023	58,800	18.16	(1,067,707)
2023101003663	BO	USDMXN	12/08/2023	1,200	18.16	(21,792)
2023101003430	BO	USDMXN	12/11/2023	50,000	18.18	(909,202)
2023101003651	BO	USDMXN	12/11/2023	85,400	18.18	(1,552,318)
2023101003432	BO	USDMXN	12/13/2023	50,000	18.19	(909,517)
2023101003536	B	USDMXN	12/13/2023	200,000	18.19	(3,638,583)
2023101003109	BO	USDMXN	12/14/2023	1,425	18.23	(25,980)
2023101003433	BO	USDMXN	12/18/2023	50,000	18.21	(910,287)
2023101003428	BO	USDMXN	12/19/2023	50,000	18.21	(910,441)
2023101003533	B	USDMXN	12/20/2023	150,000	18.21	(2,732,125)
2023101003435	BO	USDMXN	12/21/2023	50,000	18.22	(910,788)
2023101003434	BO	USDMXN	12/28/2023	50,000	18.24	(912,198)
2023101003385	S	USDMXN	01/03/2024	(153,357)	18.24	2,796,887
2023101003717	B	USDMXN	01/16/2024	3,440,574	18.22	(62,693,270)
2023101003383	S	USDMXN	01/17/2024	(153,146)	18.29	2,800,426
2023101003381	S	USDMXN	01/31/2024	(152,764)	18.33	2,800,265
2023101003379	S	USDMXN	02/28/2024	(233,658)	18.41	4,302,705
2023101003377	S	USDMXN	03/13/2024	(249,552)	18.46	4,605,760
2023101003373	S	USDMXN	03/26/2024	(249,106)	18.50	4,609,071
2023101003370	S	USDMXN	04/10/2024	(275,616)	18.55	5,111,836
2023101003368	S	USDMXN	05/08/2024	(268,976)	18.63	5,012,108
2023101003367	S	USDMXN	05/22/2024	(268,341)	18.67	5,009,923
2023101003363	S	USDMXN	06/05/2024	(256,946)	18.71	4,808,125
2023101103037	S	USDMXN	10/13/2023	(1,000,000)	17.84	17,836,270
2023101103094	S	USDMXN	10/13/2023	(595,000)	17.84	10,614,860
2023101103190	S	USDMXN	10/13/2023	(1,000,000)	17.85	17,850,000
2023101103248	S	USDMXN	10/13/2023	(326,282)	17.86	5,825,828
2023101103475	S	USDMXN	10/13/2023	(200,000)	17.84	3,568,400
2023101103013	B	USDMXN	10/13/2023	1,000,000	17.80	(17,798,950)
2023101103041	B	USDMXN	10/13/2023	595,000	17.83	(10,609,029)
2023101103147	B	USDMXN	10/13/2023	1,000,000	17.82	(17,822,510)
2023101103244	B	USDMXN	10/13/2023	91,151	17.87	(1,628,479)
2023101103246	B	USDMXN	10/13/2023	235,131	17.86	(4,200,587)
2023101103163	BO	USDMXN	10/18/2023	75,000	17.81	(1,335,561)
2023101103506	BO	USDMXN	10/18/2023	278,508	17.86	(4,973,885)
2023101103453	BO	USDMXN	10/19/2023	35,000	17.84	(624,364)
2023101103161	BO	USDMXN	10/25/2023	75,000	17.83	(1,337,208)
2023101103508	SO	USDMXN	10/30/2023	(293,000)	17.89	5,242,454
2023101103095	B	USDMXN	11/01/2023	595,000	17.90	(10,649,893)
2023101103160	BO	USDMXN	11/01/2023	75,000	17.85	(1,338,850)
2023101103358	BO	USDMXN	11/01/2023	595,000	17.91	(10,657,189)
2023101103507	BO	USDMXN	11/01/2023	34,000	17.90	(608,702)
2023101103361	BO	USDMXN	11/03/2023	24,998	17.95	(448,633)
2023101103162	BO	USDMXN	11/08/2023	75,000	17.87	(1,340,496)
2023101103360	BO	USDMXN	11/09/2023	27,597	17.97	(495,915)
2023101103321	BO	USDMXN	11/14/2023	2,000,000	17.96	(35,927,249)
2023101103327	BO	USDMXN	11/14/2023	3,000,000	17.96	(53,891,474)
2023101103164	BO	USDMXN	11/15/2023	75,000	17.90	(1,342,152)
2023101103363	BO	USDMXN	11/15/2023	16,600	17.99	(298,564)
2023101103226	B	USDMXN	11/17/2023	50,000	17.95	(897,682)
2023101103165	BO	USDMXN	11/22/2023	75,000	17.92	(1,343,825)
2023101103366	BO	USDMXN	11/22/2023	63,600	18.00	(1,144,557)
2023101103166	BO	USDMXN	11/29/2023	75,000	17.94	(1,345,498)
2023101103167	BO	USDMXN	12/06/2023	75,000	17.96	(1,347,171)
2023101103168	BO	USDMXN	12/13/2023	75,000	17.98	(1,348,844)
2023101103228	B	USDMXN	12/15/2023	50,000	18.04	(902,092)
2023101103169	BO	USDMXN	12/20/2023	75,000	18.01	(1,350,475)
2023101103170	BO	USDMXN	12/27/2023	75,000	18.03	(1,352,613)
2023101103171	BO	USDMXN	01/03/2024	125,000	18.06	(2,257,092)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023101103191	SO	USDMXN	01/09/2024	(243,107)	18.12	4,405,742
2023101103172	BO	USDMXN	01/10/2024	125,000	18.08	(2,259,418)
2023101103476	B	USDMXN	01/16/2024	200,000	18.14	(3,627,853)
2023101103173	BO	USDMXN	01/17/2024	125,000	18.09	(2,261,810)
2023101103230	B	USDMXN	01/17/2024	50,000	18.15	(907,277)
2023101103192	SO	USDMXN	01/23/2024	(242,479)	18.17	4,405,697
2023101103174	BO	USDMXN	01/24/2024	125,000	18.12	(2,264,604)
2023101103227	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000)	18.25	912,594
2023101103229	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000)	18.25	912,600
2023101103231	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000)	18.25	912,639
2023101103245	S	USDMXN	02/20/2024	(91,151)	18.27	1,665,540
2023101103247	S	USDMXN	03/05/2024	(235,131)	18.32	4,306,591
2023101103312	SO	USDMXN	04/29/2024	(97,455)	18.48	1,800,880
2023101103315	SO	USDMXN	05/28/2024	(140,035)	18.57	2,600,712
2023101103364	SO	USDMXN	06/25/2024	(150,110)	18.67	2,802,624
2023101203179	S	USDMXN	10/16/2023	(1,371,671)	17.91	24,564,159
2023101203182	S	USDMXN	10/16/2023	(1,080,773)	17.91	19,354,051
2023101203185	S	USDMXN	10/16/2023	(1,225,927)	17.90	21,949,487
2023101203187	S	USDMXN	10/16/2023	(1,203,054)	17.91	21,542,968
2023101203190	S	USDMXN	10/16/2023	(1,652,217)	17.91	29,585,424
2023101203193	S	USDMXN	10/16/2023	(1,338,484)	17.91	23,968,059
2023101203326	S	USDMXN	10/16/2023	(595,000)	17.88	10,639,790
2023101203453	S	USDMXN	10/16/2023	(5,000,000)	18.03	90,150,000
2023101203454	S	USDMXN	10/16/2023	(1,000,000)	18.04	18,035,330
2023101203532	S	USDMXN	10/16/2023	(400,000)	18.04	7,214,240
2023101203546	S	USDMXN	10/16/2023	(112,000)	18.03	2,019,416
2023101203314	B	USDMXN	10/16/2023	595,000	17.89	(10,644,645)
2023101203390	B	USDMXN	10/16/2023	1,000,000	17.95	(17,949,540)
2023101203429	B	USDMXN	10/16/2023	1,000,000	18.03	(18,028,630)
2023101203430	B	USDMXN	10/16/2023	1,000,000	18.03	(18,027,350)
2023101203493	B	USDMXN	10/16/2023	112,000	18.06	(2,022,800)
2023101203421	SO	USDMXN	10/19/2023	(400,000)	17.98	7,191,508
2023101203534	SO	USDMXN	10/19/2023	(400,000)	18.04	7,217,708
2023101203545	SO	USDMXN	10/19/2023	(179,486)	18.04	3,237,627
2023101203529	BO	USDMXN	10/19/2023	400,000	18.04	(7,217,905)
2023101203533	B	USDMXN	10/19/2023	400,000	18.05	(7,218,065)
2023101203548	BO	USDMXN	10/25/2023	41,800	18.06	(754,828)
2023101203716	SO	USDMXN	10/30/2023	(100,000)	18.01	1,801,381
2023101203658	SO	USDMXN	10/31/2023	(164,000)	18.04	2,958,656
2023101203327	B	USDMXN	11/01/2023	595,000	17.93	(10,669,342)
2023101203549	BO	USDMXN	11/01/2023	32,200	18.08	(582,177)
2023101203550	BO	USDMXN	11/08/2023	32,200	18.10	(582,803)
2023101203547	B	USDMXN	11/22/2023	112,000	18.15	(2,032,488)
2023101203180	B	USDMXN	01/24/2024	1,371,671	18.22	(24,994,650)
2023101203183	B	USDMXN	02/21/2024	1,080,773	18.31	(19,789,003)
2023101203186	B	USDMXN	03/20/2024	1,225,927	18.40	(22,552,104)
2023101203188	B	USDMXN	04/17/2024	1,203,054	18.49	(22,241,153)
2023101203191	B	USDMXN	05/15/2024	1,652,217	18.58	(30,693,196)
2023101203194	B	USDMXN	06/20/2024	1,338,484	18.69	(25,014,885)
2023101303554	S	USDMXN	10/17/2023	(595,000)	18.06	10,747,777
2023101303278	B	USDMXN	10/17/2023	595,000	18.05	(10,738,620)
2023101303555	B	USDMXN	11/01/2023	595,000	18.11	(10,775,524)
2023101303662	BO	USDMXN	11/15/2023	95,250	18.22	(1,734,986)
2023101303640	BO	USDMXN	11/22/2023	22,000	18.21	(400,660)
2023101603249	S	USDMXN	10/18/2023	(2,000,000)	17.97	35,930,000
2023101603291	S	USDMXN	10/18/2023	(2,000,000)	17.94	35,887,740
2023101603343	S	USDMXN	10/18/2023	(2,000,000)	17.94	35,880,000
2023101603347	S	USDMXN	10/18/2023	(3,000,000)	17.95	53,835,000
2023101603361	S	USDMXN	10/18/2023	(500,000)	17.96	8,980,300

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023101603362	S	USDMXN	10/18/2023	(180,000)	17.96	3,232,998
2023101603450	S	USDMXN	10/18/2023	(820,000)	17.92	14,693,908
2023101603345	B	USDMXN	10/18/2023	10,500,000	17.97	(188,632,500)
2023101603584	BO	USDMXN	10/25/2023	37,824	17.93	(678,056)
2023101603574	BO	USDMXN	10/26/2023	15,500	17.93	(277,950)
2023101603583	BO	USDMXN	10/30/2023	204,400	17.94	(3,667,378)
2023101603576	BO	USDMXN	11/08/2023	128,000	17.97	(2,300,563)
2023101603577	BO	USDMXN	11/10/2023	33,418	17.98	(600,834)
2023101603610	SO	USDMXN	11/28/2023	(61,053)	18.02	1,100,373
2023101603648	BO	USDMXN	11/28/2023	197,926	18.02	(3,567,062)
2023101603451	B	USDMXN	11/30/2023	820,000	18.05	(14,804,559)
2023101603219	SO	USDMXN	12/06/2023	(152,000)	18.11	2,753,209
2023101603582	BO	USDMXN	12/13/2023	35,977	18.08	(650,531)
2023101603644	BO	USDMXN	12/14/2023	2,200,000	18.07	(39,763,684)
2023101703096	BO	USDMXN	10/17/2023	2,000,000	17.93	(35,862,625)
2023101703039	S	USDMXN	10/19/2023	(1,000,000)	17.97	17,967,240
2023101703049	S	USDMXN	10/19/2023	(2,000,000)	17.96	35,916,500
2023101703060	S	USDMXN	10/19/2023	(3,000,000)	17.94	53,813,880
2023101703075	S	USDMXN	10/19/2023	(884,272)	17.96	15,877,456
2023101703077	S	USDMXN	10/19/2023	(985,387)	17.96	17,697,852
2023101703080	S	USDMXN	10/19/2023	(7,624,809)	17.96	136,932,420
2023101703084	S	USDMXN	10/19/2023	(4,437,530)	17.95	79,660,319
2023101703088	S	USDMXN	10/19/2023	(1,193,180)	17.95	21,414,723
2023101703210	S	USDMXN	10/19/2023	(576,369)	17.93	10,334,582
2023101703212	S	USDMXN	10/19/2023	(573,593)	17.93	10,283,950
2023101703214	S	USDMXN	10/19/2023	(290,557)	17.93	5,209,104
2023101703216	S	USDMXN	10/19/2023	(289,010)	17.93	5,181,624
2023101703259	S	USDMXN	10/19/2023	(595,000)	17.91	10,654,725
2023101703359	S	USDMXN	10/19/2023	(1,000,000)	17.91	17,910,000
2023101703451	S	USDMXN	10/19/2023	(300,000)	17.93	5,378,040
2023101703453	S	USDMXN	10/19/2023	(300,000)	17.92	5,377,470
2023101703455	S	USDMXN	10/19/2023	(300,000)	17.93	5,377,890
2023101703458	S	USDMXN	10/19/2023	(300,000)	17.93	5,377,890
2023101703489	S	USDMXN	10/19/2023	(3,000,000)	17.94	53,805,000
2023101703497	S	USDMXN	10/19/2023	(3,000,000)	17.94	53,820,000
2023101703579	S	USDMXN	10/19/2023	(595,000)	17.99	10,704,229
2023101703675	S	USDMXN	10/19/2023	(60,800)	17.99	1,094,029
2023101703033	B	USDMXN	10/19/2023	1,000,000	18.02	(18,018,170)
2023101703035	B	USDMXN	10/19/2023	1,000,000	18.01	(18,008,060)
2023101703043	B	USDMXN	10/19/2023	1,000,000	17.96	(17,962,820)
2023101703057	B	USDMXN	10/19/2023	3,000,000	17.97	(53,921,370)
2023101703095	B	USDMXN	10/19/2023	1,000,000	17.94	(17,937,350)
2023101703097	B	USDMXN	10/19/2023	200,000	17.93	(3,586,326)
2023101703206	B	USDMXN	10/19/2023	595,000	17.92	(10,659,693)
2023101703398	B	USDMXN	10/19/2023	175,625	17.91	(3,145,959)
2023101703400	B	USDMXN	10/19/2023	276,438	17.91	(4,952,244)
2023101703402	B	USDMXN	10/19/2023	153,526	17.91	(2,750,288)
2023101703404	B	USDMXN	10/19/2023	154,177	17.92	(2,762,458)
2023101703407	B	USDMXN	10/19/2023	234,716	17.92	(4,205,125)
2023101703505	B	USDMXN	10/19/2023	6,000,000	17.95	(107,708,400)
2023101703575	B	USDMXN	10/19/2023	595,000	18.00	(10,710,845)
2023101703651	B	USDMXN	10/19/2023	833,333	17.99	(14,995,083)
2023101703653	B	USDMXN	10/19/2023	833,333	18.00	(14,996,333)
2023101703655	B	USDMXN	10/19/2023	833,333	17.99	(14,995,583)
2023101703657	B	USDMXN	10/19/2023	833,333	17.99	(14,995,500)
2023101703659	B	USDMXN	10/19/2023	833,333	18.00	(14,997,000)
2023101703667	B	USDMXN	10/19/2023	833,333	18.00	(14,999,500)
2023101703671	B	USDMXN	10/19/2023	833,333	18.00	(15,000,083)
2023101703464	BO	USDMXN	10/25/2023	118,560	17.94	(2,127,062)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023101703676	B	USDMXN	10/25/2023	60,800	18.01	(1,095,166)
2023101703762	BO	USDMXN	10/25/2023	36,816	18.03	(663,888)
2023101703447	BO	USDMXN	10/26/2023	60,000	17.94	(1,076,215)
2023101703495	SO	USDMXN	10/30/2023	(2,000,000)	17.97	35,940,711
2023101703496	SO	USDMXN	10/30/2023	(500,000)	17.97	8,984,278
2023101703500	SO	USDMXN	10/30/2023	(2,000,000)	17.97	35,946,811
2023101703506	S	USDMXN	10/30/2023	(6,000,000)	17.98	107,908,266
2023101703438	BO	USDMXN	11/01/2023	60,000	17.96	(1,077,330)
2023101703465	BO	USDMXN	11/08/2023	76,000	17.98	(1,366,818)
2023101703436	BO	USDMXN	11/09/2023	60,000	17.98	(1,078,834)
2023101703076	B	USDMXN	11/10/2023	884,272	18.02	(15,938,335)
2023101703476	SO	USDMXN	11/15/2023	(1,283,774)	18.01	23,123,917
2023101703437	BO	USDMXN	11/16/2023	60,000	18.00	(1,080,148)
2023101703439	BO	USDMXN	11/22/2023	60,000	18.02	(1,081,278)
2023101703722	BO	USDMXN	11/22/2023	22,000	18.13	(398,763)
2023101703078	B	USDMXN	11/24/2023	985,387	18.07	(17,809,667)
2023101703466	BO	USDMXN	11/29/2023	35,750	18.05	(645,314)
2023101703260	B	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.04	(10,733,193)
2023101703440	BO	USDMXN	11/30/2023	60,000	18.05	(1,082,809)
2023101703580	B	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.12	(10,782,857)
2023101703081	B	USDMXN	12/01/2023	7,624,809	18.09	(137,967,030)
2023101703678	SO	USDMXN	12/06/2023	(58)	18.14	1,055
2023101703441	BO	USDMXN	12/07/2023	60,000	18.07	(1,084,148)
2023101703085	B	USDMXN	12/08/2023	4,437,530	18.11	(80,361,032)
2023101703010	SO	USDMXN	12/14/2023	(9,716)	18.23	177,152
2023101703442	BO	USDMXN	12/14/2023	60,000	18.09	(1,085,486)
2023101703443	BO	USDMXN	12/21/2023	60,000	18.11	(1,086,880)
2023101703089	B	USDMXN	12/22/2023	1,193,180	18.15	(21,656,100)
2023101703467	BO	USDMXN	12/27/2023	34,690	18.15	(629,504)
2023101703677	BO	USDMXN	12/27/2023	410	18.22	(7,469)
2023101703444	BO	USDMXN	12/28/2023	60,000	18.14	(1,088,606)
2023101703405	S	USDMXN	01/03/2024	(154,177)	18.16	2,799,189
2023101703445	BO	USDMXN	01/04/2024	60,000	18.17	(1,089,934)
2023101703446	BO	USDMXN	01/11/2024	60,000	18.18	(1,091,072)
2023101703662	SO	USDMXN	01/17/2024	(833,333)	18.29	15,245,459
2023101703403	S	USDMXN	01/31/2024	(153,526)	18.24	2,800,282
2023101703663	SO	USDMXN	02/14/2024	(833,333)	18.38	15,319,582
2023101703408	S	USDMXN	02/28/2024	(234,716)	18.33	4,302,115
2023101703211	B	USDMXN	02/28/2024	576,369	18.35	(10,574,305)
2023101703664	SO	USDMXN	03/13/2024	(833,333)	18.47	15,392,703
2023101703452	B	USDMXN	03/22/2024	300,000	18.42	(5,525,009)
2023101703213	B	USDMXN	03/27/2024	573,593	18.43	(10,573,541)
2023101703401	S	USDMXN	04/10/2024	(276,438)	18.46	5,102,566
2023101703665	SO	USDMXN	04/17/2024	(833,333)	18.58	15,484,522
2023101703454	B	USDMXN	04/22/2024	300,000	18.51	(5,553,948)
2023101703215	B	USDMXN	04/29/2024	290,557	18.54	(5,386,321)
2023101703312	SO	USDMXN	05/08/2024	(269,942)	18.53	5,001,148
2023101703652	S	USDMXN	05/15/2024	(833,333)	18.65	15,542,175
2023101703317	SO	USDMXN	05/22/2024	(269,426)	18.57	5,003,424
2023101703456	B	USDMXN	05/22/2024	300,000	18.61	(5,583,260)
2023101703217	B	USDMXN	05/30/2024	289,010	18.64	(5,386,403)
2023101703314	SO	USDMXN	06/05/2024	(258,134)	18.61	4,805,014
2023101703654	S	USDMXN	06/12/2024	(833,333)	18.74	15,617,017
2023101703311	SO	USDMXN	06/18/2024	(257,594)	18.65	4,803,682
2023101703459	B	USDMXN	06/21/2024	300,000	18.71	(5,611,911)
2023101703310	SO	USDMXN	07/03/2024	(176,688)	18.69	3,302,874
2023101703656	S	USDMXN	07/17/2024	(833,333)	18.85	15,708,050
2023101703399	S	USDMXN	07/31/2024	(175,625)	18.80	3,302,206
2023101703658	S	USDMXN	08/14/2024	(833,333)	18.94	15,779,796

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023101703660	S	USDMXN	09/18/2024	(833,333)	19.04	15,870,502
2023101703666	SO	USDMXN	10/16/2024	(833,333)	19.15	15,954,623
2023101703672	S	USDMXN	11/13/2024	(833,333)	19.21	16,009,920
2023101703668	S	USDMXN	12/18/2024	(833,333)	19.31	16,090,723
2023101803571	B	USDMXN	10/11/2023	500,000	18.12	(9,060,000)
2023101803065	S	USDMXN	10/20/2023	(1,000,000)	18.29	18,290,460
2023101803247	S	USDMXN	10/20/2023	(1,000,000)	18.28	18,280,000
2023101803590	S	USDMXN	10/20/2023	(500,000)	18.24	9,120,880
2023101803061	B	USDMXN	10/20/2023	1,000,000	18.26	(18,258,630)
2023101803239	B	USDMXN	10/20/2023	1,000,000	18.26	(18,258,770)
2023101803592	B	USDMXN	10/20/2023	1,000,000	18.26	(18,255,200)
2023101803441	SO	USDMXN	10/25/2023	(21,644)	18.24	394,794
2023101803394	SO	USDMXN	11/03/2023	(273,000)	18.17	4,959,090
2023101803489	SO	USDMXN	11/03/2023	(23,000)	18.30	420,837
2023101803443	BO	USDMXN	11/03/2023	23,000	18.28	(420,386)
2023101803232	SO	USDMXN	11/09/2023	(68,600)	18.32	1,256,539
2023101803593	S	USDMXN	11/10/2023	(1,000,000)	18.32	18,319,877
2023101803591	B	USDMXN	11/10/2023	500,000	18.31	(9,153,536)
2023101803445	BO	USDMXN	11/22/2023	36,700	18.34	(672,915)
2023101803364	BO	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.31	(10,896,727)
2023101803479	BO	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.39	(10,940,497)
2023101803219	SO	USDMXN	01/09/2024	(237,581)	18.52	4,400,643
2023101803178	SO	USDMXN	01/23/2024	(237,120)	18.56	4,401,717
2023101803179	SO	USDMXN	02/06/2024	(236,521)	18.61	4,400,936
2023101803180	SO	USDMXN	02/20/2024	(235,938)	18.65	4,400,897
2023101803217	SO	USDMXN	04/02/2024	(95,862)	18.79	1,801,551
2023101803218	SO	USDMXN	04/16/2024	(95,633)	18.84	1,801,539
2023101803244	SO	USDMXN	04/29/2024	(95,349)	18.88	1,800,013
2023101803240	SO	USDMXN	05/28/2024	(137,174)	18.96	2,601,058
2023101803170	SO	USDMXN	10/21/2024	(5,000,000)	19.48	97,417,185
2023101803171	SO	USDMXN	10/21/2024	(500,000)	19.48	9,741,684
2023101903146	S	USDMXN	10/23/2023	(5,000,000)	18.28	91,400,000
2023101903147	S	USDMXN	10/23/2023	(1,000,000)	18.29	18,285,690
2023101903389	S	USDMXN	10/23/2023	(33,200)	18.23	605,160
2023101903391	S	USDMXN	10/23/2023	(36,000)	18.22	656,017
2023101903393	S	USDMXN	10/23/2023	(38,000)	18.21	692,162
2023101903395	S	USDMXN	10/23/2023	(15,200)	18.22	276,926
2023101903398	S	USDMXN	10/23/2023	(88,800)	18.22	1,617,607
2023101903400	S	USDMXN	10/23/2023	(92,800)	18.22	1,690,463
2023101903402	S	USDMXN	10/23/2023	(92,800)	18.22	1,690,354
2023101903404	S	USDMXN	10/23/2023	(92,800)	18.21	1,690,101
2023101903609	S	USDMXN	10/23/2023	(2,545,965)	18.30	46,583,369
2023101903068	B	USDMXN	10/23/2023	2,000,000	18.35	(36,690,000)
2023101903069	B	USDMXN	10/23/2023	3,000,000	18.35	(55,050,000)
2023101903077	B	USDMXN	10/23/2023	5,000,000	18.36	(91,790,000)
2023101903081	B	USDMXN	10/23/2023	5,000,000	18.35	(91,750,000)
2023101903082	B	USDMXN	10/23/2023	2,000,000	18.35	(36,692,000)
2023101903083	B	USDMXN	10/23/2023	2,000,000	18.34	(36,679,700)
2023101903085	B	USDMXN	10/23/2023	5,000,000	18.34	(91,695,000)
2023101903086	B	USDMXN	10/23/2023	2,000,000	18.34	(36,670,940)
2023101903087	B	USDMXN	10/23/2023	3,000,000	18.33	(54,997,770)
2023101903090	B	USDMXN	10/23/2023	5,000,000	18.33	(91,625,000)
2023101903091	B	USDMXN	10/23/2023	3,000,000	18.32	(54,959,670)
2023101903093	B	USDMXN	10/23/2023	1,000,000	18.33	(18,328,030)
2023101903094	B	USDMXN	10/23/2023	2,000,000	18.33	(36,650,000)
2023101903097	B	USDMXN	10/23/2023	1,000,000	18.32	(18,320,000)
2023101903098	B	USDMXN	10/23/2023	2,000,000	18.32	(36,640,000)
2023101903203	B	USDMXN	10/23/2023	500,000	18.20	(9,100,100)
2023101903332	B	USDMXN	10/23/2023	4,500,000	18.24	(82,057,500)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023101903645	B	USDMXN	10/23/2023	2,545,965	18.33	(46,677,697)
2023101903588	S	USDMXN	10/30/2023	(3,590,362)	18.31	65,746,745
2023101903394	B	USDMXN	11/01/2023	38,000	18.24	(693,246)
2023101903369	SO	USDMXN	11/06/2023	(423,000)	18.40	7,781,585
2023101903396	B	USDMXN	11/15/2023	15,200	18.29	(278,025)
2023101903603	BO	USDMXN	11/16/2023	34,011	18.38	(625,122)
2023101903392	B	USDMXN	11/22/2023	36,000	18.32	(659,417)
2023101903646	BO	USDMXN	11/28/2023	145,998	18.46	(2,694,768)
2023101903390	B	USDMXN	12/06/2023	33,200	18.37	(609,794)
2023101903031	SO	USDMXN	12/07/2023	(100,000)	18.47	1,847,496
2023101903032	SO	USDMXN	12/14/2023	(100,000)	18.50	1,849,752
2023101903589	B	USDMXN	12/14/2023	3,590,362	18.46	(66,261,603)
2023101903610	B	USDMXN	12/14/2023	2,545,965	18.46	(47,003,445)
2023101903399	B	USDMXN	12/20/2023	88,800	18.40	(1,634,029)
2023101903401	B	USDMXN	12/27/2023	92,800	18.42	(1,709,756)
2023101903403	B	USDMXN	01/03/2024	92,800	18.44	(1,711,412)
2023101903405	B	USDMXN	01/10/2024	92,800	18.47	(1,713,619)
2023101903333	S	USDMXN	10/23/2024	(4,500,000)	19.40	87,300,000
2023102003515	S	USDMXN	10/24/2023	(1,000,000)	18.24	18,236,010
2023102003535	S	USDMXN	10/24/2023	(1,000,000)	18.23	18,228,100
2023102003548	S	USDMXN	10/24/2023	(1,000,000)	18.23	18,230,000
2023102003553	S	USDMXN	10/24/2023	(1,000,000)	18.24	18,239,100
2023102003529	B	USDMXN	10/24/2023	1,000,000	18.24	(18,235,530)
2023102003532	B	USDMXN	10/24/2023	1,000,000	18.23	(18,225,300)
2023102003539	B	USDMXN	10/24/2023	1,000,000	18.23	(18,228,550)
2023102003574	B	USDMXN	10/24/2023	1,000,000	18.24	(18,236,180)
2023102003359	SO	USDMXN	10/27/2023	(166,376)	18.24	3,035,028
2023102003358	SO	USDMXN	11/06/2023	(165,920)	18.27	3,030,600
2023102003020	SO	USDMXN	11/07/2023	(278,000)	18.43	5,122,581
2023102003357	SO	USDMXN	11/10/2023	(83,869)	18.28	1,532,948
2023102003363	SO	USDMXN	11/10/2023	(274,499)	18.28	5,019,129
2023102003503	BO	USDMXN	11/10/2023	1,000	18.30	(18,301)
2023102003360	SO	USDMXN	12/08/2023	(382,514)	18.37	7,028,065
2023102003120	SO	USDMXN	12/21/2023	(100,000)	18.62	1,862,050
2023102003119	SO	USDMXN	12/28/2023	(100,000)	18.64	1,863,775
2023102303086	S	USDMXN	10/25/2023	(2,000,000)	18.15	36,300,520
2023102303087	S	USDMXN	10/25/2023	(1,000,000)	18.15	18,149,570
2023102303098	S	USDMXN	10/25/2023	(1,000,000)	18.15	18,145,060
2023102303103	S	USDMXN	10/25/2023	(1,000,000)	18.16	18,160,550
2023102303123	S	USDMXN	10/25/2023	(1,000,000)	18.15	18,149,880
2023102303323	S	USDMXN	10/25/2023	(1,000,000)	18.13	18,127,050
2023102303377	S	USDMXN	10/25/2023	(1,000,000)	18.14	18,138,740
2023102303083	B	USDMXN	10/25/2023	1,000,000	18.17	(18,170,990)
2023102303135	B	USDMXN	10/25/2023	5,000,000	18.14	(90,675,500)
2023102303335	B	USDMXN	10/25/2023	1,000,000	18.10	(18,100,000)
2023102303393	B	USDMXN	10/25/2023	1,000,000	18.13	(18,132,930)
2023102303574	S	USDMXN	10/26/2023	(1,000,000)	18.14	18,142,000
2023102303230	SO	USDMXN	11/09/2023	(273,000)	18.39	5,020,186
2023102303173	SO	USDMXN	11/14/2023	(217,000)	18.16	3,941,409
2023102303338	SO	USDMXN	11/14/2023	(1,425)	18.17	25,891
2023102303520	SO	USDMXN	11/14/2023	(18,033)	18.19	328,110
2023102303404	BO	USDMXN	11/29/2023	300,000	18.20	(5,460,639)
2023102303244	BO	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.26	(10,864,847)
2023102403033	S	USDMXN	10/26/2023	(1,000,000)	18.13	18,132,050
2023102403127	S	USDMXN	10/26/2023	(1,000,000)	18.24	18,240,450
2023102403234	S	USDMXN	10/26/2023	(1,000,000)	18.25	18,251,700
2023102403294	S	USDMXN	10/26/2023	(3,000,000)	18.30	54,900,000
2023102403542	S	USDMXN	10/26/2023	(1,239,190)	18.25	22,620,055
2023102403544	S	USDMXN	10/26/2023	(2,999,621)	18.26	54,759,964

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023102403546	S	USDMXN	10/26/2023	(2,307,929)	18.26	42,131,713
2023102403650	SON	USDMXN	10/26/2023	(200,000,000)	17.17	3,434,000,000
2023102403652	SO	USDMXN	10/26/2023	0	18.24	214,300,000
2023102403659	S	USDMXN	10/26/2023	(595,000)	18.24	10,854,407
2023102403669	S	USDMXN	10/26/2023	(36,640)	18.24	668,317
20231024032023	B	USDMXN	10/26/2023	1,000,000	18.17	(18,165,300)
2023102403236	B	USDMXN	10/26/2023	1,000,000	18.26	(18,261,210)
2023102403237	B	USDMXN	10/26/2023	1,000,000	18.26	(18,261,300)
2023102403240	B	USDMXN	10/26/2023	1,000,000	18.26	(18,255,720)
2023102403242	B	USDMXN	10/26/2023	1,000,000	18.25	(18,254,550)
2023102403461	B	USDMXN	10/26/2023	3,000,000	18.27	(54,795,000)
2023102403462	B	USDMXN	10/26/2023	3,546,740	18.26	(64,763,477)
2023102403553	B	USDMXN	10/26/2023	35,000	18.26	(639,258)
2023102403630	B	USDMXN	10/26/2023	595,000	18.25	(10,859,018)
2023102403649	BON	USDMXN	10/26/2023	200,000,000	17.18	(3,435,260,000)
2023102403651	BO	USDMXN	10/26/2023	0	18.24	(213,040,000)
2023102403327	BO	USDMXN	11/01/2023	95,000	18.11	(1,720,012)
2023102403540	BO	USDMXN	11/01/2023	223,472	18.28	(4,084,770)
2023102403475	BO	USDMXN	11/03/2023	108,000	18.29	(1,975,377)
2023102403328	BO	USDMXN	11/06/2023	161,200	18.12	(2,921,022)
2023102403326	BO	USDMXN	11/08/2023	70,000	18.13	(1,268,856)
2023102403670	B	USDMXN	11/08/2023	36,640	18.28	(669,808)
2023102403554	S	USDMXN	11/09/2023	(35,000)	18.31	640,726
2023102403053	SO	USDMXN	11/15/2023	(215,000)	18.25	3,922,975
2023102403330	BO	USDMXN	11/15/2023	70,000	18.15	(1,270,348)
2023102403329	BO	USDMXN	11/22/2023	35,000	18.17	(635,936)
2023102403489	BO	USDMXN	11/24/2023	25,551	18.35	(468,799)
2023102403543	B	USDMXN	11/28/2023	1,239,190	18.36	(22,747,628)
2023102403331	BO	USDMXN	11/29/2023	35,000	18.19	(636,703)
2023102403539	BO	USDMXN	11/29/2023	37,200	18.37	(683,252)
2023102403660	B	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.35	(10,919,465)
2023102403332	BO	USDMXN	12/06/2023	35,000	18.21	(637,481)
2023102403494	BO	USDMXN	12/11/2023	15,073	18.40	(277,389)
2023102403333	BO	USDMXN	12/13/2023	35,000	18.23	(638,216)
2023102403545	B	USDMXN	12/14/2023	2,999,621	18.41	(55,218,729)
2023102403334	BO	USDMXN	12/20/2023	35,000	18.26	(638,943)
2023102403335	BO	USDMXN	12/27/2023	35,000	18.28	(639,811)
2023102403336	BO	USDMXN	01/03/2024	38,200	18.31	(699,292)
2023102403337	BO	USDMXN	01/10/2024	38,200	18.33	(700,047)
2023102403338	BO	USDMXN	01/17/2024	38,200	18.35	(700,801)
2023102403340	BO	USDMXN	01/24/2024	38,200	18.37	(701,555)
2023102403547	B	USDMXN	01/30/2024	2,307,929	18.56	(42,828,574)
2023102403339	BO	USDMXN	01/31/2024	38,200	18.39	(702,370)
2023102403341	BO	USDMXN	02/07/2024	38,200	18.41	(703,210)
2023102403342	BO	USDMXN	02/14/2024	38,200	18.43	(704,049)
2023102403344	BO	USDMXN	02/21/2024	38,200	18.45	(704,889)
2023102403343	BO	USDMXN	02/28/2024	38,200	18.47	(705,725)
2023102503429	S	USDMXN	10/27/2023	(30,100)	18.35	552,407
2023102503431	S	USDMXN	10/27/2023	(30,100)	18.35	552,413
2023102503433	S	USDMXN	10/27/2023	(30,100)	18.36	552,528
2023102503436	S	USDMXN	10/27/2023	(30,100)	18.36	552,537
2023102503439	S	USDMXN	10/27/2023	(24,400)	18.36	447,896
2023102503442	S	USDMXN	10/27/2023	(71,608)	18.36	1,314,458
2023102503450	S	USDMXN	10/27/2023	(595,000)	18.35	10,919,738
2023102503443	B	USDMXN	11/01/2023	71,608	18.37	(1,315,576)
2023102503342	SO	USDMXN	11/13/2023	(293,000)	18.38	5,386,421
2023102503343	SO	USDMXN	11/14/2023	(129,000)	18.39	2,372,103
2023102503440	B	USDMXN	11/15/2023	24,400	18.42	(449,358)
2023102503446	SO	USDMXN	11/16/2023	(54,141)	18.41	996,947

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023102503451	B	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.46	(10,983,211)
2023102503606	BO	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.46	(10,981,584)
2023102503434	B	USDMXN	12/06/2023	30,100	18.48	(556,318)
2023102503249	SO	USDMXN	12/13/2023	(100,000)	18.51	1,850,974
2023102503437	B	USDMXN	12/13/2023	30,100	18.51	(557,003)
2023102503430	B	USDMXN	12/20/2023	30,100	18.52	(557,550)
2023102503432	B	USDMXN	12/27/2023	30,100	18.54	(558,187)
2023102503250	SO	USDMXN	12/29/2023	(100,000)	18.50	1,850,341
2023102603549	S	USDMXN	10/30/2023	(2,960,000)	18.18	53,819,608
2023102603551	S	USDMXN	10/30/2023	(2,040,000)	18.18	37,092,096
2023102603553	S	USDMXN	10/30/2023	(2,205,000)	18.18	40,078,742
2023102603582	S	USDMXN	10/30/2023	(4,114,503)	18.17	74,749,986
2023102603198	B	USDMXN	10/30/2023	5,000,000	18.22	(91,075,000)
2023102603483	B	USDMXN	10/30/2023	3,000,000	18.13	(54,390,000)
2023102603526	B	USDMXN	10/30/2023	2,205,000	18.15	(40,024,013)
2023102603585	B	USDMXN	10/30/2023	4,114,503	18.17	(74,748,629)
2023102603594	SO	USDMXN	11/15/2023	(379,728)	18.20	6,911,843
2023102603587	BO	USDMXN	11/15/2023	189,864	18.22	(3,458,751)
2023102603625	BO	USDMXN	11/15/2023	58,800	18.22	(1,071,134)
2023102603042	SO	USDMXN	11/17/2023	(76,000)	18.33	1,393,436
2023102603626	BO	USDMXN	11/22/2023	58,800	18.24	(1,072,421)
2023102603627	BO	USDMXN	11/29/2023	58,800	18.26	(1,073,700)
2023102603323	BO	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.30	(10,888,829)
2023102603628	BO	USDMXN	12/06/2023	68,800	18.28	(1,257,823)
2023102603293	SO	USDMXN	12/13/2023	(100,000)	18.55	1,855,167
2023102603629	BO	USDMXN	12/13/2023	137,600	18.30	(2,518,657)
2023102603586	S	USDMXN	12/14/2023	(4,114,503)	18.31	75,316,446
2023102603631	BO	USDMXN	12/20/2023	103,200	18.33	(1,891,184)
2023102603632	BO	USDMXN	12/27/2023	68,800	18.35	(1,262,374)
2023102603633	BO	USDMXN	01/03/2024	34,400	18.38	(632,288)
2023102603550	B	USDMXN	01/16/2024	2,960,000	18.43	(54,546,185)
2023102603552	B	USDMXN	02/14/2024	2,040,000	18.52	(37,778,956)
2023102603554	B	USDMXN	04/15/2024	2,205,000	18.71	(41,251,039)
2023102703012	S	USDMXN	10/31/2023	(1,000,000)	18.05	18,050,950
2023102703013	S	USDMXN	10/31/2023	(1,000,000)	18.06	18,055,000
2023102703014	S	USDMXN	10/31/2023	(1,000,000)	18.06	18,058,400
2023102703049	S	USDMXN	10/31/2023	(29,047)	18.07	524,801
2023102703116	S	USDMXN	10/31/2023	(1,000,000)	18.05	18,047,690
2023102703316	S	USDMXN	10/31/2023	(100,000)	18.06	1,805,840
2023102703409	S	USDMXN	10/31/2023	(1,000,000)	18.11	18,109,100
2023102703610	S	USDMXN	10/31/2023	(500,000)	18.10	9,051,200
2023102703010	B	USDMXN	10/31/2023	100,000	18.05	(1,804,625)
2023102703040	B	USDMXN	10/31/2023	3,029,427	18.04	(54,650,864)
2023102703104	B	USDMXN	10/31/2023	1,000,000	18.05	(18,052,260)
2023102703244	B	USDMXN	10/31/2023	3,029,427	18.04	(54,650,864)
2023102703509	B	USDMXN	10/31/2023	1,000,000	18.10	(18,103,600)
2023102703317	B	USDMXN	11/03/2023	100,000	18.07	(1,806,762)
2023102703514	SO	USDMXN	11/17/2023	(273,000)	18.16	4,957,618
2023102703609	BO	USDMXN	11/17/2023	5,897,662	18.16	(107,083,170)
2023102703154	SO	USDMXN	11/22/2023	(67,000)	18.10	1,213,015
2023102703611	B	USDMXN	11/30/2023	500,000	18.20	(9,097,726)
2023102703393	BO	USDMXN	12/06/2023	78,000	18.21	(1,420,056)
2023102703392	BO	USDMXN	12/27/2023	115,600	18.27	(2,112,385)
2023102703276	SO	USDMXN	01/09/2024	(240,937)	18.26	4,400,712
2023102703511	BO	USDMXN	01/09/2024	3,000,000	18.32	(54,957,846)
2023102703314	SO	USDMXN	01/23/2024	(240,188)	18.32	4,399,856
2023102703304	SO	USDMXN	03/05/2024	(233,196)	18.44	4,301,031
2023102703305	SO	USDMXN	03/19/2024	(232,606)	18.49	4,300,659
2023102703312	SO	USDMXN	04/04/2024	(97,110)	18.55	1,801,114

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023102703321	SO	USDMXN	04/16/2024	(96,871)	18.59	1,800,377
2023102703335	SO	USDMXN	04/29/2024	(96,675)	18.63	1,800,835
2023103003368	BO	USDMXN	11/06/2023	60,000	17.99	(1,079,535)
2023103003367	BO	USDMXN	11/07/2023	40,000	18.00	(719,811)
2023103003481	BO	USDMXN	11/07/2023	30,000	18.06	(541,881)
2023103003364	BO	USDMXN	11/08/2023	185,000	18.00	(3,329,685)
2023103003672	BO	USDMXN	11/08/2023	43,800	18.08	(791,836)
2023103003676	BO	USDMXN	11/08/2023	200	18.06	(3,612)
2023103003482	BO	USDMXN	11/09/2023	70,000	18.07	(1,264,883)
2023103003638	SO	USDMXN	11/24/2023	(112,000)	18.09	2,026,154
2023103003671	BO	USDMXN	11/29/2023	115,200	18.14	(2,089,955)
2023103003771	BO	USDMXN	11/29/2023	49,000	18.14	(888,836)
2023103003667	BO	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.12	(10,782,215)
2023103003363	BO	USDMXN	12/11/2023	195,000	18.10	(3,529,044)
2023103003362	BO	USDMXN	01/04/2024	520,000	18.17	(9,448,720)
2023103003666	BO	USDMXN	05/24/2024	2,000,000	18.67	(37,341,314)
2023103003455	BO	USDMXN	07/09/2024	410,000	18.85	(7,726,687)
2023103003456	BO	USDMXN	09/06/2024	590,000	19.04	(11,232,134)
2023103003468	BO	USDMXN	09/06/2024	10,000	19.03	(190,315)
2023103103064	S	USDMXN	11/03/2023	(1,000,000)	18.07	18,070,200
2023103103120	S	USDMXN	11/03/2023	(1,000,000)	18.04	18,040,500
2023103103370	S	USDMXN	11/03/2023	(595,000)	18.05	10,737,668
2023103103448	S	USDMXN	11/03/2023	(35,000,000)	18.02	630,595,000
2023103103033	B	USDMXN	11/03/2023	1,000,000	18.03	(18,032,400)
2023103103094	B	USDMXN	11/03/2023	1,800,000	18.04	(32,480,100)
2023103103119	B	USDMXN	11/03/2023	1,000,000	18.01	(18,012,500)
2023103103344	B	USDMXN	11/03/2023	595,000	18.04	(10,734,252)
2023103103875	S	USDMXN	11/06/2023	(500,000)	18.06	9,031,130
2023103103849	B	USDMXN	11/06/2023	595,000	18.06	(10,745,998)
2023103103328	BO	USDMXN	11/09/2023	12,995	18.07	(234,869)
2023103103162	BO	USDMXN	11/13/2023	60,000	18.00	(1,079,811)
2023103103163	BO	USDMXN	11/14/2023	40,000	18.00	(719,992)
2023103103095	S	USDMXN	11/15/2023	(1,800,000)	18.08	32,542,348
2023103103324	BO	USDMXN	11/15/2023	162,300	18.10	(2,938,394)
2023103103322	SO	USDMXN	11/16/2023	(23,301)	18.10	421,822
2023103103326	SO	USDMXN	11/16/2023	(100,000)	18.10	1,810,152
2023103103498	SO	USDMXN	11/17/2023	(90)	18.06	1,617
2023103103329	SO	USDMXN	11/22/2023	(31,768)	18.11	575,158
2023103103331	BO	USDMXN	11/24/2023	32,167	18.11	(582,598)
2023103103496	BO	USDMXN	11/24/2023	11,841	18.09	(214,187)
2023103103206	BO	USDMXN	11/29/2023	84,950	18.15	(1,541,923)
2023103103371	B	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.13	(10,785,857)
2023103103202	BO	USDMXN	12/01/2023	49,600	18.14	(899,673)
2023103103204	BO	USDMXN	12/07/2023	49,600	18.16	(900,876)
2023103103649	BO	USDMXN	12/14/2023	1,061,544	18.12	(19,231,126)
2023103103449	B	USDMXN	01/03/2024	35,000,000	18.20	(636,972,000)
2023103103565	BO	USDMXN	01/16/2024	1,700,000	18.25	(31,024,923)
2023103103663	BO	USDMXN	01/30/2024	1,000,000	18.26	(18,260,250)
2023103103666	BO	USDMXN	01/30/2024	3,122,216	18.26	(57,011,510)
2023110103796	B	USDMXN	03/31/2023	27,000,000	18.80	(507,600,000)
2023110103758	S	USDMXN	11/01/2023	(10,000,000)	17.82	178,150,000
2023110103759	B	USDMXN	11/03/2023	10,000,000	17.82	(178,204,000)
2023110103257	S	USDMXN	11/06/2023	(595,000)	17.93	10,671,087
2023110103302	S	USDMXN	11/06/2023	(15,000,000)	17.93	268,950,000
2023110103338	S	USDMXN	11/06/2023	(60,800)	17.93	1,090,369
2023110103342	S	USDMXN	11/06/2023	(50,800)	17.93	910,869
2023110103345	S	USDMXN	11/06/2023	(50,800)	17.93	910,885
2023110103347	S	USDMXN	11/06/2023	(50,800)	17.93	910,874
2023110103349	S	USDMXN	11/06/2023	(50,800)	17.93	910,864

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023110103617	S	USDMXN	11/06/2023	(25,000,000)	17.84	445,875,000
2023110103676	S	USDMXN	11/06/2023	(2,278)	17.80	40,556
2023110103568	B	USDMXN	11/06/2023	7,500,000	17.84	(133,815,000)
2023110103582	B	USDMXN	11/06/2023	7,000,000	17.84	(124,894,000)
2023110103682	B	USDMXN	11/06/2023	51,000	17.81	(908,433)
2023110103806	B	USDMXN	11/06/2023	500,000	17.78	(8,890,100)
2023110103348	B	USDMXN	11/15/2023	50,800	17.96	(912,220)
2023110103365	BO	USDMXN	11/15/2023	52,000	17.97	(934,232)
2023110103269	BO	USDMXN	11/16/2023	30,000	17.98	(539,297)
2023110103268	BO	USDMXN	11/17/2023	70,000	17.98	(1,258,561)
2023110103354	SO	USDMXN	11/22/2023	(33,109)	17.97	595,063
2023110103346	B	USDMXN	11/22/2023	50,800	17.98	(913,282)
2023110103366	BO	USDMXN	11/24/2023	19,000	17.99	(341,900)
2023110103350	B	USDMXN	11/29/2023	50,800	18.00	(914,324)
2023110103258	B	USDMXN	11/30/2023	595,000	18.01	(10,713,401)
2023110103339	B	USDMXN	12/06/2023	60,800	18.02	(1,095,735)
2023110103343	B	USDMXN	12/06/2023	50,800	18.02	(915,353)
2023110103662	BO	USDMXN	12/13/2023	44,000	17.92	(788,596)
2023110103781	BO	USDMXN	12/21/2023	800,000	17.92	(14,336,476)
2023110103517	BO	USDMXN	01/31/2024	40,000	18.15	(725,822)
2023110103520	BO	USDMXN	02/29/2024	50,000	18.26	(912,795)
2023110103281	BO	USDMXN	05/17/2024	590,000	18.53	(10,930,977)
2023110103303	B	USDMXN	06/06/2024	15,000,000	18.59	(278,820,000)
2023110103618	B	USDMXN	11/06/2024	25,000,000	18.96	(473,875,000)
2023110303072	S	USDMXN	11/07/2023	(1,000,000)	17.41	17,412,350
2023110303280	S	USDMXN	11/07/2023	(2,000,000)	17.38	34,760,000
2023110303397	S	USDMXN	11/07/2023	(10,000,000)	17.40	174,024,400
2023110303412	S	USDMXN	11/07/2023	(860,000)	17.41	14,974,320
2023110303414	S	USDMXN	11/07/2023	(235,000)	17.41	4,091,726
2023110303416	S	USDMXN	11/07/2023	(255,000)	17.41	4,440,137
2023110303423	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.41	5,222,091
2023110303463	S	USDMXN	11/07/2023	(81,838)	17.40	1,424,370
2023110303465	S	USDMXN	11/07/2023	(750,000)	17.40	13,052,625
2023110303468	S	USDMXN	11/07/2023	(750,000)	17.40	13,053,075
2023110303478	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,666
2023110303480	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,624
2023110303483	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,720
2023110303485	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,744
2023110303487	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,702
2023110303489	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,738
2023110303491	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,714
2023110303493	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,732
2023110303494	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,732
2023110303497	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,720
2023110303499	S	USDMXN	11/07/2023	(60,000)	17.41	1,044,732
2023110303583	S	USDMXN	11/07/2023	(500,000)	17.46	8,728,200
2023110303595	S	USDMXN	11/07/2023	(200,000)	17.45	3,490,520
2023110303643	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.43	5,228,010
2023110303645	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.43	5,228,520
2023110303647	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.43	5,228,490
2023110303649	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.43	5,228,640
2023110303652	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.43	5,229,000
2023110303654	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.43	5,229,210
2023110303658	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.43	5,229,210
2023110303661	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.43	5,229,270
2023110303665	S	USDMXN	11/07/2023	(300,000)	17.43	5,227,950
2023110303925	S	USDMXN	11/07/2023	(650,810)	17.47	11,372,007
2023110303931	S	USDMXN	11/07/2023	(267,352)	17.47	4,670,861
2023110303965	S	USDMXN	11/07/2023	(25,000)	17.47	436,668

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023110303124	B	USDMXN	11/07/2023	5,000,000	17.39	(86,950,000)
2023110303149	B	USDMXN	11/07/2023	4,000,000	17.39	(69,560,000)
2023110303191	B	USDMXN	11/07/2023	5,000,000	17.41	(87,025,000)
2023110303196	B	USDMXN	11/07/2023	2,000,000	17.41	(34,810,000)
2023110303198	B	USDMXN	11/07/2023	7,000,000	17.40	(121,800,000)
2023110303200	B	USDMXN	11/07/2023	6,500,000	17.41	(113,132,500)
2023110303207	B	USDMXN	11/07/2023	2,500,000	17.41	(43,512,500)
2023110303225	B	USDMXN	11/07/2023	3,000,000	17.41	(52,215,000)
2023110303230	B	USDMXN	11/07/2023	3,000,000	17.41	(52,215,000)
2023110303255	B	USDMXN	11/07/2023	3,000,000	17.39	(52,182,750)
2023110303420	B	USDMXN	11/07/2023	200,000	17.41	(3,482,604)
2023110303750	B	USDMXN	11/07/2023	25,000	17.38	(434,618)
2023110303679	BO	USDMXN	11/14/2023	100,000	17.44	(1,744,483)
2023110303801	BO	USDMXN	11/14/2023	280,000	17.46	(4,889,171)
2023110303413	B	USDMXN	11/15/2023	860,000	17.43	(14,993,397)
2023110303660	B	USDMXN	11/15/2023	300,000	17.45	(5,235,805)
2023110303479	B	USDMXN	11/16/2023	60,000	17.44	(1,046,168)
2023110303599	BO	USDMXN	11/16/2023	20,000	17.47	(349,337)
2023110303681	BO	USDMXN	11/16/2023	100,000	17.45	(1,745,154)
2023110303415	B	USDMXN	11/21/2023	235,000	17.45	(4,100,966)
2023110303683	BO	USDMXN	11/21/2023	100,000	17.47	(1,746,612)
2023110303466	B	USDMXN	11/22/2023	750,000	17.45	(13,084,216)
2023110303481	B	USDMXN	11/22/2023	60,000	17.45	(1,047,151)
2023110303663	B	USDMXN	11/22/2023	300,000	17.47	(5,241,885)
2023110303601	BO	USDMXN	11/24/2023	20,000	17.49	(349,797)
2023110303685	BO	USDMXN	11/24/2023	100,000	17.47	(1,747,371)
2023110303417	B	USDMXN	11/28/2023	255,000	17.47	(4,455,164)
2023110303684	BO	USDMXN	11/28/2023	100,000	17.49	(1,748,633)
2023110303655	B	USDMXN	11/29/2023	300,000	17.49	(5,247,927)
2023110303739	BO	USDMXN	11/29/2023	45,350	17.50	(793,542)
2023110303469	B	USDMXN	11/30/2023	750,000	17.47	(13,101,393)
2023110303484	B	USDMXN	11/30/2023	60,000	17.48	(1,048,585)
2023110303602	BO	USDMXN	11/30/2023	20,000	17.51	(350,140)
2023110303596	B	USDMXN	12/05/2023	200,000	17.53	(3,506,207)
2023110303653	B	USDMXN	12/06/2023	300,000	17.51	(5,253,509)
2023110303936	BO	USDMXN	12/06/2023	25,200	17.56	(442,392)
2023110303937	BO	USDMXN	12/06/2023	44,000	17.55	(772,326)
2023110303950	BO	USDMXN	12/06/2023	112,500	17.56	(1,975,343)
2023110303486	B	USDMXN	12/07/2023	60,000	17.50	(1,049,763)
2023110303605	BO	USDMXN	12/07/2023	20,000	17.53	(350,535)
2023110303650	B	USDMXN	12/13/2023	300,000	17.53	(5,259,336)
2023110303836	BO	USDMXN	12/13/2023	60,400	17.55	(1,060,036)
2023110303488	B	USDMXN	12/14/2023	60,000	17.52	(1,050,952)
2023110303606	BO	USDMXN	12/14/2023	20,000	17.55	(350,947)
2023110303648	B	USDMXN	12/20/2023	300,000	17.55	(5,265,439)
2023110303490	B	USDMXN	12/21/2023	60,000	17.54	(1,052,231)
2023110303607	BO	USDMXN	12/21/2023	20,000	17.57	(351,369)
2023110303646	B	USDMXN	12/27/2023	300,000	17.57	(5,272,138)
2023110303837	BO	USDMXN	12/27/2023	60,400	17.59	(1,062,625)
2023110303498	B	USDMXN	12/28/2023	60,000	17.56	(1,053,527)
2023110303608	BO	USDMXN	12/28/2023	20,000	17.59	(351,813)
2023110303666	B	USDMXN	01/03/2024	300,000	17.59	(5,277,755)
2023110303839	BO	USDMXN	01/03/2024	60,400	17.61	(1,063,873)
2023110303495	B	USDMXN	01/04/2024	60,000	17.58	(1,054,708)
2023110303609	BO	USDMXN	01/04/2024	20,000	17.61	(352,235)
2023110303584	B	USDMXN	01/05/2024	500,000	17.63	(8,813,092)
2023110303644	B	USDMXN	01/10/2024	300,000	17.61	(5,283,170)
2023110303496	B	USDMXN	01/11/2024	60,000	17.60	(1,055,803)
2023110303626	BO	USDMXN	01/11/2024	66,920	17.62	(1,179,100)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023110303259	BO	USDMXN	01/17/2024	300,000	17.60	(5,279,547)
2023110303492	B	USDMXN	01/18/2024	60,000	17.62	(1,057,046)
2023110303625	BO	USDMXN	01/18/2024	44,613	17.64	(786,880)
2023110303258	BO	USDMXN	01/24/2024	300,000	17.62	(5,286,164)
2023110303500	B	USDMXN	01/25/2024	60,000	17.64	(1,058,325)
2023110303623	BO	USDMXN	01/25/2024	52,024	17.66	(918,768)
2023110303621	BO	USDMXN	02/01/2024	44,613	17.68	(788,874)
2023110303622	BO	USDMXN	02/08/2024	44,546	17.70	(788,625)
2023110303620	BO	USDMXN	02/15/2024	44,546	17.73	(789,603)
2023110303187	BO	USDMXN	02/22/2024	5,000,000	17.71	(88,565,815)
2023110303619	BO	USDMXN	02/22/2024	51,924	17.75	(921,455)
2023110303926	B	USDMXN	02/22/2024	650,810	17.79	(11,576,859)
2023110303618	BO	USDMXN	02/29/2024	44,546	17.77	(791,510)
2023110303615	BO	USDMXN	03/07/2024	44,544	17.79	(792,399)
2023110303617	BO	USDMXN	03/14/2024	44,543	17.81	(793,371)
2023110303616	BO	USDMXN	03/21/2024	51,918	17.83	(925,832)
2023110303614	BO	USDMXN	03/27/2024	59,438	17.85	(1,061,053)
2023110303613	BO	USDMXN	04/04/2024	29,647	17.88	(529,974)
2023110303941	SO	USDMXN	04/29/2024	(19,166)	17.98	344,686
2023110303227	BO	USDMXN	04/29/2024	620,000	17.92	(11,111,855)
2023110303639	BO	USDMXN	06/28/2024	600,000	18.14	(10,882,470)
2023110303932	B	USDMXN	07/25/2024	267,352	18.26	(4,882,421)
2023110303398	B	USDMXN	11/07/2024	10,000,000	18.50	(185,044,340)
2023110303247	BO	USDMXN	11/08/2024	300,000	18.50	(5,548,636)
2023110303262	BO	USDMXN	11/15/2024	300,000	18.52	(5,555,190)
2023110303250	BO	USDMXN	11/22/2024	300,000	18.54	(5,561,385)
2023110303251	BO	USDMXN	11/29/2024	300,000	18.56	(5,566,859)
2023110303252	BO	USDMXN	12/06/2024	300,000	18.58	(5,573,594)
2023110303253	BO	USDMXN	12/13/2024	300,000	18.60	(5,579,578)
2023110603716	S	USDMXN	11/07/2023	(1,000,000)	17.53	17,531,253
2023110603071	S	USDMXN	11/08/2023	(1,000,000)	17.53	17,531,380
2023110603134	S	USDMXN	11/08/2023	(1,000,000)	17.56	17,560,240
2023110603209	S	USDMXN	11/08/2023	(1,000,000)	17.56	17,563,610
2023110603307	S	USDMXN	11/08/2023	(1,000,000)	17.54	17,535,000
2023110603371	S	USDMXN	11/08/2023	(350,000)	17.53	6,134,555
2023110603373	S	USDMXN	11/08/2023	(250,000)	17.53	4,381,625
2023110603375	S	USDMXN	11/08/2023	(350,000)	17.53	6,134,485
2023110603378	S	USDMXN	11/08/2023	(250,000)	17.52	4,381,150
2023110603380	S	USDMXN	11/08/2023	(350,000)	17.53	6,134,485
2023110603382	S	USDMXN	11/08/2023	(250,000)	17.53	4,381,650
2023110603384	S	USDMXN	11/08/2023	(350,000)	17.52	6,133,610
2023110603386	S	USDMXN	11/08/2023	(250,000)	17.53	4,381,300
2023110603388	S	USDMXN	11/08/2023	(350,000)	17.53	6,135,815
2023110603390	S	USDMXN	11/08/2023	(250,000)	17.53	4,382,850
2023110603392	S	USDMXN	11/08/2023	(350,000)	17.53	6,135,710
2023110603394	S	USDMXN	11/08/2023	(250,000)	17.53	4,382,575
2023110603396	S	USDMXN	11/08/2023	(350,000)	17.53	6,137,180
2023110603399	S	USDMXN	11/08/2023	(250,000)	17.53	4,383,475
2023110603401	S	USDMXN	11/08/2023	(350,000)	17.53	6,136,830
2023110603724	S	USDMXN	11/08/2023	(2,100,000)	17.54	36,831,060
2023110603744	S	USDMXN	11/08/2023	(585,000)	17.54	10,258,262
2023110603068	B	USDMXN	11/08/2023	1,000,000	17.53	(17,531,800)
2023110603112	B	USDMXN	11/08/2023	1,000,000	17.53	(17,527,680)
2023110603241	B	USDMXN	11/08/2023	1,000,000	17.53	(17,530,000)
2023110603286	B	USDMXN	11/08/2023	1,000,000	17.54	(17,535,000)
2023110603372	B	USDMXN	11/15/2023	350,000	17.55	(6,141,042)
2023110603374	B	USDMXN	11/30/2023	250,000	17.59	(4,396,994)
2023110603745	B	USDMXN	12/01/2023	585,000	17.60	(10,295,302)
2023110603376	B	USDMXN	12/15/2023	350,000	17.63	(6,171,179)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023110603379	B	USDMXN	12/29/2023	250,000	17.67	(4,418,042)
2023110603630	BO	USDMXN	01/02/2024	1,000,000	17.69	(17,691,396)
2023110603717	B	USDMXN	01/02/2024	1,000,000	17.69	(17,692,690)
2023110603725	B	USDMXN	01/02/2024	2,100,000	17.70	(37,168,113)
2023110603381	B	USDMXN	01/12/2024	350,000	17.71	(6,199,440)
2023110603383	B	USDMXN	01/30/2024	250,000	17.77	(4,441,626)
2023110603385	B	USDMXN	02/15/2024	350,000	17.81	(6,234,683)
2023110603387	B	USDMXN	02/28/2024	250,000	17.85	(4,463,577)
2023110603389	B	USDMXN	03/15/2024	350,000	17.91	(6,268,391)
2023110603391	B	USDMXN	03/27/2024	250,000	17.95	(4,486,873)
2023110603393	B	USDMXN	04/15/2024	350,000	18.01	(6,301,889)
2023110603395	B	USDMXN	04/30/2024	250,000	18.05	(4,512,741)
2023110603397	B	USDMXN	05/15/2024	350,000	18.10	(6,335,663)
2023110603400	B	USDMXN	05/30/2024	250,000	18.15	(4,537,018)
2023110603402	B	USDMXN	06/14/2024	350,000	18.20	(6,368,286)
2023110703090	S	USDMXN	11/09/2023	(1,000,000)	17.51	17,513,440
2023110703114	S	USDMXN	11/09/2023	(1,000,000)	17.53	17,527,700
2023110703200	S	USDMXN	11/09/2023	(20,000,000)	17.54	350,800,000
2023110703238	S	USDMXN	11/09/2023	(1,000,000)	17.46	17,457,000
2023110703241	S	USDMXN	11/09/2023	(1,000,000)	17.46	17,461,210
2023110703374	S	USDMXN	11/09/2023	(76,416)	17.49	1,336,608
2023110703376	S	USDMXN	11/09/2023	(33,200)	17.49	580,701
2023110703378	S	USDMXN	11/09/2023	(133,600)	17.49	2,336,731
2023110703380	S	USDMXN	11/09/2023	(57,600)	17.49	1,007,476
2023110703382	S	USDMXN	11/09/2023	(172,800)	17.49	3,022,410
2023110703385	S	USDMXN	11/09/2023	(291,600)	17.49	5,100,346
2023110703513	S	USDMXN	11/09/2023	(585,000)	17.46	10,213,632
2023110703524	S	USDMXN	11/09/2023	(2,594,516)	17.46	45,295,839
2023110703526	S	USDMXN	11/09/2023	(1,230,770)	17.46	21,486,661
2023110703528	S	USDMXN	11/09/2023	(830,509)	17.46	14,499,191
2023110703534	S	USDMXN	11/09/2023	(8,649,708)	17.45	150,978,058
2023110703040	B	USDMXN	11/09/2023	1,000,000	17.49	(17,493,700)
2023110703147	B	USDMXN	11/09/2023	1,000,000	17.54	(17,537,400)
2023110703178	B	USDMXN	11/09/2023	1,000,000	17.52	(17,515,750)
2023110703190	B	USDMXN	11/09/2023	1,000,000	17.50	(17,504,440)
2023110703315	B	USDMXN	11/09/2023	3,000,000	17.48	(52,440,000)
2023110703402	B	USDMXN	11/09/2023	5,000,000	17.49	(87,425,000)
2023110703403	B	USDMXN	11/09/2023	649,708	17.48	(11,359,508)
2023110703522	B	USDMXN	11/09/2023	520,678	17.46	(9,092,081)
2023110703530	B	USDMXN	11/09/2023	381,124	17.46	(6,654,768)
2023110703601	B	USDMXN	11/09/2023	3,753,993	17.48	(65,614,728)
2023110703620	B	USDMXN	11/09/2023	4,000,000	17.48	(69,920,000)
2023110703629	B	USDMXN	11/09/2023	1,000,000	17.49	(17,488,370)
2023110703523	S	USDMXN	11/15/2023	(520,678)	17.48	9,100,403
2023110703375	B	USDMXN	11/15/2023	76,416	17.51	(1,337,926)
2023110703583	BO	USDMXN	11/16/2023	14,251	17.48	(249,112)
2023110703586	SO	USDMXN	11/21/2023	(189,220)	17.49	3,309,951
2023110703386	B	USDMXN	11/22/2023	291,600	17.53	(5,111,201)
2023110703377	B	USDMXN	11/29/2023	33,200	17.55	(582,618)
2023110703588	BO	USDMXN	11/29/2023	124,000	17.52	(2,172,434)
2023110703201	B	USDMXN	11/30/2023	20,000,000	17.60	(351,980,000)
2023110703514	B	USDMXN	12/01/2023	585,000	17.52	(10,250,697)
2023110703379	B	USDMXN	12/13/2023	133,600	17.59	(2,349,827)
2023110703311	BO	USDMXN	12/18/2023	1,000,000	17.59	(17,594,360)
2023110703535	B	USDMXN	12/18/2023	8,649,708	17.57	(151,959,022)
2023110703381	B	USDMXN	12/20/2023	57,600	17.61	(1,014,367)
2023110703383	B	USDMXN	12/27/2023	172,800	17.63	(3,046,815)
2023110703525	B	USDMXN	01/10/2024	2,594,516	17.64	(45,761,240)
2023110703527	B	USDMXN	01/16/2024	1,230,770	17.66	(21,730,053)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023110703156	SO	USDMXN	01/23/2024	(247,762)	17.76	4,401,248
2023110703529	B	USDMXN	01/30/2024	830,509	17.70	(14,699,041)
2023110703157	SO	USDMXN	03/05/2024	(240,500)	17.89	4,302,781
2023110703159	SO	USDMXN	03/19/2024	(239,822)	17.93	4,300,901
2023110703545	SO	USDMXN	04/02/2024	(100,178)	17.88	1,791,398
2023110703546	SO	USDMXN	04/16/2024	(99,917)	17.92	1,791,004
2023110703547	SO	USDMXN	04/29/2024	(99,767)	17.97	1,792,333
2023110703531	S	USDMXN	05/29/2024	(381,124)	18.07	6,885,117
2023110703549	SO	USDMXN	07/09/2024	(175,391)	18.18	3,188,634
2023110703550	SO	USDMXN	07/23/2024	(175,036)	18.22	3,189,679
2023110803144	S	USDMXN	11/10/2023	(30,000,000)	17.50	524,940,000
2023110803161	S	USDMXN	11/10/2023	(1,000,000)	17.49	17,485,460
2023110803167	S	USDMXN	11/10/2023	(1,000,000)	17.48	17,483,750
2023110803294	S	USDMXN	11/10/2023	(1,000,000)	17.50	17,499,400
2023110803421	S	USDMXN	11/10/2023	(15,000,000)	17.54	263,044,500
2023110803446	S	USDMXN	11/10/2023	(116,112)	17.52	2,034,375
2023110803448	S	USDMXN	11/10/2023	(78,400)	17.52	1,373,560
2023110803051	B	USDMXN	11/10/2023	1,000,000	17.49	(17,492,500)
2023110803222	B	USDMXN	11/10/2023	1,000,000	17.47	(17,472,690)
2023110803334	B	USDMXN	11/10/2023	1,000,000	17.55	(17,545,730)
2023110803472	B	USDMXN	11/10/2023	1,000,000	17.51	(17,511,000)
2023110803526	B	USDMXN	11/10/2023	5,000,000	17.51	(87,555,000)
2023110803569	B	USDMXN	11/10/2023	556,000	17.53	(9,748,848)
2023110803571	B	USDMXN	11/10/2023	137,000	17.53	(2,402,090)
2023110803534	S	USDMXN	11/15/2023	(500,000)	17.53	8,763,655
2023110803447	B	USDMXN	11/15/2023	116,112	17.54	(2,036,049)
2023110803533	BO	USDMXN	11/15/2023	500,000	17.53	(8,765,794)
2023110803123	SO	USDMXN	11/21/2023	(105,000)	17.52	1,839,816
2023110803453	SO	USDMXN	11/21/2023	(710)	17.55	12,461
2023110803541	BO	USDMXN	11/22/2023	31,300	17.55	(549,342)
2023110803639	BO	USDMXN	11/22/2023	40,000	17.59	(703,420)
2023110803542	BO	USDMXN	11/24/2023	30,000	17.56	(526,705)
2023110803570	S	USDMXN	11/27/2023	(556,000)	17.58	9,775,182
2023110803572	S	USDMXN	11/28/2023	(137,000)	17.58	2,408,966
2023110803422	B	USDMXN	12/11/2023	15,000,000	17.63	(264,392,288)
2023110803449	B	USDMXN	12/20/2023	78,400	17.64	(1,382,758)
2023110803640	BO	USDMXN	12/27/2023	33,400	17.70	(591,083)
2023110803427	BO	USDMXN	01/11/2024	14,650	17.70	(259,362)
2023110803535	B	USDMXN	01/17/2024	500,000	17.71	(8,856,547)
2023110803433	BO	USDMXN	01/18/2024	29,300	17.73	(519,403)
2023110803537	BO	USDMXN	01/24/2024	500,000	17.74	(8,868,973)
2023110803434	BO	USDMXN	01/25/2024	14,650	17.75	(260,022)
2023110803435	BO	USDMXN	02/01/2024	14,650	17.77	(260,330)
2023110803436	BO	USDMXN	02/08/2024	14,650	17.79	(260,643)
2023110803145	B	USDMXN	02/12/2024	30,000,000	17.78	(533,250,000)
2023110803437	BO	USDMXN	02/15/2024	14,650	17.81	(260,973)
2023110803438	BO	USDMXN	02/22/2024	14,650	17.84	(261,289)
2023110803638	BO	USDMXN	02/28/2024	90,100	17.88	(1,611,072)
2023110803439	BO	USDMXN	02/29/2024	14,650	17.86	(261,609)
2023110803440	BO	USDMXN	03/07/2024	14,650	17.88	(261,970)
2023110803441	BO	USDMXN	03/14/2024	29,300	17.90	(524,586)
2023110803442	BO	USDMXN	03/21/2024	14,650	17.93	(262,603)
2023110803443	BO	USDMXN	03/27/2024	14,650	17.94	(262,860)
2023110803444	BO	USDMXN	04/04/2024	14,650	17.97	(263,245)
2023110903110	S	USDMXN	11/09/2023	(1,500,000)	17.49	26,235,000
2023110903111	B	USDMXN	11/10/2023	1,500,000	17.49	(26,238,900)
2023110903101	S	USDMXN	11/13/2023	(1,000,000)	17.48	17,475,080
2023110903191	S	USDMXN	11/13/2023	(652,705)	17.49	11,413,461
2023110903376	S	USDMXN	11/13/2023	(1,000,000)	17.51	17,506,480

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023110903088	B	USDMXN	11/13/2023	1,000,000	17.49	(17,494,990)
2023110903179	B	USDMXN	11/13/2023	652,000	17.48	(11,396,960)
2023110903352	B	USDMXN	11/13/2023	1,000,000	17.54	(17,537,460)
2023110903488	SO	USDMXN	11/24/2023	(420,000)	17.65	7,414,042
2023110903409	SO	USDMXN	11/27/2023	(110,000)	17.63	1,939,452
2023110903324	SO	USDMXN	11/28/2023	(125,424)	17.55	2,201,733
2023110903491	SO	USDMXN	11/30/2023	(106,000)	17.77	1,883,969
2023110903430	SO	USDMXN	12/05/2023	(392,000)	17.60	6,897,912
2023110903316	BO	USDMXN	12/13/2023	40,000	17.57	(702,706)
2023110903482	BO	USDMXN	12/13/2023	48,150	17.78	(855,989)
2023110903325	SO	USDMXN	12/14/2023	(164,649)	17.59	2,896,887
2023110903590	BO	USDMXN	12/14/2023	213,000	17.90	(3,812,306)
2023110903214	SO	USDMXN	12/18/2023	(88,000)	17.59	1,547,738
2023110903192	B	USDMXN	02/15/2024	652,705	17.77	(11,595,368)
2023111003104	S	USDMXN	11/14/2023	(2,000,000)	17.84	35,680,000
2023111003197	S	USDMXN	11/14/2023	(1,000,000)	17.76	17,762,740
2023111003497	S	USDMXN	11/14/2023	(200,000)	17.62	3,524,100
2023111003510	S	USDMXN	11/14/2023	(1,085,972)	17.62	19,138,730
2023111003093	B	USDMXN	11/14/2023	1,000,000	17.80	(17,801,010)
2023111003094	B	USDMXN	11/14/2023	1,000,000	17.80	(17,798,700)
2023111003129	B	USDMXN	11/14/2023	1,000,000	17.81	(17,809,580)
2023111003254	BO	USDMXN	11/22/2023	247,000	17.76	(4,386,807)
2023111003257	BO	USDMXN	11/24/2023	1,196,204	17.76	(21,239,365)
2023111003496	SO	USDMXN	12/05/2023	(134,096)	17.68	2,370,768
2023111003265	BO	USDMXN	12/07/2023	34,538	17.79	(614,497)
2023111003498	B	USDMXN	12/08/2023	200,000	17.69	(3,538,266)
2023111003500	BO	USDMXN	12/13/2023	107,987	17.71	(1,912,260)
2023111003641	BO	USDMXN	12/13/2023	74,150	17.72	(1,314,085)
2023111003505	BO	USDMXN	12/14/2023	841	17.72	(14,899)
2023111003501	SO	USDMXN	12/19/2023	(29,541)	17.71	523,250
2023111003503	BO	USDMXN	12/20/2023	235,200	17.74	(4,172,327)
2023111003506	BO	USDMXN	12/27/2023	178,400	17.76	(3,168,767)
2023111003509	BO	USDMXN	01/03/2024	235,200	17.78	(4,182,431)
2023111303104	S	USDMXN	11/15/2023	(2,000,000)	17.65	35,300,000
2023111303231	S	USDMXN	11/15/2023	(1,000,000)	17.59	17,587,730
2023111303477	S	USDMXN	11/15/2023	(936,900)	17.58	16,472,388
2023111303479	S	USDMXN	11/15/2023	(587,598)	17.58	10,331,207
2023111303636	S	USDMXN	11/15/2023	(250,000)	17.59	4,398,418
2023111303091	B	USDMXN	11/15/2023	1,000,000	17.66	(17,664,030)
2023111303094	B	USDMXN	11/15/2023	1,000,000	17.66	(17,661,090)
2023111303180	B	USDMXN	11/15/2023	1,000,000	17.61	(17,609,350)
2023111303586	B	USDMXN	11/15/2023	250,000	17.60	(4,401,225)
2023111303367	S	USDMXN	11/16/2023	(100,000,000)	17.62	1,761,500,000
2023111303360	B	USDMXN	11/16/2023	100,000,000	17.61	(1,761,000,000)
2023111303682	SO	USDMXN	12/14/2023	(15,056)	17.68	266,140
2023111303684	SO	USDMXN	12/14/2023	(5,305)	17.68	93,774
2023111303478	B	USDMXN	12/14/2023	936,900	17.67	(16,554,022)
2023111303678	SO	USDMXN	12/15/2023	(171,986)	17.68	3,040,573
2023111303480	B	USDMXN	01/18/2024	587,598	17.78	(10,445,161)
2023111303365	SON	USDMXN	02/15/2024	(100,000,000)	17.88	1,788,180,000
2023111303370	BON	USDMXN	02/15/2024	50,000,000	17.88	(894,000,000)
2023111303371	BON	USDMXN	02/15/2024	50,000,000	17.88	(894,000,000)
2023111403115	S	USDMXN	11/14/2023	(1,500,000)	17.38	26,070,000
2023111403006	BO	USDMXN	11/15/2023	1,000,000	17.40	(17,395,867)
2023111403116	B	USDMXN	11/15/2023	1,500,000	17.38	(26,074,050)
2023111403003	S	USDMXN	11/16/2023	(2,000,000)	17.39	34,784,620
2023111403126	S	USDMXN	11/16/2023	(1,000,000)	17.36	17,357,020
2023111403194	S	USDMXN	11/16/2023	(1,000,000)	17.39	17,393,490
2023111403197	S	USDMXN	11/16/2023	(1,000,000)	17.40	17,395,550

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023111403209	S	USDMXN	11/16/2023	(1,000,000)	17.39	17,390,990
2023111403425	S	USDMXN	11/16/2023	(130,000)	17.40	2,262,260
2023111403427	S	USDMXN	11/16/2023	(130,000)	17.40	2,262,078
2023111403429	S	USDMXN	11/16/2023	(130,000)	17.40	2,262,078
2023111403431	S	USDMXN	11/16/2023	(130,000)	17.40	2,262,078
2023111403559	S	USDMXN	11/16/2023	(200,000)	17.36	3,471,940
2023111403563	S	USDMXN	11/16/2023	(200,000)	17.36	3,472,120
2023111403596	S	USDMXN	11/16/2023	(252,000)	17.36	4,375,703
2023111403597	S	USDMXN	11/16/2023	(202,800)	17.36	3,521,480
2023111403600	S	USDMXN	11/16/2023	(62,800)	17.36	1,090,478
2023111403602	S	USDMXN	11/16/2023	(125,600)	17.37	2,181,170
2023111403604	S	USDMXN	11/16/2023	(125,600)	17.37	2,181,182
2023111403606	S	USDMXN	11/16/2023	(277,888)	17.37	4,825,831
2023111403615	S	USDMXN	11/16/2023	(100,000)	17.37	1,736,620
2023111403617	S	USDMXN	11/16/2023	(100,000)	17.37	1,736,840
2023111403620	S	USDMXN	11/16/2023	(100,000)	17.37	1,736,840
2023111403630	S	USDMXN	11/16/2023	(62,800)	17.37	1,090,987
2023111403632	S	USDMXN	11/16/2023	(130,000)	17.37	2,258,698
2023111403651	S	USDMXN	11/16/2023	(365,408)	17.37	6,348,332
2023111403694	S	USDMXN	11/16/2023	(875,789)	17.36	15,205,887
2023111403696	S	USDMXN	11/16/2023	(562,114)	17.36	9,757,962
2023111403699	S	USDMXN	11/16/2023	(62,097)	17.36	1,078,100
2023111403775	S	USDMXN	11/16/2023	(423,311)	17.36	7,348,954
2023111403778	S	USDMXN	11/16/2023	(1,253,456)	17.36	21,758,718
2023111403828	S	USDMXN	11/16/2023	(462,174)	17.37	8,025,814
2023111403882	S	USDMXN	11/16/2023	(264,210)	17.35	4,583,151
2023111403118	B	USDMXN	11/16/2023	1,000,000	17.37	(17,371,950)
2023111403342	B	USDMXN	11/16/2023	1,000,000	17.43	(17,428,060)
2023111403343	B	USDMXN	11/16/2023	1,000,000	17.43	(17,427,870)
2023111403353	B	USDMXN	11/16/2023	242,445	17.42	(4,223,925)
2023111403355	B	USDMXN	11/16/2023	248,742	17.42	(4,333,608)
2023111403357	B	USDMXN	11/16/2023	249,391	17.42	(4,344,990)
2023111403359	B	USDMXN	11/16/2023	249,861	17.42	(4,353,103)
2023111403361	B	USDMXN	11/16/2023	250,534	17.42	(4,363,926)
2023111403363	B	USDMXN	11/16/2023	100,908	17.42	(1,757,727)
2023111403366	B	USDMXN	11/16/2023	100,677	17.42	(1,753,431)
2023111403369	B	USDMXN	11/16/2023	100,503	17.42	(1,750,481)
2023111403380	B	USDMXN	11/16/2023	144,871	17.41	(2,522,074)
2023111403395	B	USDMXN	11/16/2023	144,509	17.41	(2,516,451)
2023111403402	B	USDMXN	11/16/2023	176,688	17.41	(3,075,926)
2023111403414	B	USDMXN	11/16/2023	176,279	17.41	(3,069,000)
2023111403691	B	USDMXN	11/16/2023	1,500,000	17.37	(26,047,500)
2023111403819	B	USDMXN	11/16/2023	1,000,000	17.37	(17,370,850)
2023111403822	B	USDMXN	11/16/2023	213,886	17.37	(3,714,769)
2023111403823	B	USDMXN	11/16/2023	200,000	17.37	(3,473,630)
2023111403826	S	MXNUSD	11/16/2023	(248,288)	17.37	14,296
2023111403836	B	USDMXN	11/16/2023	76,767	17.37	(1,333,079)
2023111403859	B	USDMXN	11/16/2023	500,000	17.36	(8,680,140)
2023111403776	B	USDMXN	11/21/2023	423,311	17.38	(7,355,110)
2023111403607	B	USDMXN	11/22/2023	277,888	17.38	(4,830,800)
2023111403779	B	USDMXN	11/22/2023	1,253,456	17.38	(21,780,554)
2023111403666	BO	USDMXN	11/27/2023	50,000	17.43	(871,277)
2023111403599	B	USDMXN	11/29/2023	202,800	17.40	(3,529,371)
2023111403426	B	USDMXN	12/05/2023	130,000	17.46	(2,269,689)
2023111403598	B	USDMXN	12/06/2023	252,000	17.42	(4,390,827)
2023111403633	B	USDMXN	12/06/2023	130,000	17.43	(2,266,500)
2023111403428	B	USDMXN	12/07/2023	130,000	17.46	(2,270,298)
2023111403430	B	USDMXN	12/11/2023	130,000	17.48	(2,271,784)
2023111403824	S	USDMXN	12/14/2023	(1,047,556)	17.45	18,277,300

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023111403827	B	MXNUSD	12/14/2023	248,288	17.45	(14,228)
2023111403432	B	USD MXN	12/14/2023	130,000	17.48	(2,272,898)
2023111403679	BO	USD MXN	12/20/2023	90,150	17.48	(1,575,672)
2023111403833	BO	USD MXN	12/20/2023	40,400	17.47	(705,676)
2023111403564	B	USD MXN	12/21/2023	200,000	17.47	(3,493,092)
2023111403601	B	USD MXN	12/27/2023	62,800	17.49	(1,098,276)
2023111403631	B	USD MXN	12/27/2023	62,800	17.50	(1,098,785)
2023111403831	BO	USD MXN	12/27/2023	73,600	17.49	(1,287,179)
2023111403829	B	USD MXN	12/28/2023	462,174	17.49	(8,084,393)
2023111403886	BO	USD MXN	12/28/2023	250,000	17.48	(4,369,124)
2023111403603	B	USD MXN	01/03/2024	125,600	17.51	(2,199,491)
2023111403362	S	USD MXN	01/09/2024	(250,534)	17.58	4,403,677
2023111403605	B	USD MXN	01/10/2024	125,600	17.53	(2,201,995)
2023111403360	S	USD MXN	01/23/2024	(249,861)	17.62	4,403,664
2023111403560	B	USD MXN	01/30/2024	200,000	17.59	(3,517,005)
2023111403358	S	USD MXN	02/06/2024	(249,391)	17.67	4,406,014
2023111403329	BO	USD MXN	02/06/2024	6,000,000	17.66	(105,952,563)
2023111403825	B	USD MXN	02/16/2024	1,047,556	17.64	(18,481,259)
2023111403356	S	USD MXN	02/20/2024	(248,742)	17.71	4,404,982
2023111403354	S	USD MXN	03/05/2024	(242,445)	17.75	4,303,679
2023111403252	BO	USD MXN	03/15/2024	460,000	17.76	(8,170,145)
2023111403364	S	USD MXN	04/02/2024	(100,908)	17.83	1,799,405
2023111403616	B	USD MXN	04/09/2024	100,000	17.81	(1,780,513)
2023111403695	B	USD MXN	04/15/2024	875,789	17.82	(15,606,407)
2023111403367	S	USD MXN	04/16/2024	(100,677)	17.87	1,799,250
2023111403618	B	USD MXN	04/16/2024	100,000	17.83	(1,782,879)
2023111403621	B	USD MXN	04/23/2024	100,000	17.85	(1,784,996)
2023111403370	S	USD MXN	04/29/2024	(100,503)	17.91	1,800,087
2023111403381	S	USD MXN	05/14/2024	(144,871)	17.95	2,600,076
2023111403396	S	USD MXN	05/28/2024	(144,509)	17.99	2,600,262
2023111403403	S	USD MXN	07/09/2024	(176,688)	18.11	3,200,510
2023111403415	S	USD MXN	07/23/2024	(176,279)	18.16	3,200,577
2023111403697	B	USD MXN	08/15/2024	562,114	18.18	(10,221,061)
2023111503202	S	USD MXN	11/17/2023	(1,000,000)	17.34	17,340,000
2023111503226	S	USD MXN	11/17/2023	(2,000,000)	17.31	34,619,680
2023111503377	S	USD MXN	11/17/2023	(1,200,000)	17.34	20,808,000
2023111503487	S	USD MXN	11/17/2023	(500,000)	17.34	8,670,200
2023111503494	S	USD MXN	11/17/2023	(44,400)	17.33	769,616
2023111503496	S	USD MXN	11/17/2023	(30,600)	17.33	530,423
2023111503498	S	USD MXN	11/17/2023	(58,800)	17.33	1,019,016
2023111503500	S	USD MXN	11/17/2023	(58,800)	17.33	1,019,210
2023111503502	S	USD MXN	11/17/2023	(58,800)	17.33	1,019,039
2023111503504	S	USD MXN	11/17/2023	(58,800)	17.33	1,019,016
2023111503507	S	USD MXN	11/17/2023	(50,000)	17.33	866,540
2023111503509	S	USD MXN	11/17/2023	(50,000)	17.33	866,545
2023111503550	S	USD MXN	11/17/2023	(500,000)	17.33	8,663,400
2023111503553	S	USD MXN	11/17/2023	(250,000)	17.32	4,330,850
2023111503554	S	USD MXN	11/17/2023	(250,000)	17.32	4,330,925
2023111503649	S	USD MXN	11/17/2023	(248,860)	17.31	4,306,970
2023111503134	B	USD MXN	11/17/2023	10,000,000	17.38	(173,759,700)
2023111503140	B	USD MXN	11/17/2023	1,000,000	17.37	(17,368,820)
2023111503146	B	USD MXN	11/17/2023	1,000,000	17.33	(17,332,230)
2023111503147	B	USD MXN	11/17/2023	1,000,000	17.33	(17,333,500)
2023111503308	B	USD MXN	11/17/2023	250,000	17.34	(4,335,415)
2023111503344	B	USD MXN	11/17/2023	500,000	17.33	(8,665,000)
2023111503417	B	USD MXN	11/17/2023	500,000	17.33	(8,662,500)
2023111503473	B	USD MXN	11/17/2023	188,884	17.34	(3,274,569)
2023111503475	B	USD MXN	11/17/2023	280,300	17.34	(4,859,393)
2023111503478	B	USD MXN	11/17/2023	286,565	17.34	(4,968,005)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023111503480	B	USDMXN	11/17/2023	240,889	17.34	(4,176,148)
2023111503482	B	USDMXN	11/17/2023	165,082	17.34	(2,861,862)
2023111503484	B	USDMXN	11/17/2023	38,280	17.34	(663,702)
2023111503542	B	USDMXN	11/17/2023	75,000	17.33	(1,299,878)
2023111503566	B	USDMXN	11/17/2023	835,200	17.33	(14,469,840)
2023111503822	B	USDMXN	11/21/2023	500,000	17.31	(8,657,100)
2023111503824	B	USDMXN	11/21/2023	500,000	17.31	(8,657,100)
2023111503135	S	USDMXN	12/08/2023	(10,000,000)	17.44	174,372,520
2023111503497	B	USDMXN	12/13/2023	30,600	17.41	(532,752)
2023111503495	B	USDMXN	12/20/2023	44,400	17.43	(773,910)
2023111503785	BO	USDMXN	12/20/2023	48,250	17.40	(839,371)
2023111503501	B	USDMXN	12/27/2023	58,800	17.45	(1,026,190)
2023111503309	S	USDMXN	12/28/2023	(250,000)	17.46	4,365,199
2023111503499	B	USDMXN	01/03/2024	58,800	17.47	(1,027,232)
2023111503503	B	USDMXN	01/10/2024	58,800	17.49	(1,028,390)
2023111503787	BO	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	17.48	(17,477,196)
2023111503505	B	USDMXN	01/17/2024	58,800	17.51	(1,029,501)
2023111503488	B	USDMXN	01/24/2024	500,000	17.54	(8,769,832)
2023111503556	B	USDMXN	01/24/2024	250,000	17.52	(4,380,741)
2023111503483	S	USDMXN	01/31/2024	(165,082)	17.55	2,897,912
2023111503508	B	USDMXN	02/14/2024	50,000	17.59	(879,645)
2023111503481	S	USDMXN	02/28/2024	(240,889)	17.64	4,248,815
2023111503555	B	USDMXN	02/28/2024	250,000	17.63	(4,406,863)
2023111503538	B	USDMXN	03/13/2024	250,000	17.68	(4,418,962)
2023111503510	B	USDMXN	03/14/2024	50,000	17.68	(883,997)
2023111503539	S	USDMXN	04/04/2024	(250,000)	17.74	4,435,134
2023111503543	S	USDMXN	04/04/2024	(75,000)	17.74	1,330,515
2023111503479	S	USDMXN	04/24/2024	(286,565)	17.80	5,102,100
2023111503476	S	USDMXN	05/08/2024	(280,300)	17.85	5,002,232
2023111503551	B	USDMXN	05/29/2024	500,000	17.91	(8,952,920)
2023111503474	S	USDMXN	07/03/2024	(188,884)	18.01	3,401,895
2023111603043	S	USDMXN	11/21/2023	(1,000,000)	17.28	17,284,080
2023111603356	S	USDMXN	11/21/2023	(100,000)	17.26	1,726,220
2023111603386	S	USDMXN	11/21/2023	(250,000)	17.26	4,315,250
2023111603388	S	USDMXN	11/21/2023	(250,000)	17.26	4,315,250
2023111603390	S	USDMXN	11/21/2023	(250,000)	17.26	4,315,350
2023111603392	S	USDMXN	11/21/2023	(250,000)	17.26	4,315,175
2023111603546	S	USDMXN	11/21/2023	(944)	17.24	16,278
2023111603547	S	USDMXN	11/21/2023	(739,056)	17.24	12,743,690
2023111603601	S	USDMXN	11/21/2023	(1,869,000)	17.24	32,212,215
2023111603604	S	USDMXN	11/21/2023	(1,131,000)	17.24	19,492,785
2023111603614	S	USDMXN	11/21/2023	(496,753)	17.24	8,565,219
2023111603622	S	USDMXN	11/21/2023	(103,201)	17.24	1,779,505
2023111603051	B	USDMXN	11/21/2023	1,000,000	17.26	(17,255,000)
2023111603302	B	USDMXN	11/21/2023	1,250,000	17.30	(21,619,700)
2023111603382	B	USDMXN	11/21/2023	25,000	17.26	(431,440)
2023111603619	B	USDMXN	11/21/2023	6,174,960	17.25	(106,499,412)
2023111603626	B	USDMXN	11/21/2023	424,994	17.25	(7,330,339)
2023111603620	S	USDMXN	11/28/2023	(6,174,960)	17.27	106,620,564
2023111603164	BO	USDMXN	11/28/2023	10,000,000	17.26	(172,634,420)
2023111603346	BO	USDMXN	11/29/2023	38,800	17.29	(670,998)
2023111603530	BO	USDMXN	11/30/2023	107,500	17.28	(1,857,183)
2023111603528	BO	USDMXN	12/01/2023	50,000	17.31	(865,328)
2023111603685	SO	USDMXN	12/05/2023	(174,000)	17.31	3,011,256
2023111603345	BO	USDMXN	12/06/2023	130,000	17.31	(2,250,883)
2023111603525	BO	USDMXN	12/06/2023	15,200	17.29	(262,881)
2023111603526	BO	USDMXN	12/06/2023	38,000	17.29	(657,160)
2023111603343	BO	USDMXN	12/07/2023	26,901	17.32	(465,849)
2023111603523	BO	USDMXN	12/13/2023	16,800	17.31	(290,891)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023111603524	BO	USDMXN	12/13/2023	16,800	17.32	(290,895)
2023111603531	BO	USDMXN	12/13/2023	107,500	17.31	(1,861,046)
2023111603341	BO	USDMXN	12/14/2023	26,546	17.34	(460,240)
2023111603521	BO	USDMXN	12/14/2023	300,000	17.31	(5,194,366)
2023111603060	SO	USDMXN	12/15/2023	(110,000)	17.33	1,906,031
2023111603558	SO	USDMXN	12/15/2023	(795)	17.31	13,758
2023111603136	BO	USDMXN	12/15/2023	865,000	17.32	(14,981,327)
2023111603549	BO	USDMXN	12/15/2023	541	17.32	(9,369)
2023111603064	SO	USDMXN	12/19/2023	(764,000)	17.35	13,256,435
2023111603340	BO	USDMXN	12/20/2023	38,400	17.35	(666,426)
2023111603717	BO	USDMXN	12/20/2023	21,500	17.34	(372,856)
2023111603342	BO	USDMXN	12/21/2023	13,926	17.36	(241,700)
2023111603623	B	USDMXN	12/28/2023	103,201	17.35	(1,790,639)
2023111603432	BO	USDMXN	01/04/2024	500,000	17.37	(8,686,927)
2023111603431	BO	USDMXN	01/11/2024	500,000	17.39	(8,696,108)
2023111603107	BO	USDMXN	01/12/2024	620,098	17.40	(10,788,623)
2023111603627	S	USDMXN	01/16/2024	(424,994)	17.41	7,397,716
2023111603433	BO	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.41	(8,705,289)
2023111603111	BO	USDMXN	01/19/2024	2,501,821	17.42	(43,573,249)
2023111603434	BO	USDMXN	01/25/2024	500,000	17.43	(8,714,965)
2023111603435	BO	USDMXN	02/01/2024	500,000	17.45	(8,725,299)
2023111603108	BO	USDMXN	02/02/2024	1,047,905	17.46	(18,293,315)
2023111603436	BO	USDMXN	02/08/2024	500,000	17.47	(8,735,634)
2023111603437	BO	USDMXN	02/15/2024	500,000	17.49	(8,745,968)
2023111603109	BO	USDMXN	02/16/2024	836,292	17.50	(14,633,819)
2023111603438	BO	USDMXN	02/22/2024	500,000	17.51	(8,756,309)
2023111603110	BO	USDMXN	02/23/2024	393,884	17.52	(6,900,521)
2023111603552	BO	USDMXN	02/23/2024	7,885	17.52	(138,131)
2023111603548	B	USDMXN	02/27/2024	739,056	17.53	(12,954,210)
2023111603439	BO	USDMXN	02/29/2024	500,000	17.53	(8,766,689)
2023111603440	BO	USDMXN	03/07/2024	500,000	17.55	(8,777,070)
2023111603441	BO	USDMXN	03/14/2024	500,000	17.57	(8,787,450)
2023111603387	B	USDMXN	03/15/2024	250,000	17.60	(4,399,186)
2023111603442	BO	USDMXN	03/21/2024	500,000	17.60	(8,797,581)
2023111603443	BO	USDMXN	03/27/2024	500,000	17.61	(8,806,395)
2023111603357	B	USDMXN	04/23/2024	100,000	17.71	(1,771,456)
2023111603389	B	USDMXN	04/26/2024	250,000	17.72	(4,430,464)
2023111603391	B	USDMXN	05/31/2024	250,000	17.83	(4,456,802)
2023111603393	B	USDMXN	07/19/2024	250,000	17.97	(4,493,194)
2023111703297	SO	USDMXN	12/01/2023	(156,000)	17.25	2,690,945
2023111703475	SO	USDMXN	12/08/2023	(149,000)	17.26	2,571,578
2023111703053	SO	USDMXN	12/11/2023	(122,000)	17.31	2,111,359
2023111703480	SO	USDMXN	12/11/2023	(30,000)	17.27	518,144
2023112103042	S	USDMXN	11/24/2023	(1,000,000)	17.12	17,120,100
2023112103315	S	USDMXN	11/24/2023	(585,000)	17.19	10,056,092
2023112103339	S	USDMXN	11/24/2023	(1,500,000)	17.21	25,815,000
2023112103441	S	USDMXN	11/24/2023	(800,000)	17.24	13,789,920
2023112103443	S	USDMXN	11/24/2023	(500,000)	17.24	8,620,150
2023112103445	S	USDMXN	11/24/2023	(50,000)	17.23	861,685
2023112103447	S	USDMXN	11/24/2023	(50,000)	17.23	861,690
2023112103449	S	USDMXN	11/24/2023	(50,000)	17.23	861,595
2023112103451	S	USDMXN	11/24/2023	(50,000)	17.23	861,595
2023112103454	S	USDMXN	11/24/2023	(500,000)	17.23	8,616,050
2023112103550	S	USDMXN	11/24/2023	(1,000,000)	17.24	17,237,850
2023112103557	S	USDMXN	11/24/2023	(1,000,000)	17.23	17,227,070
2023112103599	S	USDMXN	11/24/2023	(463,876)	17.23	7,992,870
2023112103601	S	USDMXN	11/24/2023	(906,975)	17.23	15,627,635
2023112103603	S	USDMXN	11/24/2023	(1,346,077)	17.23	23,193,721
2023112103628	S	USDMXN	11/24/2023	(1,000,000)	17.22	17,224,670

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023112103630	S	USDMXN	11/24/2023	(1,000,000)	17.22	17,224,690
2023112103632	S	USDMXN	11/24/2023	(1,000,000)	17.22	17,222,530
2023112103649	S	USDMXN	11/24/2023	(500,000)	17.23	8,612,500
2023112103652	S	USDMXN	11/24/2023	(1,500,000)	17.23	25,837,500
2023112103894	S	USDMXN	11/24/2023	(100,000)	17.19	1,718,877
2023112103095	B	USDMXN	11/24/2023	2,000,000	17.16	(34,311,600)
2023112103096	B	USDMXN	11/24/2023	1,000,000	17.16	(17,157,670)
2023112103388	B	USDMXN	11/24/2023	146,710	17.24	(2,528,928)
2023112103390	B	USDMXN	11/24/2023	147,026	17.24	(2,534,375)
2023112103392	B	USDMXN	11/24/2023	102,070	17.24	(1,759,901)
2023112103394	B	USDMXN	11/24/2023	102,506	17.24	(1,767,419)
2023112103396	B	USDMXN	11/24/2023	245,953	17.24	(4,239,492)
2023112103398	B	USDMXN	11/24/2023	252,091	17.24	(4,346,049)
2023112103401	B	USDMXN	11/24/2023	252,656	17.24	(4,356,017)
2023112103405	B	USDMXN	11/24/2023	253,019	17.26	(4,366,298)
2023112103439	B	USDMXN	11/24/2023	303,843	17.24	(5,237,433)
2023112103507	B	USDMXN	11/24/2023	1,000,000	17.23	(17,227,240)
2023112103515	B	USDMXN	11/24/2023	1,000,000	17.23	(17,227,730)
2023112103517	B	USDMXN	11/24/2023	2,089,626	17.23	(35,993,808)
2023112103594	B	USDMXN	11/24/2023	472,295	17.23	(8,137,871)
2023112103597	B	USDMXN	11/24/2023	155,008	17.23	(2,671,219)
2023112103676	BO	USDMXN	11/29/2023	39,664	17.23	(683,352)
2023112103750	BO	USDMXN	11/29/2023	39,148	17.23	(674,469)
2023112103712	SO	USDMXN	12/01/2023	(35,000)	17.22	602,736
2023112103710	SO	USDMXN	12/05/2023	(302)	17.23	5,203
2023112103707	SO	USDMXN	12/06/2023	(60,800)	17.23	1,047,798
2023112103752	BO	USDMXN	12/06/2023	356,400	17.25	(6,148,171)
2023112103895	B	USDMXN	12/07/2023	100,000	17.23	(1,722,582)
2023112103681	BO	USDMXN	12/11/2023	143,467	17.27	(2,477,802)
2023112103706	SO	USDMXN	12/14/2023	(84,060)	17.26	1,450,826
2023112103687	BO	USDMXN	12/15/2023	78,291	17.28	(1,352,949)
2023112103460	SO	USDMXN	12/20/2023	(73,400)	17.31	1,270,897
2023112103446	B	USDMXN	12/20/2023	50,000	17.31	(865,432)
2023112103693	BO	USDMXN	12/20/2023	79,600	17.29	(1,376,653)
2023112103757	BO	USDMXN	12/20/2023	48,800	17.29	(843,832)
2023112103448	B	USDMXN	12/22/2023	50,000	17.31	(865,715)
2023112103440	S	USDMXN	12/26/2023	(303,843)	17.33	5,265,006
2023112103452	B	USDMXN	12/27/2023	50,000	17.33	(866,355)
2023112103696	BO	USDMXN	12/27/2023	48,800	17.31	(844,782)
2023112103756	BO	USDMXN	12/27/2023	48,800	17.31	(844,821)
2023112103598	S	USDMXN	12/28/2023	(155,008)	17.33	2,685,957
2023112103316	B	USDMXN	12/29/2023	585,000	17.29	(10,115,854)
2023112103450	B	USDMXN	12/29/2023	50,000	17.33	(866,711)
2023112103697	BO	USDMXN	01/03/2024	48,800	17.33	(845,855)
2023112103755	BO	USDMXN	01/03/2024	48,800	17.33	(845,884)
2023112103156	BO	USDMXN	01/10/2024	120,000	17.32	(2,078,520)
2023112103698	BO	USDMXN	01/10/2024	48,800	17.35	(846,665)
2023112103600	B	USDMXN	01/16/2024	463,876	17.38	(8,063,801)
2023112103700	BO	USDMXN	01/17/2024	48,800	17.37	(847,574)
2023112103406	S	USDMXN	01/23/2024	(253,019)	17.43	4,409,444
2023112103402	S	USDMXN	02/06/2024	(252,656)	17.45	4,409,479
2023112103158	BO	USDMXN	02/14/2024	225,000	17.42	(3,919,678)
2023112103602	B	USDMXN	02/16/2024	906,975	17.47	(15,847,744)
2023112103399	S	USDMXN	02/20/2024	(252,091)	17.49	4,409,686
2023112103604	B	USDMXN	02/28/2024	1,346,077	17.51	(23,567,980)
2023112103397	S	USDMXN	03/05/2024	(245,953)	17.53	4,311,461
2023112103154	BO	USDMXN	03/27/2024	150,000	17.54	(2,631,601)
2023112103442	B	USDMXN	03/27/2024	800,000	17.60	(14,077,910)
2023112103395	S	USDMXN	04/02/2024	(102,506)	17.62	1,805,791

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023112103767	BO	USDMXN	04/02/2024	2,890	17.59	(50,850)
2023112103155	BO	USDMXN	04/10/2024	75,000	17.59	(1,318,967)
2023112103444	B	USDMXN	04/24/2024	500,000	17.68	(8,841,846)
2023112103393	S	USDMXN	04/29/2024	(102,070)	17.70	1,806,206
2023112103391	S	USDMXN	05/14/2024	(147,026)	17.73	2,607,416
2023112103163	BO	USDMXN	05/15/2024	34,000	17.69	(601,489)
2023112103389	S	USDMXN	05/28/2024	(146,710)	17.77	2,607,700
2023112103455	B	USDMXN	06/12/2024	500,000	17.82	(8,911,342)
2023112103771	BO	USDMXN	06/27/2024	618	17.85	(11,025)
2023112203108	S	USDMXN	11/27/2023	(1,000,000)	17.20	17,200,000
2023112203129	S	USDMXN	11/27/2023	(3,000,000)	17.21	51,627,300
2023112203195	S	USDMXN	11/27/2023	(2,000,000)	17.20	34,400,000
2023112203211	S	USDMXN	11/27/2023	(2,269)	17.22	39,073
2023112203212	S	USDMXN	11/27/2023	(1,170,000)	17.23	20,156,573
2023112203308	S	USDMXN	11/27/2023	(243,135)	17.22	4,186,785
2023112203425	S	USDMXN	11/27/2023	(36,400)	17.19	625,760
2023112203427	S	USDMXN	11/27/2023	(82,000)	17.19	1,409,728
2023112203429	S	USDMXN	11/27/2023	(34,400)	17.19	591,401
2023112203431	S	USDMXN	11/27/2023	(45,200)	17.19	777,164
2023112203096	B	USDMXN	11/27/2023	1,000,000	17.18	(17,178,980)
2023112203109	B	USDMXN	11/27/2023	1,000,000	17.20	(17,200,550)
2023112203113	B	USDMXN	11/27/2023	1,000,000	17.20	(17,195,860)
2023112203117	B	USDMXN	11/27/2023	1,000,000	17.18	(17,180,620)
2023112203189	B	USDMXN	11/27/2023	1,000,000	17.17	(17,173,680)
2023112203193	B	USDMXN	11/27/2023	1,000,000	17.18	(17,178,690)
2023112203309	B	USDMXN	11/27/2023	243,135	17.22	(4,186,469)
2023112203426	B	USDMXN	12/06/2023	36,400	17.22	(626,731)
2023112203424	SO	USDMXN	12/11/2023	(286,000)	17.23	4,927,548
2023112203428	B	USDMXN	12/13/2023	82,000	17.24	(1,413,577)
2023112203130	SO	USDMXN	12/20/2023	(85,336)	17.28	1,474,967
2023112203430	B	USDMXN	12/20/2023	34,400	17.26	(593,717)
2023112203213	B	USDMXN	12/29/2023	1,170,000	17.32	(20,264,102)
2023112203432	B	USDMXN	01/03/2024	45,200	17.30	(782,099)
2023112203235	SO	USDMXN	01/17/2024	(166,993)	17.36	2,898,879
2023112203310	S	USDMXN	02/28/2024	(243,135)	17.49	4,251,444
2023112203511	BO	USDMXN	02/21/2025	1,630,000	18.44	(30,063,720)
2023112303489	S	USDMXN	11/27/2023	(2,466,579)	17.19	42,394,919
2023112303501	S	USDMXN	11/27/2023	(807,454)	17.19	13,877,542
2023112303503	B	USDMXN	11/27/2023	4,274,033	17.19	(73,485,757)
2023112303361	SO	USDMXN	12/13/2023	(290,000)	17.24	4,998,469
2023112303502	B	USDMXN	12/14/2023	807,454	17.24	(13,917,552)
2023112303366	SO	USDMXN	12/27/2023	(177,019)	17.27	3,057,833
2023112303504	S	USDMXN	02/22/2024	(4,274,033)	17.44	74,556,881
2023112403606	S	USDMXN	11/28/2023	(1,170,000)	17.13	20,038,122
2023112403608	S	USDMXN	11/28/2023	(100,000)	17.13	1,712,710
2023112403514	SO	USDMXN	12/15/2023	(284,000)	17.16	4,873,184
2023112403607	B	USDMXN	12/29/2023	1,170,000	17.22	(20,147,652)
2023112403609	B	USDMXN	02/12/2024	100,000	17.35	(1,734,816)
2023112403541	BO	USDMXN	10/03/2024	305,000	18.04	(5,501,532)
2023112703229	BO	USDMXN	11/28/2023	61,249	17.15	(1,050,396)
2023112703274	B	USDMXN	11/28/2023	12,900,000	17.18	(221,589,460)
2023112703193	S	USDMXN	11/29/2023	(1,000,000)	17.14	17,143,300
2023112703231	S	USDMXN	11/29/2023	(6,920)	17.16	118,718
2023112703275	S	USDMXN	11/29/2023	(12,900,000)	17.18	221,624,580
2023112703435	S	USDMXN	11/29/2023	(1,000,000)	17.13	17,130,400
2023112703655	S	USDMXN	11/29/2023	(585,000)	17.13	10,022,747
2023112703657	S	USDMXN	11/29/2023	(100,000)	17.13	1,713,130
2023112703223	B	USDMXN	11/29/2023	1,000,000	17.17	(17,165,510)
2023112703250	B	USDMXN	11/29/2023	30,000,000	17.17	(514,989,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023112703263	B	USDMXN	11/29/2023	20,000,000	17.16	(343,126,000)
2023112703314	B	USDMXN	11/29/2023	10,000,000	17.17	(171,685,000)
2023112703370	B	USDMXN	11/29/2023	7,000,000	17.16	(120,109,500)
2023112703375	B	USDMXN	11/29/2023	1,000,000	17.16	(17,160,610)
2023112703637	B	USDMXN	11/29/2023	2,000,000	17.14	(34,280,000)
2023112703660	B	USDMXN	11/29/2023	6,240	17.13	(106,922)
2023112703233	BO	USDMXN	11/30/2023	3,840	17.16	(65,888)
2023112703251	S	USDMXN	12/06/2023	(30,000,000)	17.19	515,588,250
2023112703330	BO	USDMXN	12/06/2023	5,000	17.18	(85,900)
2023112703348	B	USDMXN	12/06/2023	5,000	17.18	(85,900)
2023112703651	BO	USDMXN	12/06/2023	36,072	17.16	(618,841)
2023112703652	BO	USDMXN	12/06/2023	36,072	17.16	(618,855)
2023112703237	SO	USDMXN	12/07/2023	(3,840)	17.17	65,952
2023112703234	BO	USDMXN	12/07/2023	3,840	17.18	(65,968)
2023112703235	BO	USDMXN	12/07/2023	3,840	17.18	(65,967)
2023112703658	B	USDMXN	12/07/2023	100,000	17.15	(1,715,486)
2023112703380	BO	USDMXN	12/08/2023	50,000	17.18	(858,977)
2023112703184	BO	USDMXN	12/11/2023	300,000	17.07	(5,121,423)
2023112703264	S	USDMXN	12/13/2023	(20,000,000)	17.20	343,921,100
2023112703227	BO	USDMXN	12/13/2023	72,800	17.20	(1,252,066)
2023112703654	BO	USDMXN	12/13/2023	116,000	17.18	(1,992,440)
2023112703240	BO	USDMXN	12/14/2023	3,840	17.20	(66,043)
2023112703650	BO	USDMXN	12/20/2023	232,000	17.20	(3,989,824)
2023112703241	BO	USDMXN	12/21/2023	3,840	17.22	(66,125)
2023112703309	SO	USDMXN	12/27/2023	(250,000)	17.25	4,312,928
2023112703484	SO	USDMXN	12/27/2023	(6,941)	17.22	119,516
2023112703486	SO	USDMXN	12/27/2023	(43,600)	17.22	750,779
2023112703487	SO	USDMXN	12/27/2023	(76,800)	17.22	1,322,474
2023112703492	BO	USDMXN	12/27/2023	153,600	17.23	(2,645,961)
2023112703493	BO	USDMXN	12/27/2023	87,200	17.23	(1,502,152)
2023112703242	BO	USDMXN	12/28/2023	3,840	17.24	(66,208)
2023112703371	S	USDMXN	12/29/2023	(7,000,000)	17.24	120,706,933
2023112703656	B	USDMXN	12/29/2023	585,000	17.22	(10,073,204)
2023112703225	BO	USDMXN	01/02/2024	70,000	17.26	(1,208,311)
2023112703321	BO	USDMXN	01/03/2024	40,000	17.27	(690,695)
2023112703481	BO	USDMXN	01/03/2024	800	17.24	(13,795)
2023112703653	BO	USDMXN	01/03/2024	41,000	17.24	(706,743)
2023112703226	BO	USDMXN	01/04/2024	70,000	17.27	(1,208,845)
2023112703243	BO	USDMXN	01/04/2024	3,840	17.26	(66,289)
2023112703244	BO	USDMXN	01/11/2024	3,840	17.28	(66,361)
2023112703247	BO	USDMXN	01/25/2024	3,840	17.32	(66,512)
2023112703315	S	USDMXN	01/29/2024	(10,000,000)	17.34	173,426,838
2023112803031	S	USDMXN	11/30/2023	(1,000,000)	17.17	17,173,520
2023112803065	S	USDMXN	11/30/2023	(1,000,000)	17.15	17,153,520
2023112803137	S	USDMXN	11/30/2023	(1,000,000)	17.13	17,133,410
2023112803139	S	USDMXN	11/30/2023	(1,000,000)	17.13	17,130,680
2023112803164	S	USDMXN	11/30/2023	(1,000,000)	17.16	17,159,120
2023112803165	S	USDMXN	11/30/2023	(1,000,000)	17.16	17,156,480
2023112803294	S	USDMXN	11/30/2023	(1,150,000)	17.14	19,705,250
2023112803319	S	USDMXN	11/30/2023	(12,891)	17.14	220,961
2023112803576	S	USDMXN	11/30/2023	(7,670,529)	17.14	131,467,261
2023112803581	S	USDMXN	11/30/2023	(136,914)	17.15	2,347,651
2023112803583	S	USDMXN	11/30/2023	(1,656,950)	17.15	28,415,367
2023112803614	S	USDMXN	11/30/2023	(74,724)	17.14	1,281,001
2023112803616	S	USDMXN	11/30/2023	(194,400)	17.14	3,332,016
2023112803675	S	USDMXN	11/30/2023	(1,160,000)	17.14	19,882,852
2023112803678	S	USDMXN	11/30/2023	(152,753)	17.14	2,618,345
2023112803025	B	USDMXN	11/30/2023	1,000,000	17.18	(17,180,180)
2023112803043	B	USDMXN	11/30/2023	1,000,000	17.16	(17,155,660)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023112803046	B	USDMXN	11/30/2023	1,000,000	17.16	(17,156,930)
2023112803052	B	USDMXN	11/30/2023	1,000,000	17.16	(17,157,220)
2023112803226	B	USDMXN	11/30/2023	2,000,000	17.12	(34,240,000)
2023112803296	B	USDMXN	11/30/2023	253,954	17.14	(4,352,822)
2023112803298	B	USDMXN	11/30/2023	253,383	17.14	(4,343,593)
2023112803302	B	USDMXN	11/30/2023	147,828	17.14	(2,533,654)
2023112803304	B	USDMXN	11/30/2023	147,518	17.14	(2,528,075)
2023112803308	B	USDMXN	11/30/2023	180,332	17.14	(3,090,800)
2023112803309	B	USDMXN	11/30/2023	179,876	17.14	(3,082,931)
2023112803578	B	USDMXN	11/30/2023	9,464,393	17.15	(162,312,447)
2023112803612	SO	USDMXN	12/07/2023	(82,646)	17.16	1,418,058
2023112803615	B	USDMXN	12/13/2023	74,724	17.18	(1,283,797)
2023112803580	S	USDMXN	12/14/2023	(9,464,393)	17.19	162,679,225
2023112803617	B	USDMXN	12/20/2023	194,400	17.20	(3,343,194)
2023112803611	BO	USDMXN	12/27/2023	19,200	17.22	(330,595)
2023112803676	B	USDMXN	12/27/2023	1,160,000	17.22	(19,973,390)
2023112803679	B	USDMXN	12/27/2023	152,753	17.22	(2,630,268)
2023112803582	B	USDMXN	01/23/2024	136,914	17.30	(2,368,767)
2023112803297	S	USDMXN	02/06/2024	(253,954)	17.33	4,401,367
2023112803299	S	USDMXN	02/20/2024	(253,383)	17.37	4,401,943
2023112803584	B	USDMXN	02/28/2024	1,656,950	17.40	(28,837,813)
2023112803303	S	USDMXN	05/14/2024	(147,828)	17.61	2,603,014
2023112803305	S	USDMXN	05/28/2024	(147,518)	17.65	2,603,204
2023112803310	S	USDMXN	07/09/2024	(180,332)	17.77	3,204,208
2023112803320	SO	USDMXN	07/19/2024	(85,000)	17.79	1,512,519
2023112803311	S	USDMXN	07/23/2024	(179,876)	17.81	3,203,167
2023112903143	BO	USDMXN	11/30/2023	63,045	17.21	(1,084,854)
2023112903084	S	USDMXN	12/01/2023	(1,000,000)	17.17	17,169,900
2023112903116	S	USDMXN	12/01/2023	(2,000,000)	17.20	34,409,500
2023112903250	S	USDMXN	12/01/2023	(2,000,000)	17.21	34,424,060
2023112903410	S	USDMXN	12/01/2023	(500,000)	17.21	8,605,000
2023112903642	S	USDMXN	12/01/2023	(150,000)	17.20	2,580,480
2023112903644	S	USDMXN	12/01/2023	(100,000)	17.21	1,720,650
2023112903796	S	USDMXN	12/01/2023	(65,200)	17.26	1,125,512
2023112903798	S	USDMXN	12/01/2023	(240,200)	17.26	4,146,712
2023112903800	S	USDMXN	12/01/2023	(241,400)	17.26	4,166,967
2023112903802	S	USDMXN	12/01/2023	(165,400)	17.26	2,854,819
2023112903805	S	USDMXN	12/01/2023	(55,400)	17.26	956,203
2023112903807	S	USDMXN	12/01/2023	(46,800)	17.26	807,767
2023112903886	S	USDMXN	12/01/2023	(500,000)	17.29	8,646,850
2023112903074	B	USDMXN	12/01/2023	1,000,000	17.17	(17,172,420)
2023112903142	B	USDMXN	12/01/2023	2,000,000	17.20	(34,407,940)
2023112903156	B	USDMXN	12/01/2023	10,000,000	17.18	(171,824,000)
2023112903368	B	USDMXN	12/01/2023	2,000,000	17.21	(34,410,000)
2023112903385	B	USDMXN	12/01/2023	3,000,000	17.20	(51,600,000)
2023112903392	B	USDMXN	12/01/2023	1,350,000	17.20	(23,220,000)
2023112903543	B	USDMXN	12/01/2023	244,042	17.22	(4,201,647)
2023112903545	B	USDMXN	12/01/2023	243,511	17.22	(4,192,943)
2023112903551	B	USDMXN	12/01/2023	12,447	17.22	(214,313)
2023112903793	B	USDMXN	12/01/2023	3,300,000	17.26	(56,958,066)
2023112903812	B	USDMXN	12/01/2023	46,800	17.26	(807,961)
2023112903171	SO	USDMXN	12/06/2023	(5,000)	17.20	86,024
2023112903172	BO	USDMXN	12/13/2023	16,000	17.23	(275,657)
2023112903645	B	USDMXN	12/14/2023	100,000	17.24	(1,724,391)
2023112903561	SO	USDMXN	12/18/2023	(433,000)	17.26	7,474,530
2023112903375	BO	USDMXN	12/18/2023	667,345	17.25	(11,513,936)
2023112903572	SO	USDMXN	12/19/2023	(130,000)	17.26	2,243,190
2023112903175	SO	USDMXN	12/27/2023	(19,326)	17.26	333,633
2023112903810	BO	USDMXN	12/27/2023	38,000	17.34	(658,833)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023112903177	BO	USDMXN	12/29/2023	38,873	17.27	(671,299)
2023112903100	SO	USDMXN	01/03/2024	(259,498)	17.27	4,481,213
2023112903099	SO	USDMXN	01/04/2024	(86,000)	17.27	1,484,945
2023112903190	SO	USDMXN	01/04/2024	(575)	17.28	9,944
2023112903643	B	USDMXN	01/10/2024	150,000	17.32	(2,597,394)
2023112903181	BO	USDMXN	01/18/2024	2,660	17.33	(46,090)
2023112903808	B	USDMXN	01/24/2024	46,800	17.42	(815,184)
2023112903183	SO	USDMXN	01/25/2024	(1,180)	17.34	20,467
2023112903184	BO	USDMXN	02/08/2024	2,660	17.39	(46,250)
2023112903549	S	USDMXN	02/14/2024	(244,042)	17.43	4,252,973
2023112903185	BO	USDMXN	02/15/2024	2,660	17.41	(46,304)
2023112903186	BO	USDMXN	02/22/2024	2,660	17.43	(46,355)
2023112903546	S	USDMXN	02/28/2024	(243,511)	17.47	4,253,675
2023112903806	B	USDMXN	02/28/2024	55,400	17.51	(970,213)
2023112903157	S	USDMXN	03/01/2024	(10,000,000)	17.44	174,368,375
2023112903164	BO	USDMXN	03/07/2024	2,660	17.46	(46,454)
2023112903544	S	USDMXN	03/14/2024	(244,042)	17.51	4,272,820
2023112903165	BO	USDMXN	03/14/2024	2,660	17.49	(46,512)
2023112903550	B	USDMXN	03/14/2024	244,042	17.51	(4,273,002)
2023112903166	BO	USDMXN	03/21/2024	2,660	17.51	(46,566)
2023112903803	B	USDMXN	03/27/2024	165,400	17.59	(2,910,112)
2023112903167	BO	USDMXN	04/04/2024	22,110	17.55	(387,939)
2023112903801	B	USDMXN	04/30/2024	241,400	17.70	(4,271,652)
2023112903429	SO	USDMXN	05/08/2024	(283,206)	17.67	5,004,254
2023112903416	SO	USDMXN	05/22/2024	(282,400)	17.70	4,999,853
2023112903797	B	USDMXN	06/28/2024	65,200	17.88	(1,165,520)
2023112903799	B	USDMXN	07/31/2024	240,200	17.97	(4,316,916)
2023112903625	BO	USDMXN	02/28/2025	1,530,000	18.45	(28,231,560)
2023112903628	BO	USDMXN	02/28/2025	1,530,000	18.45	(28,231,560)
2023113003122	S	USDMXN	12/04/2023	(1,000,000)	17.43	17,429,210
2023113003123	S	USDMXN	12/04/2023	(1,000,000)	17.43	17,427,100
2023113003186	S	USDMXN	12/04/2023	(1,000,000)	17.39	17,388,940
2023113003629	S	USDMXN	12/04/2023	(585,000)	17.40	10,177,479
2023113003784	S	USDMXN	12/04/2023	(241,156)	17.38	4,190,397
2023113003794	S	USDMXN	12/04/2023	(512,782)	17.37	8,909,233
2023113003047	B	USDMXN	12/04/2023	1,000,000	17.49	(17,490,130)
2023113003083	B	USDMXN	12/04/2023	1,000,000	17.46	(17,462,750)
2023113003181	B	USDMXN	12/04/2023	1,000,000	17.37	(17,374,110)
2023113003792	B	USDMXN	12/04/2023	482,917	17.38	(8,391,900)
2023113003797	B	USDMXN	12/04/2023	271,021	17.38	(4,709,659)
2023113003788	S	USDMXN	12/14/2023	(4,258,892)	17.40	74,116,164
2023113003793	S	USDMXN	12/14/2023	(482,917)	17.40	8,404,870
2023113003034	SO	USDMXN	12/26/2023	(450,000)	17.49	7,868,415
2023113003241	SO	USDMXN	12/26/2023	(2,580)	17.45	45,027
2023113003260	SO	USDMXN	12/26/2023	(100,000)	17.43	1,742,967
2023113003684	SO	USDMXN	12/26/2023	(3,734)	17.45	65,174
2023113003686	BO	USDMXN	12/26/2023	7,468	17.46	(130,376)
2023113003795	B	USDMXN	12/28/2023	512,782	17.44	(8,944,674)
2023113003630	B	USDMXN	12/29/2023	585,000	17.47	(10,219,711)
2023113003762	BO	USDMXN	01/03/2024	72,500	17.47	(1,266,874)
2023113003030	SO	USDMXN	01/04/2024	(57,111)	17.49	998,676
2023113003041	SO	USDMXN	01/04/2024	(518,000)	17.55	9,091,287
2023113003242	SO	USDMXN	01/04/2024	(765)	17.47	13,363
2023113003042	SO	USDMXN	01/09/2024	(220,000)	17.57	3,865,460
2023113003207	SO	USDMXN	01/09/2024	(220,000)	17.47	3,842,856
2023113003239	SO	USDMXN	01/09/2024	(40,912)	17.49	715,548
2023113003240	SO	USDMXN	01/09/2024	(310)	17.49	5,422
2023113003243	SO	USDMXN	01/09/2024	(310)	17.49	5,422
2023113003245	BO	USDMXN	01/09/2024	310	17.49	(5,423)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023113003682	SO	USDMXN	01/10/2024	(380,339)	17.50	6,655,141
2023113003031	SO	USDMXN	01/11/2024	(1,180)	17.51	20,662
2023113003798	S	USDMXN	01/30/2024	(271,021)	17.53	4,751,782
2023113003789	B	USDMXN	02/22/2024	4,258,892	17.60	(74,970,451)
2023120103038	S	USDMXN	12/05/2023	(1,000,000)	17.23	17,233,650
2023120103046	S	USDMXN	12/05/2023	(1,000,000)	17.23	17,225,500
2023120103138	S	USDMXN	12/05/2023	(1,000,000)	17.28	17,277,110
2023120103122	B	USDMXN	12/05/2023	1,000,000	17.26	(17,263,100)
2023120103124	B	USDMXN	12/05/2023	1,000,000	17.26	(17,263,190)
2023120103140	B	USDMXN	12/05/2023	1,000,000	17.26	(17,264,530)
2023120103199	B	USDMXN	12/05/2023	1,000,000	17.20	(17,200,950)
2023120103360	BO	USDMXN	01/02/2024	500,000	17.40	(8,699,843)
2023120103420	BO	USDMXN	01/02/2024	775,000	17.27	(13,382,541)
2023120103414	BO	USDMXN	01/03/2024	304,800	17.28	(5,265,712)
2023120103415	BO	USDMXN	01/10/2024	28,000	17.29	(484,259)
2023120103057	SO	USDMXN	01/11/2024	(138,000)	17.33	2,390,977
2023120103416	BO	USDMXN	01/24/2024	28,000	17.34	(485,390)
2023120103361	BO	USDMXN	02/01/2024	500,000	17.50	(8,751,877)
2023120403082	S	USDMXN	12/06/2023	(1,000,000)	17.31	17,312,410
2023120403128	S	USDMXN	12/06/2023	(1,000,000)	17.31	17,310,660
2023120403151	S	USDMXN	12/06/2023	(1,000,000)	17.38	17,384,820
2023120403251	S	USDMXN	12/06/2023	(1,000,000)	17.42	17,416,670
2023120403263	S	USDMXN	12/06/2023	(1,000,000)	17.42	17,420,340
2023120403543	S	USDMXN	12/06/2023	(39,840,000)	17.52	697,996,800
2023120403139	B	USDMXN	12/06/2023	1,000,000	17.33	(17,330,490)
2023120403141	B	USDMXN	12/06/2023	1,000,000	17.34	(17,336,150)
2023120403142	B	USDMXN	12/06/2023	1,000,000	17.34	(17,335,150)
2023120403266	B	USDMXN	12/06/2023	1,000,000	17.45	(17,449,710)
2023120403280	B	USDMXN	12/06/2023	1,000,000	17.43	(17,429,560)
2023120403387	B	USDMXN	12/06/2023	800,000	17.48	(13,985,440)
2023120403389	B	USDMXN	12/06/2023	500,000	17.48	(8,739,300)
2023120403544	B	USDMXN	12/07/2023	39,840,000	17.52	(698,110,344)
2023120403388	S	USDMXN	12/14/2023	(800,000)	17.50	14,003,121
2023120403390	S	USDMXN	01/02/2024	(500,000)	17.55	8,776,234
2023120403604	BO	USDMXN	01/03/2024	51,600	17.54	(905,160)
2023120403603	SO	USDMXN	01/04/2024	(133,839)	17.53	2,346,668
2023120403602	SO	USDMXN	01/11/2024	(126,607)	17.56	2,222,622
2023120403571	SO	USDMXN	06/21/2024	(200,000)	18.02	3,604,390
2023120503026	S	USDMXN	12/06/2023	(15,000,000)	17.46	261,945,000
2023120503186	BO	USDMXN	12/06/2023	39,740	17.46	(693,767)
2023120503054	S	USDMXN	12/07/2023	(1,000,000)	17.43	17,430,450
2023120503060	S	USDMXN	12/07/2023	(1,000,000)	17.43	17,433,800
2023120503137	S	USDMXN	12/07/2023	(40,200)	17.42	700,320
2023120503163	S	USDMXN	12/07/2023	(2,000,000)	17.47	34,940,000
2023120503345	S	USDMXN	12/07/2023	(1,000,000)	17.39	17,391,070
2023120503576	S	USDMXN	12/07/2023	(1,806,991)	17.42	31,478,145
2023120503646	S	USDMXN	12/07/2023	(193,009)	17.38	3,355,255
2023120503027	B	USDMXN	12/07/2023	15,000,000	17.47	(261,994,500)
2023120503122	B	USDMXN	12/07/2023	1,000,000	17.48	(17,478,490)
2023120503123	B	USDMXN	12/07/2023	1,000,000	17.48	(17,477,100)
2023120503131	B	USDMXN	12/07/2023	2,000,000	17.43	(34,860,000)
2023120503190	B	USDMXN	12/07/2023	200	17.47	(3,494)
2023120503314	B	USDMXN	12/07/2023	1,000,000	17.44	(17,438,850)
2023120503551	B	USDMXN	12/07/2023	1,000,000	17.42	(17,422,390)
2023120503578	B	USDMXN	12/07/2023	1,000,000	17.42	(17,419,860)
2023120503057	SO	USDMXN	12/13/2023	(188,000)	17.44	3,278,835
2023120503143	SO	USDMXN	12/13/2023	(728)	17.44	12,693
2023120503355	SO	USDMXN	12/14/2023	(46,525)	17.40	809,617
2023120503144	SO	USDMXN	12/18/2023	(29,329)	17.47	512,248

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023120503150	SO	USDMXN	12/18/2023	(30)	17.46	524
2023120503356	SO	USDMXN	12/18/2023	(29,387)	17.41	511,755
2023120503694	BO	USDMXN	12/18/2023	29,387	17.41	(511,709)
2023120503352	SO	USDMXN	12/21/2023	(333,448)	17.42	5,809,318
2023120503354	SO	USDMXN	12/21/2023	(80,145)	17.42	1,396,259
2023120503374	BO	USDMXN	12/21/2023	15,740	17.42	(274,228)
2023120503349	SO	USDMXN	12/22/2023	(59,166)	17.42	1,030,929
2023120503466	SO	USDMXN	12/22/2023	(38,817)	17.43	676,591
2023120503566	S	USDMXN	12/28/2023	(142,831)	17.48	2,496,624
2023120503568	S	USDMXN	12/28/2023	(448,422)	17.48	7,837,780
2023120503570	S	USDMXN	12/28/2023	(308,866)	17.48	5,398,011
2023120503573	S	USDMXN	12/28/2023	(569,378)	17.48	9,950,814
2023120503375	BO	USDMXN	12/28/2023	29,552	17.44	(515,468)
2023120503376	BO	USDMXN	01/04/2024	15,093	17.46	(263,506)
2023120503142	BO	USDMXN	01/09/2024	100	17.52	(1,752)
2023120503567	B	USDMXN	01/10/2024	142,831	17.52	(2,501,932)
2023120503141	SO	USDMXN	01/11/2024	(369)	17.51	6,469
2023120503569	B	USDMXN	01/16/2024	448,422	17.53	(7,862,121)
2023120503571	B	USDMXN	01/30/2024	308,866	17.57	(5,427,115)
2023120503348	SO	USDMXN	02/06/2024	(249,895)	17.56	4,388,886
2023120503347	SO	USDMXN	02/20/2024	(249,490)	17.60	4,390,038
2023120503574	B	USDMXN	03/14/2024	569,378	17.69	(10,074,648)
2023120503577	B	USDMXN	03/14/2024	1,806,991	17.70	(31,980,666)
2023120503346	SO	USDMXN	05/14/2024	(145,406)	17.84	2,593,366
2023120503138	B	USDMXN	05/31/2024	40,200	17.93	(720,892)
2023120503130	SO	USDMXN	07/31/2024	(40,200)	18.12	728,574
2023120503133	SO	USDMXN	09/17/2024	(16,031)	18.25	292,643
2023120603123	S	USDMXN	12/08/2023	(1,000,000)	17.29	17,288,960
2023120603145	S	USDMXN	12/08/2023	(10,000,000)	17.28	172,800,000
2023120603208	S	USDMXN	12/08/2023	(1,000,000)	17.26	17,262,130
2023120603345	S	USDMXN	12/08/2023	(787,500)	17.28	13,611,426
2023120603117	B	USDMXN	12/08/2023	5,000,000	17.27	(86,365,000)
2023120603128	B	USDMXN	12/08/2023	1,000,000	17.28	(17,284,290)
2023120603199	B	USDMXN	12/08/2023	1,000,000	17.26	(17,259,330)
2023120603530	B	USDMXN	12/08/2023	500,000	17.30	(8,647,690)
2023120603573	B	USDMXN	12/08/2023	500,000	17.28	(8,642,470)
2023120603625	B	USDMXN	12/11/2023	500,000	17.28	(8,639,610)
2023120603434	SO	USDMXN	12/14/2023	(79,856)	17.30	1,381,563
2023120603462	SO	USDMXN	12/22/2023	(129,000)	17.33	2,235,245
2023120603463	SO	USDMXN	12/26/2023	(199,000)	17.34	3,450,397
2023120603346	B	USDMXN	01/02/2024	787,500	17.36	(13,667,744)
2023120603151	SO	USDMXN	02/14/2024	(245,000)	17.46	4,276,888
2023120603146	B	USDMXN	09/09/2024	10,000,000	18.08	(180,780,000)
2023120603118	S	USDMXN	12/09/2024	(5,000,000)	18.34	91,690,000
2023120703340	S	USDMXN	12/08/2023	(20,000,000)	17.31	346,200,000
2023120703344	S	USDMXN	12/08/2023	(20,000,000)	17.31	346,200,000
2023120703813	S	USDMXN	12/08/2023	(10,000,000)	17.47	174,696,200
2023120703539	S	USDMXN	12/11/2023	(3,000,000)	17.45	52,350,000
2023120703722	S	USDMXN	12/11/2023	(1,000,000)	17.47	17,470,000
2023120703727	S	USDMXN	12/11/2023	(153,600)	17.47	2,683,599
2023120703729	S	USDMXN	12/11/2023	(46,800)	17.47	817,545
2023120703731	S	USDMXN	12/11/2023	(61,400)	17.47	1,072,524
2023120703733	S	USDMXN	12/11/2023	(61,600)	17.47	1,076,022
2023120703735	S	USDMXN	12/11/2023	(61,600)	17.47	1,076,005
2023120703737	S	USDMXN	12/11/2023	(61,600)	17.47	1,075,896
2023120703830	S	USDMXN	12/11/2023	(500,000)	17.47	8,735,920
2023120703341	B	USDMXN	12/11/2023	20,000,000	17.32	(346,374,000)
2023120703345	B	USDMXN	12/11/2023	20,000,000	17.32	(346,377,000)
2023120703451	B	USDMXN	12/11/2023	1,000,000	17.44	(17,441,440)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023120703637	B	USDMXN	12/11/2023	115,578	17.50	(2,022,132)
2023120703639	B	USDMXN	12/11/2023	467,948	17.50	(8,187,583)
2023120703652	B	USDMXN	12/11/2023	1,423,779	17.50	(24,918,553)
2023120703814	B	USDMXN	12/11/2023	10,000,000	17.48	(174,785,000)
2023120703035	SO	USDMXN	12/22/2023	(72,000)	17.35	1,249,503
2023120703334	SO	USDMXN	12/22/2023	(642)	17.45	11,203
2023120703335	SO	USDMXN	12/22/2023	(57,670)	17.45	1,006,346
2023120703337	SO	USDMXN	12/22/2023	(40,230)	17.45	702,206
2023120703655	SO	USDMXN	12/22/2023	(35,744)	17.53	626,487
2023120703509	SO	USDMXN	12/26/2023	(260,000)	17.49	4,546,141
2023120703728	B	USDMXN	01/03/2024	153,600	17.54	(2,693,766)
2023120703336	BO	USDMXN	01/04/2024	34,519	17.50	(603,943)
2023120703338	BO	USDMXN	01/04/2024	31,930	17.50	(558,620)
2023120703783	SO	USDMXN	01/09/2024	(500,000)	17.58	8,787,890
2023120703730	B	USDMXN	01/10/2024	46,800	17.56	(821,586)
2023120703638	S	USDMXN	01/23/2024	(115,578)	17.62	2,036,366
2023120703732	B	USDMXN	01/24/2024	61,400	17.59	(1,080,285)
2023120703653	S	USDMXN	01/30/2024	(1,423,779)	17.64	25,122,402
2023120703734	B	USDMXN	01/31/2024	61,600	17.61	(1,085,041)
2023120703736	B	USDMXN	02/07/2024	61,600	17.63	(1,086,259)
2023120703738	B	USDMXN	02/14/2024	61,600	17.65	(1,087,376)
2023120703533	SO	USDMXN	02/23/2024	(160,000)	17.66	2,825,339
2023120703656	BO	USDMXN	02/23/2024	60,000	17.73	(1,063,901)
2023120703640	S	USDMXN	03/14/2024	(467,948)	17.76	8,312,610
2023120703415	BO	USDMXN	03/07/2025	1,500,000	18.71	(28,069,500)
2023120803026	S	USDMXN	12/11/2023	(250,000,000)	17.40	4,350,000,000
2023120803151	S	USDMXN	12/11/2023	(30,000,000)	17.36	520,680,000
2023120803098	S	USDMXN	12/13/2023	(1,000,000)	17.31	17,308,830
2023120803099	S	USDMXN	12/13/2023	(2,000,000)	17.31	34,616,360
2023120803359	S	USDMXN	12/13/2023	(250,000)	17.36	4,339,175
2023120803361	S	USDMXN	12/13/2023	(250,000)	17.36	4,339,150
2023120803363	S	USDMXN	12/13/2023	(250,000)	17.36	4,339,225
2023120803365	S	USDMXN	12/13/2023	(250,000)	17.36	4,339,150
2023120803470	S	USDMXN	12/13/2023	(200,000)	17.36	3,471,740
2023120803495	S	USDMXN	12/13/2023	(787,500)	17.36	13,670,685
2023120803751	S	USDMXN	12/13/2023	(1,288)	17.35	22,344
2023120803027	B	USDMXN	12/13/2023	250,000,000	17.41	(4,351,425,000)
2023120803042	B	USDMXN	12/13/2023	1,000,000	17.37	(17,366,500)
2023120803071	B	USDMXN	12/13/2023	1,000,000	17.37	(17,374,000)
2023120803082	B	USDMXN	12/13/2023	1,000,000	17.36	(17,357,650)
2023120803148	B	USDMXN	12/13/2023	2,000,000	17.36	(34,711,980)
2023120803152	B	USDMXN	12/13/2023	30,000,000	17.36	(520,852,500)
2023120803156	B	USDMXN	12/13/2023	3,000,000	17.35	(52,062,480)
2023120803356	B	USDMXN	12/13/2023	1,000,000	17.36	(17,359,710)
2023120803149	SO	USDMXN	12/22/2023	(87,596)	17.38	1,522,048
2023120803494	SO	USDMXN	12/26/2023	(76,000)	17.40	1,322,351
2023120803673	SO	USDMXN	12/28/2023	(76,536)	17.40	1,331,521
2023120803496	B	USDMXN	01/02/2024	787,500	17.42	(13,716,774)
2023120803360	B	USDMXN	01/04/2024	250,000	17.42	(4,355,209)
2023120803630	BO	USDMXN	01/10/2024	81,600	17.44	(1,422,869)
2023120803362	B	USDMXN	01/11/2024	250,000	17.44	(4,360,043)
2023120803479	BO	USDMXN	01/17/2024	65,440	17.46	(1,142,538)
2023120803628	BO	USDMXN	01/17/2024	105,200	17.46	(1,836,516)
2023120803364	B	USDMXN	01/18/2024	250,000	17.46	(4,365,014)
2023120803480	BO	USDMXN	01/24/2024	36,800	17.48	(643,224)
2023120803481	BO	USDMXN	01/24/2024	36,800	17.48	(643,217)
2023120803366	B	USDMXN	01/25/2024	250,000	17.48	(4,369,931)
2023120803475	BO	USDMXN	01/31/2024	32,720	17.50	(572,600)
2023120803483	BO	USDMXN	01/31/2024	36,800	17.50	(643,982)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023120803478	BO	USDMXN	02/14/2024	32,720	17.54	(573,906)
2023120803484	BO	USDMXN	02/14/2024	32,720	17.54	(573,863)
2023120803471	B	USDMXN	02/15/2024	200,000	17.54	(3,508,417)
2023120803486	BO	USDMXN	02/21/2024	32,720	17.56	(574,501)
2023120803647	BO	USDMXN	04/18/2024	94,488	17.72	(1,674,233)
2023120803652	BO	USDMXN	04/18/2024	10,124	17.72	(179,394)
2023121103398	S	USDMXN	12/11/2023	(1,700,000)	17.44	29,648,000
2023121103299	S	USDMXN	12/13/2023	(50,000,000)	17.45	872,500,000
2023121103399	B	USDMXN	12/13/2023	1,700,000	17.45	(29,656,840)
2023121103607	BO	USDMXN	12/13/2023	5,000,000	17.40	(86,994,175)
2023121103131	S	USDMXN	12/14/2023	(1,000,000)	17.44	17,436,350
2023121103161	S	USDMXN	12/14/2023	(1,000,000)	17.45	17,451,860
2023121103384	S	USDMXN	12/14/2023	(1,000,000)	17.45	17,450,000
2023121103469	S	USDMXN	12/14/2023	(47,591)	17.43	829,578
2023121103473	S	USDMXN	12/14/2023	(21,183)	17.43	369,287
2023121103705	S	USDMXN	12/14/2023	(10,000,000)	17.44	174,379,000
2023121103137	B	USDMXN	12/14/2023	1,000,000	17.46	(17,457,950)
2023121103139	B	USDMXN	12/14/2023	1,000,000	17.46	(17,460,460)
2023121103205	B	USDMXN	12/14/2023	1,000,000	17.43	(17,429,370)
2023121103444	B	USDMXN	12/14/2023	1,700,000	17.44	(29,639,500)
2023121103480	B	USDMXN	12/14/2023	68,774	17.43	(1,198,917)
2023121103748	B	USDMXN	12/14/2023	25,000	17.40	(434,907)
2023121103300	B	USDMXN	12/15/2023	50,000,000	17.46	(872,770,000)
2023121103474	B	USDMXN	12/20/2023	21,183	17.45	(369,665)
2023121103593	BO	USDMXN	12/20/2023	76,000	17.42	(1,323,991)
2023121103747	BO	USDMXN	12/20/2023	46,349	17.41	(807,164)
2023121103470	B	USDMXN	12/22/2023	47,591	17.46	(830,705)
2023121103746	BO	USDMXN	12/22/2023	270,218	17.42	(4,707,688)
2023121103706	B	USDMXN	12/28/2023	10,000,000	17.48	(174,783,610)
2023121103171	SO	USDMXN	12/29/2023	(275,000)	17.49	4,810,995
2023121103143	SO	USDMXN	01/08/2024	(195,362)	17.53	3,425,175
2023121103592	BO	USDMXN	01/08/2024	53,000	17.47	(926,174)
2023121303631	S	USDMXN	12/15/2023	(1,000,000)	17.32	17,323,500
2023121303735	S	USDMXN	12/15/2023	(1,000,000)	17.23	17,225,320
2023121303737	S	USDMXN	12/15/2023	(1,000,000)	17.24	17,235,950
2023121303542	B	USDMXN	12/15/2023	1,000,000	17.35	(17,349,670)
2023121303632	B	USDMXN	12/15/2023	1,000,000	17.27	(17,270,020)
2023121303725	B	USDMXN	12/15/2023	1,000,000	17.26	(17,263,450)
2023121303731	B	USDMXN	12/15/2023	1,000,000	17.26	(17,262,990)
2023121303122	SO	USDMXN	12/20/2023	(550,000)	17.40	9,572,162
2023121303130	SO	USDMXN	12/21/2023	(70,000)	17.41	1,218,886
2023121303977	BO	USDMXN	01/31/2024	140,000	17.41	(2,437,619)
2023121303979	BO	USDMXN	02/29/2024	140,000	17.49	(2,448,833)
2023121303980	BO	USDMXN	03/27/2024	280,000	17.57	(4,918,354)
2023121303260	BO	USDMXN	03/14/2025	1,530,000	18.70	(28,614,060)
2023121303262	BO	USDMXN	03/14/2025	1,530,000	18.70	(28,614,060)
2023121403074	S	USDMXN	12/15/2023	(50,000,000)	17.30	865,000,000
2023121403583	B	USDMXN	12/15/2023	250,000	17.41	(4,352,925)
2023121403051	S	USDMXN	12/18/2023	(1,000,000)	17.31	17,314,120
2023121403657	S	USDMXN	12/18/2023	(500,000)	17.15	8,575,250
2023121403662	S	USDMXN	12/18/2023	(500,000)	17.16	8,579,150
2023121403668	S	USDMXN	12/18/2023	(500,000)	17.16	8,577,750
2023121403670	S	USDMXN	12/18/2023	(500,000)	17.16	8,578,800
2023121403860	S	USDMXN	12/18/2023	(250,000)	17.19	4,298,413
2023121403046	B	USDMXN	12/18/2023	1,000,000	17.35	(17,351,210)
2023121403564	B	USDMXN	12/18/2023	1,000,000	17.24	(17,239,130)
2023121403595	B	USDMXN	12/18/2023	1,000,000	17.22	(17,219,550)
2023121403643	B	USDMXN	12/18/2023	1,000,000	17.15	(17,148,940)
2023121403790	B	USDMXN	12/18/2023	1,000,000	17.20	(17,200,000)
2023121403791	B	USDMXN	12/18/2023	430,000	17.20	(7,395,699)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121403906	B	USDMXN	12/18/2023	22,740	17.20	(391,062)
2023121403075	B	USDMXN	12/19/2023	50,000,000	17.31	(865,520,000)
2023121403429	SO	USDMXN	12/28/2023	(568,000)	17.30	9,828,560
2023121403175	SO	USDMXN	01/03/2024	(197,000)	17.34	3,416,451
2023121403658	B	USDMXN	01/04/2024	500,000	17.20	(8,599,630)
2023121403559	SO	USDMXN	01/05/2024	(330,000)	17.25	5,693,404
2023121403663	B	USDMXN	01/11/2024	500,000	17.23	(8,613,632)
2023121403669	B	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.24	(8,621,683)
2023121403671	B	USDMXN	01/25/2024	500,000	17.27	(8,632,560)
2023121403847	BO	USDMXN	02/28/2024	50,000	17.39	(869,348)
2023121403824	BO	USDMXN	03/27/2024	350,000	17.47	(6,114,968)
2023121403846	BO	USDMXN	04/24/2024	130,000	17.55	(2,281,396)
2023121403845	BO	USDMXN	05/15/2024	110,000	17.61	(1,936,968)
2023121403844	BO	USDMXN	06/12/2024	180,000	17.69	(3,184,412)
2023121503250	B	USDMXN	12/15/2023	50,000,000	17.21	(860,500,000)
2023121503251	S	USDMXN	12/18/2023	(50,000,000)	17.22	860,935,000
2023121503359	S	USDMXN	12/18/2023	(1,100,000)	17.19	18,904,325
2023121503361	S	USDMXN	12/18/2023	(207,800)	17.19	3,571,222
2023121503366	S	USDMXN	12/18/2023	(475,300)	17.19	8,168,415
2023121503374	S	USDMXN	12/18/2023	(500,000)	17.19	8,592,750
2023121503363	B	USDMXN	12/18/2023	310,794	17.19	(5,341,993)
2023121503369	B	USDMXN	12/18/2023	405,263	17.19	(6,965,628)
2023121503371	B	USDMXN	12/18/2023	136,484	17.19	(2,345,913)
2023121503381	B	USDMXN	12/18/2023	1,930,559	17.19	(33,181,579)
2023121503339	S	USDMXN	12/19/2023	(10,000,000)	17.19	171,901,000
2023121503382	S	USDMXN	12/19/2023	(1,930,559)	17.19	33,187,274
2023121503508	S	USDMXN	12/19/2023	(787,500)	17.19	13,537,598
2023121503602	S	USDMXN	12/19/2023	(36,023)	17.22	620,438
2023121503616	S	USDMXN	12/19/2023	(29,000)	17.22	499,461
2023121503040	B	USDMXN	12/19/2023	1,000,000	17.20	(17,201,150)
2023121503042	B	USDMXN	12/19/2023	1,000,000	17.20	(17,200,300)
2023121503465	B	USDMXN	12/19/2023	25,000	17.19	(429,763)
2023121503533	B	USDMXN	12/19/2023	4,965	17.21	(85,438)
2023121503597	B	USDMXN	12/19/2023	429,000	17.23	(7,389,568)
2023121503605	B	USDMXN	12/19/2023	36,023	17.23	(620,542)
2023121503615	SO	USDMXN	12/20/2023	(6,501)	17.22	111,980
2023121503606	S	USDMXN	12/21/2023	(36,023)	17.23	620,749
2023121503623	SO	USDMXN	12/21/2023	(900)	17.23	15,508
2023121503612	SO	USDMXN	12/22/2023	(64,922)	17.23	1,118,878
2023121503613	SO	USDMXN	12/27/2023	(20,800)	17.25	358,760
2023121503614	BO	USDMXN	12/28/2023	50,119	17.26	(864,798)
2023121503625	SO	USDMXN	01/02/2024	(3,000)	17.26	51,790
2023121503651	SO	USDMXN	01/03/2024	(818)	17.26	14,118
2023121503598	S	USDMXN	01/05/2024	(429,000)	17.27	7,409,571
2023121503629	SO	USDMXN	01/05/2024	(553)	17.27	9,557
2023121503626	BO	USDMXN	01/08/2024	1,493	17.29	(25,814)
2023121503631	BO	USDMXN	01/10/2024	1,750	17.29	(30,271)
2023121503617	SO	USDMXN	01/11/2024	(58,687)	17.29	1,014,606
2023121503652	BO	USDMXN	01/11/2024	100	17.29	(1,729)
2023121503372	S	USDMXN	01/16/2024	(136,484)	17.27	2,357,039
2023121503620	SO	USDMXN	01/17/2024	(25,600)	17.31	443,050
2023121503360	B	USDMXN	01/24/2024	1,100,000	17.29	(19,019,938)
2023121503362	B	USDMXN	01/30/2024	207,800	17.31	(3,596,573)
2023121503509	B	USDMXN	01/31/2024	787,500	17.31	(13,633,546)
2023121503364	S	USDMXN	02/08/2024	(310,794)	17.33	5,387,486
2023121503634	BO	USDMXN	02/14/2024	1,530	17.39	(26,613)
2023121503340	B	USDMXN	02/20/2024	10,000,000	17.37	(173,684,162)
2023121503367	B	USDMXN	03/14/2024	475,300	17.43	(8,285,022)
2023121503370	S	USDMXN	03/22/2024	(405,263)	17.45	7,073,439
2023121503636	BO	USDMXN	03/27/2024	2,253	17.51	(39,447)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121503639	BO	USDMXN	04/29/2024	5,602	17.60	(98,622)
2023121503646	BO	USDMXN	05/28/2024	4,461	17.68	(78,886)
2023121503375	B	USDMXN	05/29/2024	500,000	17.65	(8,825,671)
2023121503641	BO	USDMXN	06/24/2024	4,442	17.77	(78,916)
2023121503642	BO	USDMXN	07/29/2024	5,520	17.87	(98,638)
2023121503643	BO	USDMXN	08/26/2024	8,791	17.95	(157,797)
2023121503644	BO	USDMXN	09/30/2024	10,926	18.05	(197,238)
2023121503655	BO	USDMXN	10/03/2024	68	18.06	(1,228)
2023121503647	BO	USDMXN	10/28/2024	8,702	18.13	(157,763)
2023121503649	BO	USDMXN	11/25/2024	8,663	18.21	(157,758)
2023121803413	S	USDMXN	12/18/2023	(1,700,000)	17.18	29,206,000
2023121803058	S	USDMXN	12/20/2023	(1,000,000)	17.24	17,244,930
2023121803717	S	USDMXN	12/20/2023	(1,575,000)	17.16	27,031,253
2023121803750	S	USDMXN	12/20/2023	(2,000,000)	17.16	34,325,420
2023121803802	S	USDMXN	12/20/2023	(90,955)	17.16	1,561,130
2023121803055	B	USDMXN	12/20/2023	1,000,000	17.26	(17,260,100)
2023121803757	B	USDMXN	12/20/2023	277,435	17.17	(4,762,899)
2023121803784	B	USDMXN	12/20/2023	1,000,000	17.17	(17,167,200)
2023121803113	SO	USDMXN	12/27/2023	(190,000)	17.28	3,283,312
2023121803118	SO	USDMXN	12/27/2023	(180,000)	17.29	3,112,360
2023121803414	B	USDMXN	12/27/2023	1,700,000	17.21	(29,248,500)
2023121803716	SO	USDMXN	12/28/2023	(56,011)	17.18	962,341
2023121803827	SO	USDMXN	12/28/2023	(214,221)	17.18	3,681,354
2023121803751	B	USDMXN	01/02/2024	2,000,000	17.20	(34,404,150)
2023121803719	BO	USDMXN	01/10/2024	142,400	17.23	(2,453,293)
2023121803805	BO	USDMXN	01/17/2024	118,100	17.25	(2,037,715)
2023121803803	B	USDMXN	01/19/2024	90,955	17.25	(1,569,042)
2023121803718	B	USDMXN	01/31/2024	1,575,000	17.28	(27,222,201)
2023121803837	BO	USDMXN	02/14/2024	25,600	17.33	(443,619)
2023121803629	BO	USDMXN	02/21/2024	634,000	17.35	(10,996,995)
2023121803836	BO	USDMXN	03/06/2024	25,600	17.39	(445,129)
2023121803833	BO	USDMXN	04/03/2024	12,800	17.47	(223,604)
2023121803626	BO	USDMXN	04/15/2024	564,749	17.50	(9,883,032)
2023121803834	BO	USDMXN	04/17/2024	12,800	17.51	(224,138)
2023121803653	BO	USDMXN	05/15/2024	554,388	17.59	(9,752,353)
2023121803645	BO	USDMXN	06/17/2024	551,512	17.69	(9,755,557)
2023121803646	BO	USDMXN	07/15/2024	575,226	17.77	(10,223,198)
2023121803660	BO	USDMXN	08/15/2024	562,114	17.86	(10,040,816)
2023121803668	BO	USDMXN	09/17/2024	543,969	17.96	(9,768,297)
2023121903445	S	USDMXN	12/20/2023	(10,000,000)	17.06	170,550,000
2023121903434	S	USDMXN	12/21/2023	(379,387)	17.09	6,484,831
2023121903438	S	USDMXN	12/21/2023	(500,000)	17.09	8,545,000
2023121903440	S	USDMXN	12/21/2023	(500,000)	17.09	8,545,200
2023121903801	S	USDMXN	12/21/2023	(1,500,000)	17.07	25,605,000
2023121903834	S	USDMXN	12/21/2023	(7,800,000)	17.07	133,146,000
2023121903845	S	USDMXN	12/21/2023	(53,163)	17.07	907,380
2023121903847	S	USDMXN	12/21/2023	(2,622,980)	17.07	44,769,052
2023121903852	S	USDMXN	12/21/2023	(2,034,409)	17.07	34,722,727
2023121903858	S	USDMXN	12/21/2023	(368,500)	17.07	6,290,302
2023121903929	S	USDMXN	12/21/2023	(1,575,000)	17.07	26,887,014
2023121903932	S	USDMXN	12/21/2023	(300,000)	17.07	5,121,117
2023121903934	S	USDMXN	12/21/2023	(300,000)	17.07	5,121,210
2023121903936	S	USDMXN	12/21/2023	(300,000)	17.07	5,121,210
2023121903938	S	USDMXN	12/21/2023	(300,000)	17.07	5,121,027
2023121903940	S	USDMXN	12/21/2023	(300,000)	17.07	5,120,871
2023121903942	S	USDMXN	12/21/2023	(300,000)	17.07	5,120,532
2023121903446	B	USDMXN	12/21/2023	10,000,000	17.06	(170,581,000)
2023121903524	B	USDMXN	12/21/2023	1,800,000	17.09	(30,754,602)
2023121903594	B	USDMXN	12/21/2023	5,000,000	17.09	(85,429,000)
2023121903595	B	USDMXN	12/21/2023	1,758,774	17.08	(30,047,904)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121903945	B	USDMXN	12/21/2023	14,350	17.07	(244,975)
2023121903357	S	USDMXN	12/26/2023	(2,044,677)	17.09	34,943,467
2023121903359	S	USDMXN	12/26/2023	(2,044,494)	17.09	34,939,995
2023121903361	S	USDMXN	12/26/2023	(2,044,206)	17.09	34,935,415
2023121903363	S	USDMXN	12/26/2023	(2,039,663)	17.10	34,873,233
2023121903365	S	USDMXN	12/26/2023	(2,029,045)	17.10	34,694,216
2023121903367	S	USDMXN	12/26/2023	(2,008,439)	17.10	34,338,076
2023121903369	S	USDMXN	12/26/2023	(1,929,089)	17.10	32,981,253
2023121903371	S	USDMXN	12/26/2023	(1,806,916)	17.10	30,895,070
2023121903373	S	USDMXN	12/26/2023	(1,668,877)	17.10	28,534,530
2023121903377	S	USDMXN	12/26/2023	(1,544,003)	17.10	26,399,324
2023121903381	S	USDMXN	12/26/2023	(1,429,994)	17.10	24,451,168
2023121903383	S	USDMXN	12/26/2023	(1,357,139)	17.10	23,211,238
2023121903387	S	USDMXN	12/26/2023	(1,319,896)	17.10	22,574,051
2023121903389	S	USDMXN	12/26/2023	(1,264,482)	17.10	21,627,164
2023121903391	S	USDMXN	12/26/2023	(1,198,393)	17.10	20,496,187
2023121903393	S	USDMXN	12/26/2023	(1,125,915)	17.10	19,257,392
2023121903395	S	USDMXN	12/26/2023	(1,045,876)	17.10	17,887,023
2023121903397	S	USDMXN	12/26/2023	(970,782)	17.10	16,602,787
2023121903400	S	USDMXN	12/26/2023	(845,719)	17.10	14,463,687
2023121903402	S	USDMXN	12/26/2023	(670,207)	17.10	11,462,311
2023121903404	S	USDMXN	12/26/2023	(469,952)	17.10	8,037,266
2023121903406	S	USDMXN	12/26/2023	(281,152)	17.10	4,808,472
2023121903409	S	USDMXN	12/26/2023	(107,447)	17.10	1,837,643
2023121903599	S	USDMXN	12/26/2023	(1,813,204)	17.09	30,985,113
2023121903601	S	USDMXN	12/26/2023	(1,813,042)	17.09	30,983,321
2023121903604	S	USDMXN	12/26/2023	(1,812,786)	17.09	30,978,879
2023121903606	S	USDMXN	12/26/2023	(1,808,757)	17.09	30,913,919
2023121903609	S	USDMXN	12/26/2023	(1,799,342)	17.09	30,752,528
2023121903611	S	USDMXN	12/26/2023	(1,781,068)	17.09	30,434,960
2023121903613	S	USDMXN	12/26/2023	(1,710,702)	17.09	29,233,236
2023121903615	S	USDMXN	12/26/2023	(1,602,360)	17.09	27,381,743
2023121903617	S	USDMXN	12/26/2023	(1,479,948)	17.09	25,290,363
2023121903619	S	USDMXN	12/26/2023	(1,369,211)	17.09	23,401,215
2023121903621	S	USDMXN	12/26/2023	(1,268,108)	17.09	21,672,671
2023121903623	S	USDMXN	12/26/2023	(1,203,500)	17.09	20,568,479
2023121903625	S	USDMXN	12/26/2023	(1,170,474)	17.09	20,004,051
2023121903629	S	USDMXN	12/26/2023	(1,121,334)	17.09	19,163,979
2023121903633	S	USDMXN	12/26/2023	(1,062,726)	17.09	18,163,651
2023121903635	S	USDMXN	12/26/2023	(998,453)	17.09	17,065,055
2023121903637	S	USDMXN	12/26/2023	(927,475)	17.09	15,850,722
2023121903639	S	USDMXN	12/26/2023	(860,883)	17.09	14,711,008
2023121903641	S	USDMXN	12/26/2023	(749,977)	17.09	12,815,404
2023121903644	S	USDMXN	12/26/2023	(594,334)	17.09	10,156,143
2023121903646	S	USDMXN	12/26/2023	(416,750)	17.09	7,122,188
2023121903648	S	USDMXN	12/26/2023	(249,324)	17.09	4,260,762
2023121903650	S	USDMXN	12/26/2023	(95,284)	17.09	1,628,362
2023121903946	SO	USDMXN	12/26/2023	(23,798)	17.08	406,509
2023121903759	BO	USDMXN	12/26/2023	50,000	17.15	(857,723)
2023121903949	SO	USDMXN	12/27/2023	(3,074)	17.08	52,524
2023121903760	BO	USDMXN	12/27/2023	30,900	17.09	(527,932)
2023121903947	BO	USDMXN	12/28/2023	3,135	17.09	(53,584)
2023121903578	SO	USDMXN	01/03/2024	(347,547)	17.11	5,947,440
2023121903526	SO	USDMXN	01/05/2024	(305,000)	17.12	5,222,080
2023121903527	SO	USDMXN	01/05/2024	(205,000)	17.12	3,509,779
2023121903559	SO	USDMXN	01/05/2024	(221,000)	17.12	3,783,934
2023121903950	SO	USDMXN	01/05/2024	(1,094)	17.11	18,726
2023121903563	BO	USDMXN	01/08/2024	100,000	17.14	(1,714,079)
2023121903564	BO	USDMXN	01/10/2024	100,000	17.15	(1,715,052)
2023121903566	BO	USDMXN	01/12/2024	100,000	17.15	(1,715,189)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121903846	B	USDMXN	01/16/2024	53,163	17.14	(911,449)
2023121903568	BO	USDMXN	01/17/2024	100,000	17.16	(1,716,297)
2023121903439	B	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.17	(8,585,514)
2023121903927	BO	USDMXN	01/19/2024	330,000	17.16	(5,662,859)
2023121903569	BO	USDMXN	01/22/2024	100,000	17.18	(1,717,655)
2023121903570	BO	USDMXN	01/24/2024	100,000	17.18	(1,718,287)
2023121903755	BO	USDMXN	01/24/2024	46,400	17.17	(796,576)
2023121903441	B	USDMXN	01/25/2024	500,000	17.19	(8,595,490)
2023121903756	BO	USDMXN	01/31/2024	46,400	17.19	(797,487)
2023121903930	B	USDMXN	01/31/2024	1,575,000	17.19	(27,074,081)
2023121903933	B	USDMXN	01/31/2024	300,000	17.19	(5,156,747)
2023121903757	BO	USDMXN	02/07/2024	46,400	17.21	(798,426)
2023121903935	B	USDMXN	02/07/2024	300,000	17.21	(5,162,831)
2023121903758	BO	USDMXN	02/14/2024	46,400	17.23	(799,378)
2023121903937	B	USDMXN	02/14/2024	300,000	17.23	(5,168,805)
2023121903358	B	USDMXN	02/15/2024	2,044,677	17.24	(35,240,081)
2023121903600	B	USDMXN	02/15/2024	1,813,204	17.23	(31,249,423)
2023121903848	B	USDMXN	02/16/2024	2,622,980	17.23	(45,200,086)
2023121903939	B	USDMXN	02/21/2024	300,000	17.25	(5,174,578)
2023121903941	B	USDMXN	02/28/2024	300,000	17.27	(5,180,378)
2023121903943	B	USDMXN	03/06/2024	300,000	17.29	(5,185,970)
2023121903853	B	USDMXN	03/14/2024	2,034,409	17.31	(35,212,319)
2023121903360	B	USDMXN	03/15/2024	2,044,494	17.32	(35,402,222)
2023121903602	B	USDMXN	03/15/2024	1,813,042	17.32	(31,395,359)
2023121903362	B	USDMXN	04/16/2024	2,044,206	17.41	(35,589,070)
2023121903605	B	USDMXN	04/16/2024	1,812,786	17.41	(31,562,334)
2023121903364	B	USDMXN	05/15/2024	2,039,663	17.50	(35,700,795)
2023121903607	B	USDMXN	05/15/2024	1,808,757	17.50	(31,651,207)
2023121903859	B	USDMXN	06/12/2024	368,500	17.58	(6,477,179)
2023121903366	B	USDMXN	06/17/2024	2,029,045	17.60	(35,718,921)
2023121903610	B	USDMXN	06/17/2024	1,799,342	17.60	(31,662,008)
2023121903368	B	USDMXN	07/15/2024	2,008,439	17.68	(35,516,954)
2023121903612	B	USDMXN	07/15/2024	1,781,068	17.68	(31,482,097)
2023121903370	B	USDMXN	08/16/2024	1,929,089	17.78	(34,298,462)
2023121903614	B	USDMXN	08/16/2024	1,710,702	17.77	(30,403,380)
2023121903372	B	USDMXN	09/17/2024	1,806,916	17.87	(32,287,883)
2023121903616	B	USDMXN	09/17/2024	1,602,360	17.86	(28,617,390)
2023121903374	B	USDMXN	10/15/2024	1,668,877	17.96	(29,969,527)
2023121903618	B	USDMXN	10/15/2024	1,479,948	17.95	(26,567,292)
2023121903378	B	USDMXN	11/15/2024	1,544,003	18.05	(27,866,244)
2023121903620	B	USDMXN	11/15/2024	1,369,211	18.04	(24,706,011)
2023121903382	B	USDMXN	12/16/2024	1,429,994	18.14	(25,933,935)
2023121903622	B	USDMXN	12/16/2024	1,268,108	18.13	(22,991,602)
2023121903384	B	USDMXN	01/15/2025	1,357,139	18.23	(24,737,035)
2023121903624	B	USDMXN	01/15/2025	1,203,500	18.22	(21,925,190)
2023121903388	B	USDMXN	02/14/2025	1,319,896	18.32	(24,174,958)
2023121903626	B	USDMXN	02/14/2025	1,170,474	18.31	(21,426,882)
2023121903390	B	USDMXN	03/14/2025	1,264,482	18.40	(23,265,460)
2023121903630	B	USDMXN	03/14/2025	1,121,334	18.39	(20,619,487)
2023121903392	B	USDMXN	04/14/2025	1,198,393	18.49	(22,152,740)
2023121903634	B	USDMXN	04/14/2025	1,062,726	18.48	(19,633,989)
2023121903394	B	USDMXN	05/15/2025	1,125,915	18.57	(20,909,752)
2023121903636	B	USDMXN	05/15/2025	998,453	18.56	(18,530,215)
2023121903396	B	USDMXN	06/16/2025	1,045,876	18.66	(19,513,966)
2023121903638	B	USDMXN	06/16/2025	927,475	18.64	(17,292,027)
2023121903398	B	USDMXN	07/15/2025	970,782	18.74	(18,189,027)
2023121903640	B	USDMXN	07/15/2025	860,883	18.72	(16,115,009)
2023121903401	B	USDMXN	08/14/2025	845,719	18.82	(15,913,787)
2023121903642	B	USDMXN	08/14/2025	749,977	18.80	(14,097,781)
2023121903403	B	USDMXN	09/15/2025	670,207	18.90	(12,669,132)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121903645	B	USDMXN	09/15/2025	594,334	18.88	(11,222,472)
2023121903405	B	USDMXN	10/15/2025	469,952	18.99	(8,924,028)
2023121903647	B	USDMXN	10/15/2025	416,750	18.97	(7,905,265)
2023121903407	B	USDMXN	11/14/2025	281,152	19.08	(5,363,712)
2023121903649	B	USDMXN	11/14/2025	249,324	19.05	(4,750,843)
2023121903410	B	USDMXN	12/15/2025	107,447	19.17	(2,059,604)
2023121903651	B	USDMXN	12/15/2025	95,284	19.14	(1,824,184)
2023122003081	S	USDMXN	12/20/2023	(50,000,000)	17.07	853,500,000
2023122003368	B	USDMXN	12/20/2023	50,000,000	17.06	(853,000,000)
2023122003369	S	USDMXN	12/21/2023	(50,000,000)	17.06	853,150,000
2023122003676	S	USDMXN	12/22/2023	(68,541)	17.12	1,173,406
2023122003680	S	USDMXN	12/22/2023	(16,243)	17.12	278,074
2023122003683	S	USDMXN	12/22/2023	(68,541)	17.12	1,173,644
2023122003694	S	USDMXN	12/22/2023	(787,500)	17.13	13,486,583
2023122003754	S	USDMXN	12/22/2023	(500,000)	17.13	8,562,610
2023122003756	S	USDMXN	12/22/2023	(500,000)	17.13	8,562,690
2023122003082	B	USDMXN	12/22/2023	50,000,000	17.08	(853,760,000)
2023122003313	B	USDMXN	12/22/2023	1,000,000	17.07	(17,070,000)
2023122003473	B	USDMXN	12/22/2023	787,500	17.06	(13,438,302)
2023122003690	B	USDMXN	12/22/2023	430,000	17.13	(7,366,128)
2023122003686	BO	USDMXN	12/28/2023	50,000	17.06	(852,911)
2023122003687	BO	USDMXN	12/29/2023	62,900	17.11	(1,076,156)
2023122003691	S	USDMXN	01/08/2024	(430,000)	17.18	7,385,920
2023122003698	SO	USDMXN	01/08/2024	(189,834)	17.18	3,260,478
2023122003755	B	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.20	(8,601,600)
2023122003757	B	USDMXN	01/25/2024	500,000	17.22	(8,611,355)
2023122003695	B	USDMXN	01/31/2024	787,500	17.24	(13,577,002)
2023122003684	B	USDMXN	12/04/2024	68,541	18.14	(1,243,479)
2023122003681	B	USDMXN	01/06/2025	16,243	18.24	(296,218)
2023122003677	B	USDMXN	02/06/2025	68,541	18.34	(1,256,727)
2023122103051	S	USDMXN	12/22/2023	(90,000,000)	17.08	1,537,200,000
2023122103107	S	USDMXN	12/26/2023	(20,000,000)	17.06	341,100,000
2023122103052	B	USDMXN	12/26/2023	90,000,000	17.09	(1,538,226,000)
2023122103627	BO	USDMXN	12/29/2023	50,000	17.07	(853,396)
2023122103733	BO	USDMXN	12/29/2023	50,000	17.04	(852,111)
2023122103626	BO	USDMXN	01/24/2024	37,800	17.13	(647,579)
2023122103625	BO	USDMXN	02/07/2024	92,800	17.17	(1,593,389)
2023122103624	BO	USDMXN	02/14/2024	92,800	17.19	(1,595,206)
2023122103108	B	USDMXN	06/26/2024	20,000,000	17.58	(351,640,000)
2023122203451	S	USDMXN	12/22/2023	(50,000,000)	16.97	848,500,000
2023122203454	B	USDMXN	12/22/2023	50,000,000	16.98	(849,000,000)
2023122203122	S	USDMXN	12/26/2023	(100,000,000)	16.94	1,693,600,000
2023122203455	S	USDMXN	12/27/2023	(50,000,000)	16.99	849,689,000
2023122203480	S	USDMXN	12/27/2023	(50,000,000)	16.97	848,685,000
2023122203486	S	USDMXN	12/27/2023	(50,000,000)	16.97	848,510,000
2023122203549	S	USDMXN	12/27/2023	(20,000,000)	16.98	339,600,000
2023122203563	S	USDMXN	12/27/2023	(600,000)	16.97	10,183,776
2023122203566	S	USDMXN	12/27/2023	(600,000)	16.97	10,184,022
2023122203569	S	USDMXN	12/27/2023	(600,000)	16.97	10,183,878
2023122203571	S	USDMXN	12/27/2023	(600,000)	16.97	10,183,794
2023122203123	B	USDMXN	12/27/2023	100,000,000	16.94	(1,693,885,000)
2023122203452	B	USDMXN	12/27/2023	50,000,000	16.98	(849,150,000)
2023122203559	BO	USDMXN	01/02/2024	50,000	16.99	(849,297)
2023122203560	BO	USDMXN	01/04/2024	50,000	16.97	(848,496)
2023122203561	BO	USDMXN	01/05/2024	50,000	16.97	(848,601)
2023122203616	SO	USDMXN	01/09/2024	(172,418)	17.01	2,932,720
2023122203829	SO	USDMXN	01/12/2024	(320,000)	17.02	5,447,856
2023122203604	BO	USDMXN	01/16/2024	50,000	17.03	(851,310)
2023122203825	BO	USDMXN	01/17/2024	105,200	17.05	(1,793,951)
2023122203603	BO	USDMXN	01/23/2024	50,000	17.05	(852,251)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023122203826	BO	USDMXN	01/24/2024	105,200	17.07	(1,795,917)
2023122203487	B	USDMXN	01/29/2024	50,000,000	17.06	(853,082,625)
2023122203608	BO	USDMXN	01/29/2024	50,000	17.06	(853,053)
2023122203827	BO	USDMXN	01/31/2024	122,200	17.09	(2,088,421)
2023122203609	BO	USDMXN	02/06/2024	50,000	17.08	(854,218)
2023122203828	BO	USDMXN	02/07/2024	210,400	17.11	(3,599,677)
2023122203602	BO	USDMXN	02/13/2024	50,000	17.10	(855,204)
2023122203610	BO	USDMXN	02/20/2024	50,000	17.12	(856,184)
2023122203481	B	USDMXN	03/01/2024	50,000,000	17.16	(857,816,505)
2023122203605	BO	USDMXN	03/05/2024	50,000	17.16	(858,156)
2023122203611	BO	USDMXN	03/12/2024	50,000	17.18	(859,147)
2023122203612	BO	USDMXN	03/19/2024	50,000	17.20	(860,139)
2023122203606	BO	USDMXN	03/26/2024	50,000	17.22	(861,131)
2023122203614	BO	USDMXN	03/27/2024	100,000	17.23	(1,723,292)
2023122203613	BO	USDMXN	04/11/2024	50,000	17.27	(863,495)
2023122203607	BO	USDMXN	05/09/2024	50,000	17.35	(867,667)
2023122203572	B	USDMXN	09/25/2024	600,000	17.78	(10,666,112)
2023122203550	B	USDMXN	09/27/2024	20,000,000	17.78	(355,640,000)
2023122203570	B	USDMXN	10/23/2024	600,000	17.86	(10,715,155)
2023122203567	B	USDMXN	11/27/2024	600,000	17.96	(10,776,568)
2023122203564	B	USDMXN	12/11/2024	600,000	18.00	(10,800,400)
2023122703055	S	USDMXN	12/27/2023	(50,000,000)	16.95	847,500,000
2023122703119	S	USDMXN	12/27/2023	(1,700,000)	16.94	28,798,000
2023122703120	B	USDMXN	12/28/2023	1,700,000	16.94	(28,802,250)
2023122703376	SON	USDMXN	01/02/2024	(70,880,095)	16.93	1,200,000,000
2023122703056	B	USDMXN	01/02/2024	50,000,000	16.97	(848,250,000)
2023122703034	BO	USDMXN	01/04/2024	500,000	16.97	(8,485,312)
2023122703542	SO	USDMXN	01/16/2024	(72,000)	16.97	1,221,827
2023122703558	SO	USDMXN	01/16/2024	(427,000)	16.96	7,243,549
2023122703377	BON	USDMXN	03/27/2024	69,893,413	17.17	(1,200,000,000)
2023122803003	B	USDMXN	12/28/2023	40,000,000	16.92	(676,600,000)
2023122803004	S	USDMXN	12/29/2023	(40,000,000)	16.92	676,708,000
2023122803692	BO	USDMXN	12/29/2023	10,000,000	16.94	(169,382,950)
2023122803419	SO	USDMXN	01/02/2024	0	16.86	4,642,646
2023122803418	BON	USDMXN	01/02/2024	70,880,095	16.93	(1,200,000,000)
2023122803723	SO	USDMXN	01/16/2024	(283,000)	16.99	4,806,905
2023122903390	S	USDMXN	12/29/2023	(1,700,000)	16.93	28,781,000
2023122903178	BO	USDMXN	01/02/2024	5,000,000	16.90	(84,502,438)
2023122903391	B	USDMXN	01/02/2024	1,700,000	16.94	(28,796,300)
2023122903159	BO	USDMXN	03/04/2024	500,000	17.07	(8,536,891)

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2094712	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,052,712
2094713	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,052,712
2094714	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,052,712
2094715	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,052,712
2099396	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099397	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099398	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099399	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099400	FX	13/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099401	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099426	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099427	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099428	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099429	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099430	FX	13/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099431	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099464	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099465	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099466	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099467	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099468	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099469	FX	13/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099470	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099471	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099504	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099505	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099506	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099507	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099508	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099509	FX	13/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099510	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099511	FX	13/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099604	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099605	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2099606	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099607	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099628	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099629	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2099630	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099631	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2100156	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100157	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100158	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100159	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100160	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100161	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100186	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100187	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100188	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100189	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100190	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100191	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100371	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	189,311
2100372	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	189,311
2100375	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	189,311
2100376	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	189,311
2100651	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100652	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100653	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100654	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2100655	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2100656	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100657	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100658	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2100671	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100672	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100673	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100674	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2100775	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100776	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100777	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100778	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2100799	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100800	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100801	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100802	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2100803	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100804	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100805	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100806	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2100807	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100808	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100809	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100810	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2100811	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100812	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100813	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100814	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2100823	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100824	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100825	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100826	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2100847	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100848	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100849	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100850	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2100851	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100852	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100853	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100854	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2100855	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100856	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100857	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100858	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2100859	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100860	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100861	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100862	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2101265	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101266	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101267	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101268	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101269	FX	27/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101270	FX	27/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101271	FX	27/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101272	FX	27/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101309	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101310	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101311	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101312	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101313	FX	27/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101314	FX	27/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2101315	FX	27/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101316	FX	27/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101433	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101434	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101435	FX	20/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101436	FX	20/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101437	FX	03/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101438	FX	03/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101439	FX	16/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101440	FX	16/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101441	FX	01 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101442	FX	01 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101443	FX	15 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101444	FX	15 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101449	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101450	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101451	FX	20/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101452	FX	20/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101453	FX	03/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101454	FX	03/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101455	FX	16/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101456	FX	16/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101457	FX	01 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101458	FX	01 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101459	FX	15 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101460	FX	15 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2102073	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102074	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102075	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102076	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2102089	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102090	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102091	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102092	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2102093	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102094	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102095	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102096	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2102097	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102098	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102099	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102100	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2102622	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102623	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102624	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102625	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102626	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102627	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102628	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102629	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102630	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102631	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102632	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102633	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102634	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102635	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102636	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102637	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102638	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102639	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102640	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2102641	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102642	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102643	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102644	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102645	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102646	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102647	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102648	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102649	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102650	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102651	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102652	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102653	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102654	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102655	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102656	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102657	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102658	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102659	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102660	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102712	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102713	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102714	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102715	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102716	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102717	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102718	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102719	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102720	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102721	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102722	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102723	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102724	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102725	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102726	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102727	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102728	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102729	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102730	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102731	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102732	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102733	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102734	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102735	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102736	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102737	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102738	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102739	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102740	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102741	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102742	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102743	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102744	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102745	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102746	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102747	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102748	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102749	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102750	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103469	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103470	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2103471	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103472	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103473	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103474	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103475	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103476	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103477	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103478	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103479	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103480	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103481	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103482	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103483	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103484	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103485	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103486	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103487	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103488	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103489	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103490	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103491	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103492	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103493	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103494	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103495	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103496	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103497	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103498	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103499	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103500	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103501	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103502	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103503	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103504	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103505	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103506	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103507	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103613	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103614	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103615	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103616	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103617	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103618	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103619	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103620	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103621	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103622	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103623	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103624	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103625	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103626	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103627	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103628	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103629	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103630	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103631	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103632	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103633	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103634	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103635	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103636	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2103637	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103638	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103639	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103640	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103641	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103642	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103643	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103644	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103645	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103646	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103647	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103648	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103649	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103650	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103651	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2104025	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104026	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104027	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104028	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104029	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104030	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104031	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104032	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104033	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104034	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104035	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104036	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104073	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104074	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104075	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104076	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104077	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104078	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104079	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104080	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104081	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104082	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104083	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104084	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104276	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104277	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104278	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104279	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104280	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104281	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104282	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104283	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104284	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104285	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104286	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104287	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104288	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104289	FX	18 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104290	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104306	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104307	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104308	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104309	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104310	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104311	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104312	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2104313	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104314	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104315	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104316	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104317	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104318	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104319	FX	18 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104320	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104752	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104753	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104754	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104755	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,947
2104756	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104757	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104758	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104759	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,947
2104788	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104789	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104790	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104791	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,947
2104792	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104793	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104794	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104795	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,947
2104972	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104973	FX	06/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104974	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104975	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104976	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104977	FX	16/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104978	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104979	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104980	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104981	FX	23/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104982	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104983	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104984	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104985	FX	30/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104986	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104987	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104988	FX	06/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104989	FX	06/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104990	FX	06/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104991	FX	06/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104992	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104993	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104994	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104995	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104996	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104997	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104998	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104999	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105000	FX	27/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105001	FX	27/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105002	FX	27/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105003	FX	27/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105004	FX	04 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105005	FX	04 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105006	FX	04 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105007	FX	04 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105008	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105009	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105010	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105011	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105012	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105013	FX	18 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105014	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105015	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105016	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105017	FX	22 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105018	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105019	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105148	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105149	FX	06/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105150	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105151	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105152	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105153	FX	16/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105154	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105155	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105156	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105157	FX	23/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105158	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105159	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105160	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105161	FX	30/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105162	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105163	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105164	FX	06/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105165	FX	06/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105166	FX	06/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105167	FX	06/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105168	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105169	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105170	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105171	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105172	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105173	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105174	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105175	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105176	FX	27/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105177	FX	27/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105178	FX	27/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105179	FX	27/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105180	FX	04 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105181	FX	04 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105182	FX	04 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105183	FX	04 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105184	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105185	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105186	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105187	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105188	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105189	FX	18 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105190	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105191	FX	18 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105192	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105193	FX	22 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105194	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105195	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105262	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105263	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105264	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105265	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105266	FX	10/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105267	FX	10/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105268	FX	10/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105269	FX	10/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105270	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105271	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105272	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105273	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105298	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105299	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105300	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105301	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105302	FX	10/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105303	FX	10/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105304	FX	10/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105305	FX	10/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105306	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105307	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105308	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105309	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105650	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105651	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105652	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105653	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105654	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105655	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105656	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105657	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105658	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105659	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105660	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105661	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105689	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105690	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105691	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105692	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105693	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105694	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105695	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105696	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105697	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105698	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105699	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105700	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105918	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105919	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105920	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105921	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105922	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105923	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105924	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105925	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105926	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105927	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105928	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105929	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105930	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105931	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105932	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105933	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105934	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105935	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105936	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105937	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105938	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105939	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105940	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105941	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105942	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105943	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105944	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105945	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105946	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105947	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105948	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105949	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105950	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105951	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105952	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105953	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105954	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105955	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105956	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106218	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106219	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106220	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106221	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106222	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106223	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106224	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106225	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106226	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106227	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106228	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106229	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106230	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106231	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106232	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106233	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106234	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106235	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106236	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106237	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106238	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106239	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106240	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106241	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106242	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106243	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106244	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106245	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106246	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106247	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106248	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106249	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106250	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106251	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106252	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106253	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106254	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2106255	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106256	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106390	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106391	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106392	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106393	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,628
2106394	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106395	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106396	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106397	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,628
2106398	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2106399	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106400	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2106401	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2106402	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106403	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2106459	FX	26/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,800,000
2106460	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,100,000
2106462	FX	26/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,800,000
2106463	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,100,000
2106602	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106603	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106604	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106605	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106606	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106607	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106608	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106609	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106610	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106611	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106612	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106613	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106638	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106639	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106640	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106641	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106642	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106643	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106644	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106645	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106646	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106647	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106648	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106649	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106658	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,695,332
2106659	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,695,332
2106660	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,695,332
2106661	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,695,332
2106788	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106789	FX	12/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106790	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106791	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2106792	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106793	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106794	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106795	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2106812	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106813	FX	12/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106814	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106815	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2106816	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2106817	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106818	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106819	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2107097	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107098	FX	06/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107099	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107100	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107101	FX	16/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107102	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107103	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107104	FX	23/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107105	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107106	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107107	FX	30/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107108	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107124	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107125	FX	06/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107126	FX	06/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107127	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107128	FX	16/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107129	FX	16/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107130	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107131	FX	23/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107132	FX	23/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107133	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107134	FX	30/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107135	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107196	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107197	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107198	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107199	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107200	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107201	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107202	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107203	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107204	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107223	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107224	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107225	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107226	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107227	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107228	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107229	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107230	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107231	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107332	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107333	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107334	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107335	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107336	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107337	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107338	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107339	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107356	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107357	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107358	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107359	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107360	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107361	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107362	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107363	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107380	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107381	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107398	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107399	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107412	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107413	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107424	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107425	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107706	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107707	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107708	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107709	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,405
2107710	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107711	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107712	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107713	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,730
2107730	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107731	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107732	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107733	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,405
2107734	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107735	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107736	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107737	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,730
2107747	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107748	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107749	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107750	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107751	FX	29/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107752	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107762	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107763	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107764	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107765	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107766	FX	29/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107767	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107796	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,500,000
2107797	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,500,000
2107798	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,500,000
2107799	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,500,000
2107800	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,500,000
2107801	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,500,000
2107970	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107971	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107972	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107973	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107974	FX	19/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107975	FX	19/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107976	FX	26/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107977	FX	26/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107988	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107989	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107990	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107991	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107992	FX	19/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107993	FX	19/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107994	FX	26/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107995	FX	26/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107996	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2107997	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2107998	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107999	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108000	FX	05/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108001	FX	05/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108050	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108051	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108052	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108053	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108054	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108055	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108056	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108057	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108058	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108059	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108060	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108061	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108062	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108063	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108064	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108065	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108066	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108067	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108068	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108069	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108070	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108071	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108072	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108073	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108074	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108075	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108076	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108077	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108078	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108079	FX	29/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108080	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108081	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108082	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108083	FX	06 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108084	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108085	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108086	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108087	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108088	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108089	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108090	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108091	FX	20 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108092	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108093	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108094	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108095	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108096	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108097	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108130	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108131	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108132	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108133	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108134	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108135	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108136	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108137	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108138	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108139	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108140	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108141	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108142	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108143	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108144	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108145	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108146	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108147	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108148	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108149	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108150	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108151	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108152	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108153	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108154	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108155	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108156	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108157	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108158	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108159	FX	29/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108160	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108161	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108162	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108163	FX	06 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108164	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108165	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108166	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108167	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108168	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108169	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108170	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108171	FX	20 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108172	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108173	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108174	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108175	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108176	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108177	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108218	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2108219	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2108220	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2108221	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2108222	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108223	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108224	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108225	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2108226	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2108227	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2108228	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2108229	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2108230	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108231	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108232	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108233	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2108234	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108235	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108236	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108237	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2108238	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2108239	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2108240	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108241	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2108242	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108243	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108244	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108245	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2108250	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108251	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108256	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108257	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108262	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108263	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108268	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108269	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108314	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108315	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108316	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108317	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108318	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108319	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108320	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108321	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108322	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108323	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108324	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108325	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108326	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108327	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108328	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108329	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108374	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108375	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108376	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108377	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108378	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108379	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108380	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108381	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108382	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108383	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108384	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108385	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108386	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108387	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108388	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108389	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108430	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108431	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108432	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108433	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,448
2108434	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108435	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108436	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108437	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,448
2108438	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108439	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108440	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108441	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,448
2108442	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108443	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108444	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108445	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,448

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108486	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108487	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108488	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108489	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,448
2108490	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108491	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108492	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108493	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,448
2108494	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108495	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108496	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108497	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,448
2108498	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108499	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108500	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108501	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,448
2108600	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108601	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2108602	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108603	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108604	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2108605	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108606	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108607	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108630	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108631	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108654	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108655	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108656	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108657	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108658	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108659	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108660	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108661	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108662	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108663	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108664	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108665	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108666	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108667	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108668	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108669	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108670	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108671	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108672	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108673	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108674	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108675	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108676	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108677	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108684	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108685	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108686	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108687	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108688	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108689	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108690	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108691	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108692	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108693	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108694	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108695	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108696	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108697	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108698	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108699	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108700	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108701	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108708	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108709	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2108710	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108711	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108712	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2108713	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108779	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108780	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2108781	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108782	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2108783	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108784	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2108785	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108786	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2108791	FX	08 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108792	FX	08 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	450,000
2108793	FX	08 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108794	FX	08 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,891
2108799	FX	08 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108800	FX	08 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	450,000
2108801	FX	08 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108802	FX	08 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,891
2108804	FX	08 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108806	FX	08 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108879	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108880	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108881	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108882	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108883	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108884	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108885	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108886	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108887	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108888	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108889	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108890	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108891	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108892	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108893	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108894	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108909	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108910	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108911	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108912	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108913	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108914	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108915	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108916	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108917	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108918	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108919	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108920	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108921	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108922	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108923	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108924	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108933	FX	12/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108934	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108935	FX	30/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108936	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108937	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108938	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108939	FX	29/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108940	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108941	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108942	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108943	FX	28 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108944	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108981	FX	12/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108982	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108983	FX	30/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108984	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108985	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108986	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108987	FX	29/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108988	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108989	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108990	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108991	FX	28 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108992	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109022	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109023	FX	12/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109024	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109025	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109026	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109027	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109028	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109029	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109030	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109031	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109032	FX	12/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109033	FX	12/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109034	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109035	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109036	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109037	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109038	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109039	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109086	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109087	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109088	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2109089	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109090	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109091	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109096	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109097	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109098	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2109099	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109100	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109101	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109102	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109103	FX	28 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109104	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109120	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109121	FX	28 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109122	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109224	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109225	FX	07 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109226	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109227	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109228	FX	07 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109229	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2109256	FX	01/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109257	FX	01/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109258	FX	09/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109259	FX	09/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109260	FX	16/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109261	FX	16/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109262	FX	22/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109263	FX	22/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109264	FX	30/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109265	FX	30/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109266	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109267	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109268	FX	14 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109269	FX	14 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109270	FX	21 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109271	FX	21 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109272	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109273	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109378	FX	01/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109379	FX	01/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109380	FX	09/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109381	FX	09/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109382	FX	16/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109383	FX	16/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109384	FX	22/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109385	FX	22/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109386	FX	30/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109387	FX	30/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109388	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109389	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109390	FX	14 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109391	FX	14 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109392	FX	21 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109393	FX	21 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109394	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109395	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109404	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109405	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109406	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109407	FX	22 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109408	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109409	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109410	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109411	FX	22 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109412	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109413	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109414	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109415	FX	22 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109416	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109417	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109418	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109419	FX	22 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109420	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109421	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109422	FX	22 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109423	FX	22 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109524	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109525	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109526	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109527	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109528	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109529	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109530	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109531	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109532	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109533	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109534	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109535	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109536	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109537	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109538	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109539	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109540	FX	29/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109541	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109542	FX	06 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109543	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109544	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109545	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109546	FX	20 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109547	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109554	FX	04/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109555	FX	04/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109556	FX	11/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109557	FX	11/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109558	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109559	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109560	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109561	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109562	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109563	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109564	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109565	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109566	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109567	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109568	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109569	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109570	FX	29/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109571	FX	29/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109572	FX	06 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109573	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109574	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109575	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109576	FX	20 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109577	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109582	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109583	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109584	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109585	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109586	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109587	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109588	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109589	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109590	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109591	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109592	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109593	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,079
2109606	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109607	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109608	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109609	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109610	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109611	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109612	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109613	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109614	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109615	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109616	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109617	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,079
2109629	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109630	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109631	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109632	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109633	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109634	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109635	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109636	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109637	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109647	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109648	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109649	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109650	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109651	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109652	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109653	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109654	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109655	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109664	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109665	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109666	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109667	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109668	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109669	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109676	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109677	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109678	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109679	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109680	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109681	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109690	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109691	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109692	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109693	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,907
2109694	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109695	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109696	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109697	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,907
2109698	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109699	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109700	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109701	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,907
2109714	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109715	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109716	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109717	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,907
2109718	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109719	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109720	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109721	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,907
2109722	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109723	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109724	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109725	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,907
2109737	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109738	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109739	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109740	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109741	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109742	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109743	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109744	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109745	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109746	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109747	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109748	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109749	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109750	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109751	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109752	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109753	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109754	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109755	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109756	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109757	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109758	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109759	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109760	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109761	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109762	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109763	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109764	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109765	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109766	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109767	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109768	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109769	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109773	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109774	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109775	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109776	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109777	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109778	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109779	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109780	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109781	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109782	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109783	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109784	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109785	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109786	FX	31/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109787	FX	31/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109788	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109789	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109790	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109791	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109792	FX	14/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109793	FX	14/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109794	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109795	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109796	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109797	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109798	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109799	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109800	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109801	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109802	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109803	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109804	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109805	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109822	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109823	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109824	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109825	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,167
2109826	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109827	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109828	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109829	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	14,167
2109830	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109831	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109832	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109833	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,472
2109834	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109835	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109836	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109837	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,472
2109838	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109839	FX	30/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109840	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109841	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,056
2109842	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109843	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109844	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109845	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,639
2109846	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109847	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109848	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109849	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,639
2109850	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109851	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109852	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109853	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,083
2109854	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109855	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109856	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109857	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,083
2109858	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109859	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109860	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109861	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,667
2109862	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109863	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109864	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109865	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,667
2109866	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109867	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109868	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109869	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,250
2109902	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109903	FX	03/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109904	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109905	FX	03/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,167
2109906	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109907	FX	10/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109908	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109909	FX	10/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	14,167
2109910	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109911	FX	17/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109912	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109913	FX	17/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,472
2109914	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109915	FX	24/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109916	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109917	FX	24/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,472
2109918	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109919	FX	30/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109920	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109921	FX	30/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,056
2109922	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109923	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109924	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109925	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,639
2109926	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109927	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109928	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109929	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,639
2109930	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109931	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109932	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109933	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,083
2109934	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109935	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109936	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109937	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,083
2109938	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109939	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109940	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109941	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,667
2109942	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109943	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109944	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109945	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,667
2109946	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109947	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109948	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109949	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,250
2111049	FX	18 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,000,000
2111050	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111051	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111052	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111053	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,921
2111058	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111059	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111060	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111061	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,921
2111066	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111067	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111068	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111069	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111070	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111071	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111072	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111073	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111074	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,100,000
2111075	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,100,000
2111076	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,100,000
2111077	FX	06 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,100,000
2111106	FX	18/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111107	FX	18/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111108	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111109	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111110	FX	25/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111111	FX	25/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2111112	FX	08/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111113	FX	08/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111114	FX	15/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,100,000
2111115	FX	15/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,100,000
2111116	FX	06 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,100,000
2111117	FX	06 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,100,000
2111118	FX	18/10/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2111119	FX	18/10/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2111120	FX	18/10/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2111121	FX	18/10/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2111122	FX	10/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000,000
2111123	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111124	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111125	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111126	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,065
2111127	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111128	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111129	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111130	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,118
2111131	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111132	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111133	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111134	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,160
2111147	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111148	FX	27/10/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111149	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111150	FX	27/10/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,065
2111151	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111152	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111153	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111154	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,118
2111155	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111156	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111157	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111158	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,160
2111186	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111187	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111188	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111189	FX	20 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2111190	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111191	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111192	FX	20 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111193	FX	20 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2111212	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111213	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111214	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111215	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111216	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111217	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111230	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111231	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111232	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111233	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,581
2111234	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111235	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111236	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111237	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,581
2111238	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111239	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111240	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111241	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,581
2111242	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111243	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111244	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111245	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,258
2111246	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111247	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111248	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111249	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,258
2111250	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111251	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111252	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111253	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,258
2111254	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111255	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111256	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111257	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,097
2111290	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111291	FX	07/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111292	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111293	FX	07/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,581
2111294	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111295	FX	17/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111296	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111297	FX	17/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,581
2111298	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111299	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111300	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111301	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,581
2111302	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111303	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111304	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111305	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,258
2111306	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111307	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111308	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111309	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,258
2111310	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111311	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111312	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111313	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,258
2111314	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111315	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111316	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111317	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,097
2111350	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111351	FX	13/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111352	FX	13/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111353	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111354	FX	13 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111355	FX	13 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111368	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111369	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111370	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111371	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111372	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111373	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111374	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111375	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111388	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111389	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111390	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111391	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111392	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111393	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111394	FX	26 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111395	FX	26 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111744	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111745	FX	07 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2111746	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111753	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111754	FX	07 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2111755	FX	07 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111812	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111813	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111814	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111815	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111816	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111817	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111818	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111819	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111820	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111821	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111822	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111823	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111824	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111825	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111826	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111827	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111828	FX	21/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111829	FX	21/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111830	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111831	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111832	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111833	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111834	FX	05 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111835	FX	05 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111836	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111837	FX	11 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111838	FX	11 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111839	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111840	FX	19 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111841	FX	19 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112006	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112007	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112008	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112009	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,665
2112010	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112011	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112012	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112013	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,665

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2112038	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112039	FX	28/11/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112040	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112041	FX	28/11/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,665
2112042	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112043	FX	27 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112044	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112045	FX	27 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,665
2112161	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112162	FX	28 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112163	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112215	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112216	FX	28 dic 2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112217	FX	28 dic 2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000

## Liquidados anticipadamente

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
MQY368	16/03/2028	Unwound		mxn		3,850,000,000	
P18653	21/06/2024	Unwound		usd			75,150,000
P18654	21/06/2024	Unwound		usd			75,150,000
SDT190	31/03/2024	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV289	31/10/2023	Unwound	12,105,322	usd	12,105,322	12,105,322	
SFF602	16/03/2028	Unwound	3,850,000,000	mxn	3,850,000,000	3,850,000,000	
SFF606	16/03/2028	Unwound	3,850,000,000	mxn	3,850,000,000	3,850,000,000	
SGX904	04/07/2024	Unwound	8,000,000	mxn	8,000,000	8,000,000	
SGX910	04/07/2024	Unwound	8,000,000	mxn	8,000,000	8,000,000	
SHL327	28/01/2026	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHX098	12/10/2028	Unwound	14,037,000	usd	14,037,000	14,037,000	
SHX100	12/10/2028	Unwound	14,037,000	usd	14,037,000	14,037,000	
SJE301	27/09/2029	Unwound	26,691,186	usd	26,691,186	26,691,186	
SJE336	27/09/2029	Unwound	26,691,186	usd	26,691,186	26,691,186	
SJF153	27/09/2029	Unwound	8,517,242	usd	8,517,242	8,517,242	
SJF154	27/09/2029	Unwound	8,517,242	usd	8,517,242	8,517,242	
SKG023	03/12/2027	Unwound	138,460,979	mxn	138,460,979	138,460,979	

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

Producto	Fecha de evento	Contraparte /Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
P19171	02/10/2023	Cliente 1	USD	65,136	No envió los fondos
COLATERAL	03/10/2023	Cliente 2	USD	1,460,000	No envió los fondos
2023101203135	16/10/2023	Cliente 3	MXN	99,226	Cobro parcial
SJS583	18/10/2023	Cliente 4	USD	2,670	Discrepancia en liquidación
SX6539	30/10/2023	Cliente 5	MXN	(1,282,047)	Se retiene hasta instrucción de SAM
SAK055	30/10/2023	Cliente 6	MXN	(862,564)	Se retiene hasta instrucción de SAM
2023110303798	10/11/2023	Cliente 7	USD	1,100,000	Problemática Sistema reconocimiento
P18015	17/11/2023	Cliente 8	MXN	24,656	No envió los fondos
COLATERAL	24/11/2023	Cliente 9	USD	1,520,000	No envió los fondos
SAK055	28/11/2023	Cliente 10	MXN	(776,784)	Se retiene hasta instrucción de SAM
SX6539	29/11/2023	Cliente 11	MXN	(1,234,177)	Se retiene hasta instrucción de SAM
2102743	14/12/2023	Cliente 12	MXN	672,000	Pago el 15-12-23 672000
2111354	15/12/2023	Cliente 13	MXN	109,575	Pago el 18-12-23 109,575.00
E87956	18/12/2023	Cliente 14	MXN	337,150	Pago el 21-12-23 337,150
SHH606	18/12/2023	Cliente 15	USD	104,897	Pago el 19-12-23 104,896.56
P18015	18/12/2023	Cliente 16	MXN	24,557	Pago el 19-12-23 24,556.67
SIM805	27/12/2023	Cliente 17	USD	119	Discrepancia en liquidación
2023111703754	28/12/2023	Cliente 18	MXN	5,222,700	Pago el 29-12-23 104,896.56
SAK055	28/12/2023	Cliente 19	MXN	(796,942)	Se retiene hasta instrucción de SAM
SX6539	28/12/2023	Cliente 20	MXN	(1,223,883)	Se retiene hasta instrucción de SAM

## Resumen de Instrumentos Financieros Derivados

Cifras expresadas en pesos

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	3,672,153,910	Compra	Divisas	Divisas	90,406,610,941	131,033,968,027	3,632,521,141	39,632,769	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	4,079,567,996	Venta	Divisas	Divisas	(90,378,763,025)	(130,410,972,261)	4,032,791,359	46,776,637	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,191,460,000	Compra	Acción	Acción	85,612,687	115,625,789	85,640,000	1,105,820,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,191,460,000	Venta	Acción	Acción	(77,981,568)	(104,578,497)	85,640,000	1,105,820,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	7,282,261,749	Compra	Divisas	Divisas	284,440,961	245,964,263	5,683,981,743	1,598,280,006	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	7,282,261,749	Venta	Divisas	Divisas	(216,998,351)	(194,342,987)	5,683,981,743	1,598,280,006	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,745,356,700	Compra	Índice	Índice	42,677,352	232,523,040	14,626,700	3,730,730,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	881,293,400	Venta	Índice	Índice	(11,975,187)	(72,580,681)	29,253,400	852,040,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	41,873,586,553	Compra	Tasas	Tasas	1,094,168,776	786,044,293	1,663,734,655	36,036,243,881	4,173,608,016	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	41,291,258,817	Venta	Tasas	Tasas	(1,065,488,019)	(766,457,540)	1,663,734,655	35,598,034,026	4,029,490,136	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	87,280,000	Compra	Acción NE	Acción NE	5,769,284	6,726,285	-	87,280,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	87,280,000	Venta	Acción NE	Acción NE	(13,400,403)	(17,773,577)	-	87,280,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	202,913,400	Compra	Índice NE	Índice NE	-	56,125,431	29,253,400	173,660,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,049,001,700	Venta	Índice NE	Índice NE	(30,699,225)	(216,061,931)	14,626,700	3,034,375,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	974,054,939	Compra	Divisas NE	Divisas NE	44,871,616	28,926,760	-	974,054,939	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	974,054,939	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(110,772,242)	(80,851,711)	-	974,054,939	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	7,586,482,856	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	578,049,154	482,606,920	-	5,349,653,614	2,236,829,242	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	3,939,337,482	CCIRS / IRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	43,606,947	233,896,278	-	2,891,781,066	1,047,556,416	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	67,198,823,809	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	3,126,894,911	1,072,471,611	-	45,610,997,184	21,587,826,625	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	3,524,840,000	CCIRS	Reuters_SOFR / LIBOR USD	TASA DE INTERES / LIBOR USD	677,204,251	350,985,295	3,524,840,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	63,936,063	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	142,677,142	87,245,917	-	63,936,063	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	71,561,423,358	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	2,988,939,774	861,065,744	1,732,392,856	34,888,752,567	34,940,277,936	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	394,526,575,112	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	12,748,228,351	5,612,226,342	87,340,354,122	197,968,402,426	109,217,818,564	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	74,834,978,046	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	(2,570,312,693)	(40,773,666)	1,749,936,308	36,091,719,868	36,993,321,871	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	403,817,397,345	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	(13,365,565,664)	(6,586,074,542)	69,205,043,715	213,722,898,303	120,889,455,326	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
100000000000			<b>A C T I V O</b>	836,320,156,190	750,079,867,041
100200001001			<b>Efectivo y equivalentes de efectivo</b>	47,661,140,882	63,880,972,463
100400001001			<b>Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)</b>	1,382,566,946	2,207,893,382
100600001001			<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>	185,048,414,219	127,270,704,159
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	78,120,641,207	58,582,072,631
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	102,024,149,093	63,972,167,551
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	4,903,623,919	4,716,463,977
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	4,904,147,964	4,716,997,382
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-524,045	-533,405
101000001001			<b>Deudores por reporte</b>	8,008,648,532	3,224,493,008
101200001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	0	0
101400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	42,742,309,252	36,251,898,604
	101400102001		Con fines de negociación	31,588,957,978	30,643,914,183
	101400102002		Con fines de cobertura	11,153,351,274	5,607,984,421
101600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS</b>	-649,897,523	-1,379,612,713
	101800104001		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1</b>	491,708,488,282	473,436,304,471
	101800105001		Créditos comerciales	245,529,126,316	254,285,978,278
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	200,539,258,688	221,131,990,145
		101800107002	Entidades financieras	23,989,089,321	17,425,787,043
		101800107003	Entidades gubernamentales	21,000,778,307	15,728,201,090
	101800105002		Créditos de consumo	36,351,630,699	32,612,124,689
	101800105003		Créditos a la vivienda	209,827,731,267	186,538,201,504
		101800507023	Media y residencial	204,923,622,457	181,032,783,419
		101800507024	De interés social	4,125,266	4,610,492
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	4,899,983,544	5,500,807,593
		101800507026	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800507027	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800105004		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
	101800104002		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2</b>	4,810,715,846	3,339,504,934
	101800205005		Créditos comerciales	234,980,227	160,367,568
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	234,980,227	160,367,568
		101800506008	Entidades financieras	0	0
		101800506009	Entidades gubernamentales	0	0
	101800205006		Créditos de consumo	923,085,664	646,972,424
	101800205007		Créditos a la vivienda	3,652,649,955	2,532,164,942
		101800706018	Media y residencial	3,520,967,412	2,415,942,278
		101800706019	De interés social	0	245,693
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	131,682,543	115,976,971
		101800706021	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800706022	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104003		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3</b>	17,060,800,207	18,540,701,562
	101800305008		Créditos comerciales	6,415,318,250	9,651,456,853
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	6,358,951,790	9,559,977,328
		101800806024	Entidades financieras	56,366,460	91,479,525
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	0
	101800305009		Créditos de consumo	937,104,076	832,239,681
	101800305010		Créditos a la vivienda	9,708,377,881	8,057,005,028
		101801006034	Media y residencial	9,274,766,177	7,763,733,254
		101801006035	De interés social	9,172,857	10,406,505
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	424,438,847	282,865,269
		101801006037	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801006038	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104004		<b>Cartera de crédito valuada a valor razonable</b>	0	0
	101800405011		Créditos comerciales	0	0
		101801106039	Actividad empresarial o comercial	0	0
		101801106040	Entidades financieras	0	0
		101801106041	Entidades gubernamentales	0	0
	101800405012		Créditos de consumo	0	0
	101800405013		Créditos a la vivienda	0	0
		101801306050	Media y residencial	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
		101801306051	De interés social	0	0
		101801306052	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	0	0
		101801306053	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801306054	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	131800103001		Cartera de crédito	513,580,004,335	495,316,510,967
	131800103002		Partidas diferidas	3,093,177,922	2,745,947,710
	101800103003		<b>ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS</b>	-13,209,211,483	-16,804,764,446
	131800102001		<b>Cartera de crédito (neto)</b>	503,463,970,774	481,257,694,231
	131800102002		<b>Derechos de cobro adquiridos (neto)</b>	0	0
131800001001			<b>Total de cartera de crédito (neto)</b>	503,463,970,774	481,257,694,231
102000001001			<b>Activos virtuales</b>	0	0
102200001001			<b>BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
132400001001			<b>Otras cuentas por cobrar (neto)</b>	26,794,472,946	15,353,581,685
132600001001			<b>Bienes adjudicados (neto)</b>	585,227,163	291,993,633
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	13,941,494	13,941,494
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	2,567,903,784	3,116,077,724
133400001001			<b>Propiedades, mobiliario y equipo (neto)</b>	5,289,110,115	4,773,303,604
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,390,703,408	2,684,307,039
103800001001			<b>INVERSIONES PERMANENTES</b>	267,195,901	52,955,983
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	6,144,258,727	6,491,779,686
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,610,189,570	4,587,883,059
134400001001			Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	0	0
104600001001			Crédito mercantil	0	0
200000000000			<b>P A S I V O</b>	757,633,303,594	674,799,834,814
200200001001			<b>CAPTACIÓN TRADICIONAL</b>	541,557,007,095	485,465,653,800
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	276,128,773,850	231,774,831,329
	200200102002		Depósitos a plazo	253,190,157,504	240,867,260,225
		200200203003	Del público en general	208,686,839,264	209,629,358,526
		200200203004	Mercado de dinero	44,503,318,240	31,237,901,699
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	10,940,968,714	11,844,856,020
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	1,297,107,027	978,706,226
200400001001			<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>	36,804,306,619	49,517,945,530
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	30,302,604,414	29,868,880,151
	200400102003		De largo plazo	6,501,702,205	19,649,065,379
230600001001			<b>VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR</b>	11,501,196,691	5,236,891,311
200800001001			<b>ACREEDORES POR REPORTO</b>	68,320,662,323	55,760,905,600
201000001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	57,595	60,896
201200001001			<b>COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA</b>	8,384,487,076	3,965,324,425
	201200102001		Reportos	7,006,252,273	2,000,940,482
	201200102002		Préstamo de valores	1,378,234,803	1,964,383,943
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	39,826,843,898	33,707,618,530
	201400102001		Con fines de negociación	30,812,349,494	30,220,330,658
	201400102002		Con fines de cobertura	9,014,494,404	3,487,287,872
201600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS</b>	0	2,420,358
201800001001			<b>OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
202000001001			<b>Pasivo por arrendamiento</b>	2,542,168,069	2,810,706,933
202200001001			<b>Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal</b>	0	0
202400001001			<b>OTRAS CUENTAS POR PAGAR</b>	31,833,741,864	20,613,290,510
	202400102001		Acreeedores por liquidación de operaciones	13,065,921,770	5,799,682,017
	202400102002		Acreeedores por cuentas de margen	1,642,563,929	1,919,538,173
	202400102003		Acreeedores por colaterales recibidos en efectivo	3,216,671,256	4,135,175,287
	202400102004		Contribuciones por pagar	506,634,630	429,793,533
	202400102005		Acreeedores diversos y otras cuentas por pagar	13,401,950,279	8,329,101,500
202600001001			Pasivos relacionados con grupos de activos mantenidos para la venta	0	0
202800001001			Pasivos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
20300001001			Instrumentos financieros que califican como pasivo	9,059,579,547	9,056,914,915
	203000102001		<b>OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN</b>	9,059,579,547	9,056,914,915
	203000102002		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	203000102003		Otros	0	0
203200001001			<b>Obligaciones asociadas con el retiro de componentes de propiedades, mobiliario y equipo</b>	0	0
203400001001			<b>Pasivo por impuestos a la utilidad</b>	406,767,452	1,967,203,346
203600001001			<b>Pasivo por beneficios a los empleados</b>	6,325,906,261	5,638,000,758
203800001001			<b>Créditos diferidos y cobros anticipados</b>	1,070,579,104	1,056,897,902
400000000000			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	78,686,852,596	75,280,032,227
440200001001			<b>Participación controladora</b>	78,685,436,361	75,278,792,411
	400200102001		<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	13,468,335,561	13,468,335,561
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	9,420,300,433
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	1,250,665,369
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	2,716,852,485	2,716,852,485
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	80,517,274
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		<b>CAPITAL GANADO</b>	65,217,100,800	61,810,456,850
		400200203010	Reservas de capital	8,949,346,887	7,839,163,707
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	162,317,294
		400200203012	Resultados acumulados	56,116,362,815	53,797,569,992
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	44,837,386,812	42,695,738,190
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	11,278,976,003	11,101,831,802
	400200203013		Otros resultados integrales	-9,447,642	13,509,930
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-101,013,858	-356,411,059
		400201304007	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0
		400201304008	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	702,398,188	851,988,920
		400201304009	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0
		400201304010	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304011	Incremento por actualización de Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304012	Remediación de beneficios definidos a los empleados	-610,831,972	-482,067,931
		400201304013	Incremento por actualización de la remediación de beneficios definidos a los empleados	0	0
		400201304014	Efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304015	Incremento por actualización del efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304016	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
		400201304017	Incremento por actualización del resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	400200203014		Participación en ORI de otras entidades	-1,478,554	-2,104,073
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			<b>PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA</b>	1,416,235	1,239,816
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	176,419	121,181
	440400102002		Otra participación no controladora	1,239,816	1,118,635
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			<b>CUENTAS DE ORDEN</b>	3,488,839,397,834	3,002,581,782,876
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	258,234,287,345	264,565,231,096
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	486,327,951,199	447,011,007,183
	700800102001		Fideicomisos	457,216,878,220	417,732,711,937
	700800102002		Mandatos	29,111,072,979	29,278,295,246
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	761,415,354,614	605,231,886,406
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	15,342,313,090	11,013,636,844
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	8,382,709,020	3,964,844,011
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,601,116,854	1,333,372,123
702000001001			Otras cuentas de registro	1,957,535,665,712	1,669,461,805,213

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04

AÑO: 2023

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

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 31 DE DICIEMBRE DE 2023 Y 2022

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	79,209,502,074	57,270,188,990
600400101002	Gastos por intereses	52,136,578,670	31,711,153,413
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	<b>MARGEN FINANCIERO</b>	27,072,923,404	25,559,035,577
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	2,197,139,420	1,739,040,369
330000000002	<b>MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS</b>	24,875,783,984	23,819,995,208
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	4,960,152,083	5,015,565,027
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	483,524,078	624,101,725
501400301007	Resultado por intermediación	1,865,323,696	1,548,475,559
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	878,466,799	676,146,640
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	17,320,024,164	16,703,653,977
330000000003	<b>RESULTADO DE LA OPERACIÓN</b>	14,776,178,320	13,732,426,732
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	562,322,358	59,067,750
330000000004	<b>RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD</b>	15,338,500,678	13,791,494,482
602400501012	Impuestos a la utilidad	4,059,348,256	2,689,541,499
330000000005	<b>RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS</b>	11,279,152,422	11,101,952,983
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	<b>RESULTADO NETO</b>	11,279,152,422	11,101,952,983
502800701014	Otros Resultados Integrales	-22,957,572	-127,435,672
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	255,397,201	-245,373,166
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	-149,590,732	472,698,144
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remediación de beneficios definidos a los empleados	-128,764,041	-354,760,650
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	625,519	-2,104,073
330000000007	<b>RESULTADO INTEGRAL</b>	11,256,820,369	10,972,413,238
543200601016	<b>Resultado neto atribuible a:</b>	11,279,152,422	11,101,952,983
543201602158	Participación controladora	11,278,976,003	11,101,831,802
543201602159	Participación no controladora	176,419	121,181
543400701017	<b>Resultado integral atribuible a:</b>	11,256,820,369	10,972,413,238
543401702160	Participación controladora	11,256,820,369	10,972,413,238
543401702161	Participación no controladora	0	0
330000000008	<b>UTILIDAD BÁSICA POR ACCIÓN ORDINARIA</b>	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

**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 2023 Y 2022

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**(PESOS)**

**Impresión Final**

			<b>AÑO ACTUAL</b>	<b>AÑO ANTERIOR</b>
<b>CUENTA</b>	<b>SUB-CUENTA</b>	<b>CUENTA / SUBCUENTA</b>	<b>IMPORTE</b>	<b>IMPORTE</b>
		<b>Actividades de operación</b>		
851000102001		<b>Resultado antes de impuestos a la utilidad</b>	15,338,500,678	13,791,494,482
851000102002		<b>Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:</b>	1,510,316,069	2,858,012,309
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	1,087,984,682	1,041,925,328
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	798,173,958	812,608,370
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	18,359,266	-34,878,453
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-562,322,358	-59,067,750
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	168,120,521	1,097,424,814
	851000203006	Operaciones discontinuadas	0	0
	851000203007	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	0	0
851000102003		Ajustes por partidas asociadas con actividades de financiamiento	2,071,163,944	978,111,166
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	2,071,163,944	978,111,166
	851000303003	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000303004	Otros intereses	0	0
851000102004		<b>Cambios en partidas de operación</b>	-27,824,521,258	-6,747,846,177
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	-12,713,638,911	481,304,783
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	825,326,436	-2,766,931,734
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	-51,099,667,471	563,633,634
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	-4,784,155,524	10,223,160,843
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-6,765,080,118	-12,461,681,176
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	-22,206,276,543	-62,155,081,862
	851000403008	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	851000403009	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	851000403010	Cambio en activos virtuales	0	0
	851000403011	Cambio en otras cuentas por cobrar (neto)	-11,417,752,769	-1,279,719,546
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-293,233,530	-182,720,245
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	861,915,662	4,143,841,887
	851000403014	Cambio en captación tradicional	56,234,920,423	43,410,537,357
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	12,559,756,723	-1,884,779,690
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	-3,301	23,774
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	4,419,162,651	1,207,667,183
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	6,119,225,368	12,827,464,033
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	2,664,632	2,664,632
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	266,357,595	-2,172,730,150
	851000403021	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	851000403022	Cambio en activos/pasivos por beneficios a los empleados	488,001,073	-148,771,530
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	6,158,308,638	3,833,035,746
	851000403024	Cambio en otras provisiones	46,372,571	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-6,526,724,863	-388,764,116
851000001001		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de operación</b>	-8,904,540,567	10,879,771,780
		<b>Actividades de inversión</b>		
	851000202001	Pagos por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202002	Cobros por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202003	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-1,017,486,933	-1,000,650,882
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	17,241,826	12,313,068
	851000202005	Pagos por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202006	Cobros por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202007	Pagos por adquisición de subsidiarias	0	0
	851000202008	Cobros por disposición de subsidiarias	0	0
	851000202009	Pagos por adquisición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202010	Cobros por disposición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202011	Cobros de dividendos en efectivo de inversiones permanentes	166,903,920	57,687,998
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-820,480,469	-740,340,609
	851000202013	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	851000202014	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	851000202015	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

**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 2023 Y 2022

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**(PESOS)**

**Impresión Final**

			<b>AÑO ACTUAL</b>	<b>AÑO ANTERIOR</b>
<b>CUENTA</b>	<b>SUB-CUENTA</b>	<b>CUENTA / SUBCUENTA</b>	<b>IMPORTE</b>	<b>IMPORTE</b>
	851000202016	Otros cobros por actividades de inversión	0	1,788,070,981
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	<b>Flujos netos de efectivo de actividades de inversión</b>	<b>-1,653,821,656</b>	<b>117,080,556</b>
		<b>Actividades de financiamiento</b>		
	851000302001	Cobros por la obtención de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302002	Pagos de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302003	Pagos de pasivo por arrendamiento	-740,310,752	-734,694,368
	851000302004	Cobros por emisión de acciones	0	0
	851000302005	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	851000302006	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302007	Pagos asociados a instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302008	Pagos de dividendos en efectivo	-2,849,994,662	-4,399,991,759
	851000302009	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	851000302010	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo	0	0
	851000302011	Pagos asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	-2,071,163,944	-978,111,166
	851000302012	Pagos por intereses por pasivo por arrendamiento	0	0
	851000302013	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302014	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302015	Otros cobros por actividades de financiamiento	0	0
	851000302016	Otros pagos por actividades de financiamiento	0	0
851000001003		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento</b>	<b>-5,661,469,358</b>	<b>-6,112,797,293</b>
	851000000000	<b>Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo</b>	<b>-16,219,831,581</b>	<b>4,884,055,043</b>
	851200000000	<b>Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
	851400000000	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo</b>	<b>63,880,972,463</b>	<b>58,996,917,420</b>
	100200001001	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo</b>	<b>47,661,140,882</b>	<b>63,880,972,463</b>

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

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

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

**ESTADO DE CAMBIOS EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE**  
**CRÉDITO**

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2023 Y 2022

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado									Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de Instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de Instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remedaciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversión	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Participación en ORI de otras entidades			
<b>Saldo al inicio del periodo</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	8,001,481,001	53,797,569,992	-356,411,059	851,988,920	0	-482,067,931	0	0	-2,104,073	75,278,792,411	1,239,816	75,280,032,227
<b>Ajustes retrospectivos por cambios contables</b>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Ajustes retrospectivos por correcciones de errores</b>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Saldo ajustado</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	8,001,481,001	53,797,569,992	-356,411,059	851,988,920	0	-482,067,931	0	0	-2,104,073	75,278,792,411	1,239,816	75,280,032,227
MOVIMIENTOS DE PROPIETARIOS																
Aportaciones de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Reembolsos de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Decreto de dividendos	0	0	0	0	0	-7,850,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-7,850,000,000	0	-7,850,000,000
Capitalización de otros conceptos del capital contable	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cambios en la participación controladora que no implican pérdida de control	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total	0	0	0	0	0	-7,850,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-7,850,000,000	0	-7,850,000,000
MOVIMIENTOS DE RESERVAS																
Reservas de capital	0	0	0	0	1,110,183,180	-1,110,183,180	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
RESULTADO INTEGRAL																
Resultado neto	0	0	0	0	0	11,278,976,003	0	0	0	0	0	0	0	11,278,976,003	176,419	11,279,152,422
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	255,397,201	-149,590,732	0	-128,764,041	0	0	0	-22,957,572	0	-22,957,572
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	255,397,201	0	0	0	0	0	0	255,397,201	0	255,397,201
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	-149,590,732	0	0	0	0	0	-149,590,732	0	-149,590,732
Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remedición de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-128,764,041	0	0	0	-128,764,041	0	-128,764,041
Efecto acumulado por conversión	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Participación en ORI de otras entidades	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	625,519	625,519	0	625,519
Total	0	0	0	0	0	11,278,976,003	255,397,201	-149,590,732	0	-128,764,041	0	0	625,519	11,256,643,950	176,419	11,256,820,369
<b>Saldo al final del periodo</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	56,116,362,815	-101,013,858	702,398,188	0	-610,831,972	0	0	-1,478,554	78,685,438,361	1,416,235	78,686,852,596

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 1 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

## Información Financiera

SCOTIABANK INVERLAT

### Indicadores Financieros

Scotiabank-Indicadores Financieros T1 2023T2 2023T3 2023T4 2023

ROE

(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)15.9%13.2%14.8%  
14.2%

ROA

(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)1.6%1.3%1.5%1.4%

MIN

(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos  
productivos promedio)3.7%3.4%3.3%3.1%

Eficiencia Operativa

(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total  
promedio)2.3%2.2%2.1%2.2%

Índice de Morosidad

(Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del  
trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)3.8%4.0%4.0%3.3%

Índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3

(Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del  
trimestre/Saldo de la  
cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)87.8%82.2%  
79.8%77.4%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito21.01%21.94%22.60%21.47%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales

(crédito, mercado y operacional)16.12%16.59%17.07%15.99%.

Liquidez

(Activos líquidos / Pasivos líquidos)44.0%50.6%49.0%47.2%

La utilidad neta al cierre del cuarto trimestre alcanza \$2,828 millones, un incremento de \$908 millones o 47% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por menores requerimientos de reservas crediticias. Por otro lado, respecto al trimestre anterior se mostró una disminución de \$108 millones o 4%, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias y menores ingresos no financieros; compensados parcialmente por un incremento de 7% en margen financiero y menores impuestos a la utilidad.

La utilidad neta acumulada al cierre de diciembre 2023 se ubicó en \$11,279 millones; un incremento de \$177 millones o 2% respecto al mismo periodo del año pasado. En el periodo, el PTPP creció 10%, impulsado por un crecimiento del 7% en los ingresos totales y una gestión eficiente del gasto.

3 meses12 meses

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 2 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Scotiabank- Información Financiera

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 dic

202230 sep

202331 dic

2023A/A

Δ%31 dic

202231 dic

2023A/A

Δ%

Ingresos por intereses 16,950 19,984 21,215 25% 57,270 79,209 38%

Gastos por intereses (10,211) (13,250) (14,035) 37% (31,711) (52,136) 64%

Margen Financiero 6,739 6,734 7,180 7% 25,559 27,073 6%

Comisiones 1,197 1,044 1,210 1% 4,392 4,477 2%

Resultado por Intermediación 333 430 312 -6% 1,548 1,865 20%

Otros ingresos/egresos de la operación 274 273 115 -58% 676 878 30%

Ingresos no Financieros 1,804 1,747 1,637 -9% 6,616 7,220 9%

Total Ingresos 8,543 8,481 8,817 3% 32,175 34,293 7%

Gastos de Administración y Promoción (4,310) (4,096) (4,510) 5% (16,704) (17,320) 4%

PTPP 1). 4,233 4,385 4,307 2% 15,471 16,973 10%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (2,006) (574) (1,191) -41% (1,739) (2,197) 26%

Resultado de la Operación 2,227 3,811 3,116 40% 13,732 14,776 8%

Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no

Controladora - - 394 0% 59 562 > +100%

Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 2,227 3,811 3,510 58% 13,791 15,338 11%

Impuestos a la Utilidad (307) (875) (682) > +100% (2,689) (4,059) 51%

Resultado Neto 1,920 2,936 2,828 47% 11,102 11,279 2%

Otros Resultados Integrales

Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender 238 (489) 662 > +100% (245)

255 > -100%

Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo (137)

831 (774) > +100% 473 (150) > -100%

Remediación de beneficios definidos a los empleados (366) 20 (154) -58% (355) (129) -64%

Participación en ORI de otras entidades (2) - 1 > -100% (2) 1 > -100%

Resultado Integral 1,653 3,298 2,563 55% 10,973 11,256 3%

1).PTPP: "Pre-Tax, Pre-Provision", resultado antes de impuestos y reservas.

**Margen Financiero**

El margen financiero fue de \$7,180 millones al cierre del cuarto trimestre de 2023, un incremento de \$441 millones o 7% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente relacionado con mayores ingresos en la cartera comercial e hipotecaria; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de \$446 millones o 7%; debido principalmente a mayores volúmenes de cartera hipotecaria, auto, préstamos sin garantía y cartera corporativa; así como mayores depósitos de exigibilidad inmediata.

El margen financiero acumulado al cierre de diciembre 2023 ascendió a \$27,073 millones, un incremento anual de \$1,514 millones o 6% respecto al mismo periodo de 2022, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera corporativa, hipotecaria, auto y préstamos sin garantía; así como una mayor participación de depósitos a plazo y mayores intereses pagados; relacionado con niveles más altos en las tasas de referencia.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 3 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

## Ingresos no Financieros

El total de ingresos no financieros fue de \$1,637 millones en el cuarto trimestre de 2023, una disminución de \$167 millones o 9% respecto al mismo periodo del año anterior, debido a mayores gastos en aportaciones al IPAB y en afectaciones a la estimación de pérdidas crediticias esperadas; ambos en Otros Ingresos / Egresos de la Operación.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron una disminución de \$110 millones o 6%, debido a mayores comisiones, más que compensadas por mayores gastos en aportaciones al IPAB y afectaciones a la estimación de pérdidas crediticias esperadas (ambos en Otros Ingresos / Egresos de la Operación), así como menores ingresos por intermediación. La variación en resultado por intermediación se debió principalmente a una pérdida en instrumentos financieros derivados; compensados parcialmente por una utilidad en inversiones en instrumentos financieros y mercado cambiario.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de diciembre 2023 ascendió a \$7,220 millones, un incremento de \$604 millones o 9% respecto al año anterior debido principalmente a mayores ingresos por intermediación y comisiones de seguros en Otros Ingresos / Egresos de la Operación. La variación en intermediación se debe principalmente a mayores ingresos provenientes de inversiones en instrumentos financieros, compensados parcialmente por una menor utilidad en el mercado cambiario y una pérdida en instrumentos financieros derivados.

3 meses 12 meses

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 dic

202230 sep

202331 dic

2023A/A

Δ% 31 dic

202231 dic

2023A/A

Δ%

Aceptaciones por Cuenta de Terceros - - 1 0% 1 3 > +100%

Actividades Fiduciarias 54 53 46 -15% 230 212 -8%

Apertura de Cuenta 6 6 5 -17% 19 22 16%

Cartas de Crédito 82 34 81 -1% 248 251 1%

Cheques Certificados 1 1 1 0% 3 3 0%

Cheques de caja 1 - - -100% 2 1 -50%

Compraventa de instrumentos financieros - (1) - 0% 1 2 100%

Manejo de Cuenta 86 83 91 6% 355 339 -5%

Operaciones de Crédito 487 403 482 -1% 1,745 1,663 -5%

Otras Comisiones y Tarifas 401 395 430 7% 1,491 1,689 13%

Servicios de Banca Electrónica 50 45 47 -6% 186 188 1%

Transferencia de Fondos 29 25 26 -10% 111 104 -6%

Total de Comisiones y Tarifas (netas) 1,197 1,044 1,210 1% 4,392 4,477 2%

3 meses 12 meses

Scotiabank-

Otros Ingresos/Egresos de la operación

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 dic

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 4 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

202230 sep  
202331 dic  
2023A/A  
Δ%31 dic  
202231 dic  
2023A/A  
Δ%  
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas 20 9 (15) > -100%(62) 6  
> -100%  
Aportaciones al IPAB(521) (551) (577)11%(2,020) (2,203)9%  
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo 25 8 5 -80% 217 57 -74%  
Donativos(11) - (17)55%(20) (17)-15%  
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados 14 18 9 -36% 53 63  
19%  
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito 52 - - -100% 53 - -100%  
Ingresos por Arrendamiento 3 11 9 > +100% 17 42 > +100%  
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados 45 53 56 24%  
145 206 42%  
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación 639 782 787 23% 2,823 3,050  
8%  
Pérdida por venta de cartera de crédito - -(79)0% - (79)0%  
Quebrantos(34) (73) (149) > +100%(591) (360)-39%  
Recuperaciones 11 3 3 -73% 19 17 -11%  
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo 1 13 (1) > -100% 12 12 0%  
Utilidad por venta de cartera de crédito 30 - 84 > +100% 30 84 > +100%  
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación 274 273 115 -58% 676 878 30%

## Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

3 meses12 meses

Scotiabank-

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 dic

202230 sep

202331 dic

2023A/A

Δ%31 dic

202231 dic

2023A/A

Δ%

Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(2,006) (574) (1,191)-41%(1,739)  
(2,197)26%

En el cuarto trimestre de 2023, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en \$1,191 millones, una disminución de \$815 millones respecto al mismo periodo del año anterior; debido a menores requerimientos de cartera comercial; compensados parcialmente por mayores requerimientos de cartera de vivienda, consumo y automotriz.

Respecto al trimestre anterior, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra un incremento de \$617 millones, debido principalmente a mayores requerimientos en la cartera comercial, vivienda, consumo y automotriz.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de diciembre 2023 ascendió a \$2,197 millones, un incremento de \$458 millones o 26% respecto al acumulado del año anterior, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias en cartera de

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 5 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

vivienda, consumo y automotriz; compensado parcialmente por el efecto en reservas crediticias producto de la implementación de IFRS 9 durante el primer trimestre de 2022.

## Gastos de Administración y Promoción

3 meses 12 meses

Scotiabank-

Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

31 dic

202230 sep

202331 dic

2023A/A

Δ% 31 dic

202231 dic

2023A/A

Δ%

Gastos de Personal (1,555) (1,799) (1,783) 15% (7,426) (7,950) 7%

Gastos de Operación (2,755) (2,297) (2,727) -1% (9,278) (9,370) 1%

Total de Gastos de Administración y Promoción (4,310) (4,096) (4,510) 5% (16,704) (17,320) 4%

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,510 millones en el cuarto trimestre de 2023, un incremento de \$200 millones o 5% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a una mayor PTU y mayores gastos de amortización de sistemas.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, incrementaron \$414 millones u 10%, debido principalmente a mayores gastos por amortización de sistemas, tarjetas de crédito y gastos generales.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de diciembre 2023 ascendieron a \$17,320 millones, un incremento anual de \$616 millones o 4%, debido principalmente a mayores sueldos, amortización de sistemas y PTU.

## Impuestos a la Utilidad

3 meses 12 meses

Scotiabank-Impuestos - Impuestos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 dic

202230 sep

202331 dic

2023A/A

Δ% 31 dic

202231 dic

2023A/A

Δ%

Impuesto a la Utilidad Causado (682) (1,103) (657) -4% (2,924) (3,701) 27%

Impuesto a la Utilidad Diferido 375 228 (25) > -100% 235 (358) > -100%

Total de Impuestos a la Utilidad (307) (875) (682) > +100% (2,689) (4,059) 51%

En el cuarto trimestre de 2023, se registró un impuesto neto a cargo de \$682 millones, un incremento de \$375 millones respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una mayor utilidad gravable en el periodo.

Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto disminuyó \$193 millones o 22%, principalmente por una menor utilidad gravable en el periodo.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 6 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Los impuestos netos acumulados al cierre de diciembre 2023 ascendieron a \$4,059 millones, un incremento anual de \$1,370 millones o 51%, debido a la disminución de la inflación del ejercicio y a una mayor utilidad gravable en el periodo.

## Balance General

Scotiabank - Cifras relevantes del Balance General  
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 dic

202230 sep

202331 dic

2023A/A

Δ%

Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores 231,456 275,547 284,193 23%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 2476,776 479,687 496,519 4%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 318,541 19,791 17,061 -8%

Partidas diferidas 2,746 2,899 3,093 13%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (16,805) (15,793) (13,209) -21%

Otros Activos 37,223 41,081 48,663 31%

Total Activo 749,937 803,212 836,320 12%

Depósitos 485,323 530,579 541,557 12%

Préstamos Bancarios y de Otros Organismos 49,518 30,451 36,804 -26%

Obligaciones Subordinadas en Circulación 9,057 9,102 9,060 0%

Otros Pasivos 130,759 151,957 170,213 30%

Total Pasivo 674,657 722,089 757,634 12%

Capital 75,280 81,123 78,686 5%

Total Pasivo y Capital 749,937 803,212 836,320 12%

Al 31 de diciembre de 2023, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$836,320 millones, un incremento de \$86,383 millones o 12% respecto al cierre de diciembre de 2022. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en cartera de crédito, inversiones en instrumentos financieros (gubernamental) y deudores por liquidación de operaciones (en otros activos).

Los activos totales incrementaron \$33,108 millones o 4% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en cartera de crédito e inversiones en instrumentos financieros (gubernamental).

El total del pasivo registró \$757,634 millones al 31 de diciembre de 2023, un incremento de \$82,977 millones o 12% respecto al año pasado. Este incremento se debe a mayores volúmenes en depósitos y otros pasivos (acreedores por reporto, instrumentos financieros derivados y acreedores por liquidación de operaciones).

El pasivo total incrementó \$35,545 millones o 5% respecto al cierre del trimestre anterior, principalmente por mayores volúmenes en colaterales vendidos o dados en garantía (en otros pasivos) y depósitos; así como en préstamos bancarios y de otros organismos.

## Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 dic

202230 sep

202331 dic

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 7 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

2023A/A

Δ %

Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	33,259	34,424	37,274	12%
Créditos a la Vivienda	189,071	205,076	213,481	13%
Total Préstamos de Menudeo	222,330	239,500	250,755	13%
Actividad Empresarial o Comercial	221,292	200,356	200,774	-9%
Entidades Financieras	17,426	24,931	23,989	38%
Entidades Gubernamentales	15,728	14,900	21,001	34%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	254,446	240,187	245,764	-3%
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	476,776	479,687	496,519	4%

La cartera de préstamos de menudeo al 31 de diciembre de 2023 alcanzó \$250,755 millones, un incremento anual de \$28,425 millones o 13% y de \$11,255 o 5% millones respecto al trimestre anterior. Los incrementos anual y trimestral fueron impulsados por mayores créditos a la vivienda, créditos automotrices, personales y tarjeta de crédito.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de diciembre de 2023 se ubicó en \$245,764 millones, una disminución anual de \$8,682 millones o 3%; debido a menores créditos de cartera empresarial o comercial; compensados parcialmente por mayores créditos a entidades financieras y gubernamentales.

Respecto al trimestre anterior, el total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales incrementaron \$5,577 millones o 2%, debido a mayores créditos a entidades gubernamentales.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 dic

202230 sep

202331 dic

2023A/A

Δ%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	18,541	19,791	17,061	-8%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(16,805)	(15,793)	(13,209)	-21%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta	1,736	3,998	3,852	> +100%
Índice de morosidad	3.74%	3.96%	3.32%	-42 pb

Al 31 de diciembre de 2023 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$17,061 millones, una disminución anual y trimestral de \$1,480 millones u 8% y de \$2,730 millones o 14% respectivamente.

En esta misma fecha, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$13,209 millones, una disminución anual de \$3,596 millones o 21% y de \$2,584 millones o 16% respecto del trimestre anterior.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 77.4% al 31 de diciembre de 2023, una disminución de 1,400pb respecto del año anterior y de 300pb respecto del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 31 de diciembre de 2023 fue de 3.3%, una disminución de 42pb respecto del año anterior y una disminución de 64pb respecto al trimestre pasado.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 8 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

## Depósitos

### Scotiabank - Depósitos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 dic

202230 sep

202331 dic

2023A/A

Δ%

Total Depósitos Vista y Ahorro 231,775 269,967 276,129 19%

    Público en General 209,629 207,459 208,686 0%

    Mercado de Dinero 31,175 41,217 44,504 43%

Total Depósitos a Plazo 240,804 248,676 253,190 5%

Títulos de Crédito Emitidos 11,765 10,677 10,941 -7%

Cuenta global de captación sin movimientos 979 1,259 1,297 32%

Total de Depósitos 485,323 530,579 541,557 12%

El total de depósitos registró \$541,557 millones al 31 de diciembre de 2023, un incremento anual de \$56,234 millones o 12%, y de \$10,978 millones o 2% respecto al trimestre anterior. Los incrementos anual y trimestral se debieron principalmente a mayores depósitos de vista y ahorro, así como en plazo.

## Obligaciones Subordinadas en Circulación

Al 31 de diciembre de 2023, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$9,060 millones, sin cambios significativos respecto al año pasado y al trimestre anterior.

### Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023 valor razonable)

Categoría Deuda Gubernamental Deuda Bancaria Instrumentos de Patrimonio neto Otros títulos de deuda Total

Instrumentos financieros negociables 75,796 2,309 16 - 78,121

Sin restricción: - - 16 - 16

Restringidos: 75,796 2,309 - - 78,105

    En operaciones de reporto 66,554 2,309 - - 68,863

    Préstamos de valores 1,508 - - - 1,508

    Otros 7,734 - - - 7,734

Instrumentos financieros para cobrar o vender 73,204 26,790 - 2,030 102,024

Sin restricción: 68,184 26,790 - 2,030 97,004

Restringidos: 5,020 - - - 5,020

    En operaciones de reporto 4,383 - - - 4,383

    En operaciones de préstamo de valores - - - - -

    Otros 637 - - - 637

Instrumentos financieros para cobrar principal e interés 4,903 - - - 4,903

Sin restricción 4,903 - - - 4,903

Total 153,903 29,099 16 2,030 185,048

### Scotiabank

Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

Emisor Títulos Tasa Plazo Importe

I-BANSAN-2401214, 818, 500, 00711.25% 414, 809

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
 ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
 DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
 COMPAÑÍA

PAGINA 9 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

I-BANSAN-24045100,958,33211.50%30100  
 F\_HSBCMX\_2300450,000,00011.50%285,040

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023 valor razonable)

Con fines de:Contratos AdelantadosFuturosOpcionesOperaciones EstructuradasSwapsPaquetes  
 de Instrumentos DerivadosTotal activoTotal Pasivo

PosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosición

ActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasiva

Negociación 3,550 2,927 - - 1,297 1,053 370 389 26,372 26,443 - - 31,589  
 30,812

Cobertura - - - - - - - - 11,153 9,015 - - 11,153 9,015

Scotiabank-Montos nacionales en operaciones derivadas

(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de diciembre de 2023)

Con fines de:Contratos AdelantadosFuturosOperaciones EstructuradasOpcionesSwapsPaquetes  
 de Instrumentos Derivados

PosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosición

ActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasiva

Con fines de negociación

Posición USD3,559,981-----

Posición EUR114114-----

Posición CHF-----

Posición GBP-----

Posición CAD-----

Divisas CAD-----

Divisas USD----5757426426----

Divisas EUR-----

Divisas MXN-----5959----

Acciones MXN----87871,1911,191----

Índices MXN-----3,0493,745881----

Tasa de interés

Pesos-----28,37627,794411,567409,067--

Dólares-----7967965,0584,730--

Euros-----8---

Pesos Colombianos-----177,500---

Con fines de cobertura

Tasa de interés

Pesos -----67,1993,500--

Dólares -----557518--

Euros -----

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 31 de  
 diciembre de 2023)PesosDólaresUdisTotal

Actividad empresarial o comercial 157,737 42,802 - 200,539

Créditos a entidades financieras 23,989 - - 23,989

Créditos a entidades gubernamentales 16,572 4,429 - 21,001

Créditos al consumo 36,351 - - 36,351

Créditos a la vivienda 209,772 11 45 209,828

Total 444,421 47,242 45 491,708

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 10 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	235	-	235
Créditos al consumo	923	-	923
Créditos a la vivienda	3,648	3	2 3,653
Total	4,806	3	2 4,811

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	4,969	1,390	- 6,359
Créditos a entidades financieras	56	-	- 56
Créditos al consumo	937	-	- 937
Créditos a la vivienda	9,680	24	5 9,709
Total	15,642	1,414	5 17,061

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)

Saldo al 30 de septiembre de 2023 19,791

Reestructuras 75

Recuperaciones (430)

Castigos y quitas (4,087)

Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 3 1,750

Fluctuación Tipo Cambio (38)

Saldo al 31 de diciembre de 2023 17,061

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)

Saldo al 30 de septiembre de 2023 15,793

Más: Creación de reservas 32

Calificación 1,234

Menos: Adjudicaciones y otros 173

Castigos y quitas 639

Comercial 11

Hipotecario 11

Consumo 517

Eliminaciones 2,770

Venta cartera Usó 223

Desliz cambiario 45

Saldo al 31 de diciembre de 2023 13,209

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito 31 dic

2022 30 sep

2023 31 dic

2023

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

Metropolitano 62.2% 66.0% 69.3%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 11 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Noroeste - Centro 10.7% 9.9% 8.7%  
Norte 13.7% 12.3% 11.2%  
    Bajío 7.9% 6.7% 6.3%  
    Sur 5.5% 5.1% 4.5%  
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3  
Metropolitano 41.5% 54.3% 57.2%  
Noroeste - Centro 19.6% 15.8% 13.1%  
Norte 7.3% 5.7% 5.9%  
    Bajío 15.7% 12.2% 13.5%  
    Sur 15.9% 12.0% 10.3%

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

Grado de Riesgo

Importe Cartera Crediticia Reservas Preventivas Necesarias  
Cartera Comercial Consumo Cartera de Vivienda Total Reservas Preventivas  
No revolventes Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes  
Exceptuada calificada  
Riesgo A 1444,4169191054743211,819  
Riesgo A 262,5055793020516830  
Riesgo B 15,74426516116154  
Riesgo B 26,9606703458168  
Riesgo B 35,67461273653177  
Riesgo C 13,2537676855197  
Riesgo C 23,954773896237448  
Riesgo D 8,529703563221,4542,535  
Riesgo E 8,9223,6286492741,8776,428  
Total 549,9576,0061,0951,5704,08612,756  
Exceso 453  
Reservas Constituidas 13,209

NOTAS:

1). 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 2023.

2). 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-

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 12 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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.

3).El exceso en las reservas preventivas constituidas se explica por lo siguiente:

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$	
9		
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		
44		
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3		4
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		396
Total	\$	453

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 2023 mantiene el Banco en el rubro de "Inversiones en Instrumentos Financieros - Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses" son:

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

Títulos	Importe	Vencimiento
B4	27070111,209,6861,80501	-jul-27
BV	2707016-01	-jul-27
Total	11,209,6921,805	

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023) ISRPTU

Futuros castigos de crédito	4,793	1,137
Pagos anticipados (620)	(147)	
Comisiones cobradas por anticipado	-154	(37)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	786	184
Plan de pensiones	1,048	248
Provisiones y otros	730	135
Otros (439)	4	
Efecto Neto en Diferido	6,144	1,524

Al 31 de diciembre de 2023, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 13 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

VencimientoPréstamosFinanciamientoTotal

Banca

MúltipleBanco de

MéxicoBanca de DesarrolloFondos de FomentoOtros Organismos

Pesos

Inmediato - - - - -

Mediano - - 18,4482,674 - 21,122

Largo - - 2,0004,023 - 6,023

Total - - 20,4486,697 - 27,145

Tasa Promedio0.00%0.00%12.87%10.90%0.00%

Otros

Inmediato - - - - -

Mediano8,519-29632-9,180

Largo---479-479

Total8,5190291,111-9,659

Tasa Promedio5.89%0.00%6.63%5.96%0.00%

Total Préstamos Interbancarios8,519020,4777,808036,804

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 2023.

Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional 31 dic

202230 sep

202331 dic

2023

Depósitos a la Vista49.1%52.2%52.3%

Metropolitano22.3%25.6%27.4%

Noroeste - Centro9.1%8.8%7.2%

Norte7.0%7.5%7.0%

Bajío5.2%4.8%5.0%

Sur5.5%5.5%5.7%

Depósitos Ventanilla44.3%39.9%39.3%

Metropolitano21.4%16.5%18.0%

Noroeste - Centro4.8%4.4%4.1%

Norte8.6%6.6%7.5%

Bajío5.1%6.3%6.0%

Sur4.4%6.1%3.7%

Total de Captación del Público93.4%92.1%91.6%

Fondeo Profesional6.6%7.9%8.4%

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional

Tasa Promedio

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)PesosDólares

Depósitos a la vista (incluye ahorro)5.64%2.63%

Depósitos a plazo10.04%0.00%

Scotiabank-Resultados por Intermediación

(millones de pesos)31 dic

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 14 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

2023

Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable(961)  
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos  
financieros(15)  
Resultado por valuación de divisas(1,880)  
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros  
derivados3,368  
Resultado por compraventa de divisas1,357  
Costos de transacción(4)  
Total 1,865

Emisión de Certificados Bursátiles

Al cierre de diciembre de 2023, las principales características de las emisiones de  
Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las  
siguientes:

Cuarta\*  
Clave de PizarraSCOTIAB 23  
Monto de la Emisión\$7,125 millones  
Fecha de Emisión y Colocación18 agosto  
2023  
Plazo de Vigencia de la Emisión927 días, aprox.  
2.5 años  
GarantíaQuirografaria  
Tasa de interésTIIE28+0.04  
Pago de InteresesCada 28 días durante la vigencia de la emisión  
Calificaciones otorgadas Fitch/S&PAAA(mex) /"mxAAA"  
Amortización del principalUn sólo pago al vencimiento

\* Programa autorizado por la CNBV en diciembre de 2018

Emisión de Obligaciones Subordinadas

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)  
Fecha InicioFecha VencimientoISINPlazo Importe (\$)Tasa (%)  
18-diciembre-1405-diciembre-24MX0QSC1N00163,6402,093,000,0007.4  
28-junio-1809-junio-33MX0QSC1N00245,4603,360,000,00012.3  
11-septiembre-18PerpetuaMX0QSC1N0032-3,455,000,00011.3  
Total de Obligaciones Subordinadas8,908,000,000

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

ClaveNúmero de títulosFecha de EmisiónVencimientoPlazo  
(días)SubyacenteMonto  
99\_SCOTIAB\_4-21120,00024-mar-2108-mar-241080Large-Cap ETF (FXI)10,200,000  
99\_SCOTIAB\_5-214,772,10029-abr-2126-abr-241093Index (IDBTVER)477,210,000  
99\_SCOTIAB\_6-21572,30003-jun-2131-may-241093Index (IDBTVER)57,230,000  
99\_SCOTIAB\_9-213,913,20025-nov-2122-nov-241093Index (BNPIUIL5)391,320,000  
99\_SCOTIAB\_10-213,787,25025-nov-2122-nov-241093Index (BNPIUIL5)378,725,000

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 15 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

99\_SCOTIAB\_1-22533,20028-feb-2225-feb-251093MSFDVTHY Index53,320,000  
99\_SCOTIAB\_2-22512,60028-feb-2227-feb-24729Invesco QQQ Series 1 51,260,000  
99\_SCOTIAB\_5-221,238,86015-jun-2213-jun-251094MSCI USA IMI (ENHAAGE5)123,886,000  
99\_SCOTIAB\_6-221,795,50015-jun-2213-jun-251094MSCI USA IMI (ENHAAGE5)179,550,000  
99\_SCOTIAB\_7-22793,54016-jun-2213-jun-251093MSCI USA IMI (ENHAFOO5)79,354,000  
99\_SCOTIAB\_8-221,027,15016-jun-2213-jun-251093MSCI USA IMI (ENHAFOO5)102,715,000  
99\_SCOTIAB\_11-225,790,75017-nov-2214-nov-251093US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)  
579,075,000  
99\_SCOTIAB\_12-22457,55018-nov-2214-nov-251092US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)  
45,755,000  
99\_SCOTIAB\_13-22104,50023-nov-2221-nov-251094US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)  
10,450,000  
99\_SCOTIAB\_14-22803,80019-dic-2217-dic-251094US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)  
80,380,000  
99\_SCOTIAB\_1-23120,20003-mar-2303-sep-24550iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)  
12,020,000  
99\_SCOTIAB\_2-235,849,35027-jul-2327-ene-25550Dólar - Peso (USDMXN)584,935,000  
99\_SCOTIAB\_3-23423,60031-ago-2328-feb-25547Dólar - Peso (USDMXN)42,360,000  
83\_SCOTIAB\_4-23146,26721-nov-2315-nov-24360S&P 500 Index (SPX)14,626,700  
99\_SCOTIAB\_5-232,536,05008-dic-2307-dic-261095S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)  
253,605,000  
99\_SCOTIAB\_6-231,736,60008-dic-2307-dic-261095S&P / BMV IPC (MEXBOL)173,660,000  
99\_SCOTIAB\_7-23481,40015-dic-2314-dic-261095S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)48,140,000  
Total Bonos Bancarios al 31 de diciembre de 20233,749,776,700

Criterios Contables Especiales derivado de las inundaciones y daños ocasionados por el Huracán OTIS

Mediante los oficios P-307/2023 de fecha 27 de octubre de 2023 y P-318/2023 de fecha 10 de noviembre de 2023, la Comisión emitió con carácter temporal, los criterios contables especiales (CCE) para las instituciones de crédito respecto de la cartera crediticia de consumo, vivienda y comercial, para los clientes que hayan sido afectados en las zonas indicadas por la autoridad competente en la Declaratoria de Emergencia, o bien, a las señaladas en la Declaratoria de Desastre Natural, y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 o Etapa 2 al 24 de octubre de 2023. El plazo para realizar los trámites de renovación o reestructuración finalizarán a más tardar el 30 de abril de 2024.

El programa de apoyo consiste en otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 6 meses y será aplicable a los tipos de crédito y clientes siguientes.

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

Los siguientes créditos no se consideraron como reestructuras y/o renovaciones y podrán permanecer en la misma categoría de riesgo de crédito:

- 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",

2).Créditos con "pagos periódicos de principal e intereses" y,

3).Créditos que desde su inicio se estipule su carácter de revolventes.

Los créditos que sean reestructurados o renovados al amparo de los CCE fueron reportados a las Sociedades de Información Crediticias (SIC) como sigue:

a) Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 al 24 de octubre de 2023, y que no cuenten con días de atraso, no presentaron clave de observación alguna en las SIC.

b) Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 2 al 24 de octubre de 2023, y que cuenten con días de atraso, presentaron la clave de observación RA en las SIC.

c) Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 con posterioridad al 24 de octubre de 2023, presentaron la clave de observación RA en las SIC.

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 para riesgos crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una estimación por la diferencia en un período que no exceda de 12 meses.

#### Aplicación del programa OTIS

Derivado del impacto negativo generado por los fenómenos hidrometeorológicos con afectación severa en el estado de Guerrero, México, el Banco ha determinado apoyar a sus clientes mediante la implementación de diversos programas de apoyo que serán aplicables a todos sus clientes que se encuentren en dicho estado y se suscriban al programa a partir del 24 de octubre 2023 y hasta el 30 de abril de 2024, conforme a lo siguiente:

##### a) CrediAuto

Diferimiento de 6 mensualidades sin capitalización de intereses. Los intereses e impuestos de esas mensualidades diferidas se prorratearon en los pagos mensuales siguientes incrementando el plazo del crédito en 6 meses más. Si el crédito llega a estar vigente (con saldo) en los 6 meses adicionales, se contratarán seguros de daños, vida y desempleo que cubran la extensión de plazo.

##### b) Hipotecario

Diferimiento de 6 mensualidades (los seguros se capitalizan), en este período no se considerará gasto de cobranza por pago tardío; el monto de los intereses prorrogados se distribuirá en 36 mensualidades que el cliente comenzará a cubrir en su pago mensual a partir de la cuota 13 posterior a la aplicación del diferimiento.

##### c) Préstamo personal y préstamo de nómina

Diferimiento de 6 meses del pago del crédito sin capitalización de intereses, el plazo del préstamo será extendido en este mismo número de meses, de acuerdo con la periodicidad del crédito, los intereses generados durante el período de apoyo se harán exigibles en las cuotas que se adicionaron al plazo original. Durante el plan no habrá afectación negativa en el historial de crédito, ni se generará marca negativa en buró

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 17 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

de crédito.

d) ScotiaLine

El apoyo consistió en no requerir el pago mínimo de la línea de crédito revolvente del mes de noviembre 2023 al mes de abril 2024. Durante dicho período de diferimiento no se hará el cobro de la comisión de gastos de cobranza por pago tardío, no habrá afectación en el historial de crédito, ni se generará una marca negativa en él. Durante este período el saldo sigue generando intereses e IVA que serán exigibles y sumados al pago mínimo requerido en el estado de cuenta. El cliente podrá hacer disposiciones de su línea de crédito y el pago correspondiente a estas disposiciones será exigible al terminar dicho periodo.

e) Tarjetas de crédito

Consiste en que no se requerirá el pago mínimo de la tarjeta de crédito de noviembre 2023 a abril 2024. Durante dicho período de diferimiento no se hará el cobro de la comisión de gastos de cobranza por pago tardío, no habrá afectación en el historial de crédito, ni se generará una marca negativa. Dado que el beneficio consiste en diferir el cobro de pago mínimo sin ninguna penalización, mientras no se cubra el pago para no generar intereses se generarán los intereses ordinarios correspondientes. Los intereses generados mes a mes formaran parte del saldo revolvente y con base a dicho saldo se calculará el pago mínimo al finalizar el plan de apoyo.

Los créditos sujetos al criterio contable especial, no se consideraron como reestructuras conforme a lo establecido en el párrafo 35 del Criterio Contable B-6, Cartera de Crédito, tampoco fueron reportados como créditos en etapa 3 ante las sociedades de información crediticia.

A continuación, se presentan los importes que se hubieran registrado y presentado en el estado de situación financiera consolidado y en el estado consolidado de resultado integral por tipo de cartera, de no haberse aplicado el criterio contable especial, así como, el detalle de los conceptos y montos por tipo de cartera, por los cuales se haya realizado la afectación contable con motivo de la aplicación del criterio contable especial al 31 de diciembre de 2023.

2023

Saldo con CCE OTI SEfectos en Cartera y Estimación Saldo sin CCE OTIS

Cartera comercial \$245,529-245,529  
Créditos de consumo 36,351 (3) 36,348  
Créditos a la vivienda: 209,828 (9) 209,819

Etapas 1 \$491,708 (12) 491,696  
Cartera comercial 235-235  
Créditos de consumo 9231924  
Créditos a la vivienda: 3,65373,660

Etapas 2 \$4,81184,819  
Cartera comercial 6,415-6,415  
Créditos de consumo 9372939  
Créditos a la vivienda: 9,70929,711

Etapas 3 \$17,061417,065

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 18 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Cartera de crédito \$513,580-513,580

(+/-) Partidas diferidas \$3,093-3,093

(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios \$(13,209) (5) (13,214)

Total cartera de crédito, neta \$503,464 (5) 503,459

Total activos \$836,320 (5) 836,315

Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados) \$(2,197) (5) (2,202)

Resultado neto \$12,279 (5) 11,274

Total capital contable \$78,686 (5) 78,681

Total pasivo y capital contable \$836,320 (5) 836,315

Reclasificaciones

Al 31 de diciembre de 2022, el Banco agrupaba en el rubro de "Pagos anticipados y otros activos, neto" dentro del activo, los gastos de emisión y el descuento por colocación de depósitos a plazo de mercado de dinero y de títulos de crédito emitidos para efectos de presentación del estado de situación financiera consolidado. La Administración del Banco decidió reclasificarlas debido a su importancia y naturaleza al rubro de "Captación tradicional". Los efectos de estas reclasificaciones se aplicaron retrospectivamente en el estado de situación financiera consolidado al 31 de diciembre de 2022, de acuerdo con la NIF B-1, Cambios contables y correcciones de errores. Los efectos de las reclasificaciones antes mencionadas, en los rubros del estado de situación financiera consolidado, son como sigue:

Concepto Originalmente reportadas Reclasificadas retrospectivamente Cifras después de reclasificaciones

Activo

Pagos anticipados y otros activos, neto 3,116 (143) 3,973

Pasivo

Del público en general:

Mercado de dinero 31,238 (63) 31,175

Títulos de crédito emitidos 11,845 (80) 11,765

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 2023)

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 13,468

2 Resultados de ejercicios anteriores 44,837

3 Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 20,381

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 19 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

(monto permitido en el capital común de nivel 1) No aplica  
6Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios78,686  
Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios  
7Ajustes por valuación prudencial No aplica  
8Crédito mercantil  
(neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -  
9Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -  
10  
conservadorImpuestos 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)1,533  
11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo -  
12Reservas pendientes de constituir -  
13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización -  
14Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable No aplica  
15Plan de pensiones por beneficios definidos -  
16  
conservadorInversiones en acciones propias -  
17  
conservadorInversiones recíprocas en el capital ordinario -  
18  
conservadorInversiones 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  
conservadorInversiones 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  
conservadorDerechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%) -  
21Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo) -  
  
22Monto que excede el umbral del 15% 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  
26Ajustes regulatorios nacionales9,076  
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 anticipados8,502

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 20 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 574  
27Ajustes 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 -  
28Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1 10,609  
29Capital común de nivel 1 (CET1) 68,077  
Capital adicional de nivel 1: instrumentos  
30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima 3,583  
31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables 3,583  
32 de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables No aplica  
33Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1 -  
34Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 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  
36Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios 3,583  
Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios  
37  
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1 No aplica  
38  
conservadorInversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1 No aplica  
39  
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde las Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) No aplica  
40  
conservadorInversiones 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  
41Ajustes regulatorios nacionales -  
42Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones No aplica  
43Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1 -  
44Capital adicional de nivel 1 (AT1) 3,583  
45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) 71,660  
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas  
46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima 3,373  
47Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2 -

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 21 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 conservadorReservas 396

51 Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios 3,769

Capital de nivel 2: ajustes regulatorios

52 conservadorInversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2 No aplica

53 conservadorInversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2 No aplica

54 conservadorInversiones 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 conservadorInversiones 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) 3,769

59 Capital total (TC = T1 + T2) 75,429

60 Activos ponderados por riesgo totales 471,664

Razones de capital y suplementos

61 Capital Común de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) 14.43%

62 Capital de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) 15.19%

63 Capital Total  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) 15.99%

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) 17.53%

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) 7.43%

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 22 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

aplica

73Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras No aplica

74Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo) No aplica

75Impuestos 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

76Reservas 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) 396

77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada 4,156

78Reservas 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) -

79Límite 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)

80Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual No aplica

81Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) No aplica

82Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual -

83Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) -

84Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual -

85Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) -

Scotiabank-Notas al formato de revelación de la integración de capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios

ReferenciaDescripción

1Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

2Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.

3Reservas 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.

4No 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.

5No 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.

6Suma de los conceptos 1 a 5.

7No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.

8Crédito 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.

9Intangibles, 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\*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.

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.

11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.

12\*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.

13Beneficios 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.

14No aplica.

15Inversiones 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\*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 las sociedades 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\*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 inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades 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, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.

18\*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 las sociedades 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.

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.

19\*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 las sociedades 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.

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.

20\*Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos.

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.

21El 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.

22No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.

23No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 25 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

24No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.

25No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.

26Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.

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. 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. 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. 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. 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.

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. 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 del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.

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. 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. 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. 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. 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. 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.

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. 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. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 26 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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.

27No 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.

28Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.

29Renglón 6 menos el renglón 28.

30El 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.

31Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.

32No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.

33Obligaciones 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).

34No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

35No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

36Suma de los renglones 30, 33 y 34.

37 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

38 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

39 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

40 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

41Ajustes 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.

42No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.

43Suma de los renglones 37 a 42.

44Renglón 36, menos el renglón 43.

45Renglón 29, más el renglón 44.

46El 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.

47Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.

48No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

49No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

50Estimaciones 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 27 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 28 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

riesgo de crédito.

771.25% 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.

78Diferencia 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.

790.6 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.

80No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.

81No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.

82Saldo 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.

83Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.

84Saldo 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.

85Saldo 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 2023)

Referencias de los rubros del balance generalRubros del Balance GeneralMonto presentado en el balance general

Activo

BG1Efectivo y equivalentes de efectivo 50,552

BG2Cuentas de Margen 1,372

BG3Inversiones en instrumentos financieros 185,048

BG4Deudores por reporto 8,004

BG5Préstamo de valores -

BG6Instrumentos financieros derivados 42,742

BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros(650)

BG8Total de cartera de crédito (neto) 503,464

BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización -

BG10Otras cuentas por cobrar (neto) 26,938

BG11Bienes adjudicados (neto) 585

BG12Inmuebles, mobiliario y equipo (neto) 2,623

BG13Inversiones permanentes 4,229

BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta 14

BG15Impuestos a la utilidad diferidos (neto) 6,124

BG16Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) 2,575

Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto) 1,646

Activos Intangibles (neto) 4,610

Pasivo

BG17Captación tradicional 541,732

BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos 36,804

Valores Asignados por liquidar 11,501

BG19Acreedores por reporto 73,261

BG20Préstamo de valores -

BG21Colaterales vendidos o dados en garantía 8,384

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 29 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

BG22Instrumentos financieros derivados 39,827  
BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros -  
BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización -  
BG25Otras cuentas por pagar 31,071  
BG26Obligaciones subordinadas en circulación -  
BG27Pasivo por Impuestos a la Utilidad 396  
BG28Créditos diferidos y cobros anticipados 1,071  
Pasivos por arrendamiento 1,791

Instrumentos Financieros que califican como pasivo 9,060  
Pasivos por Beneficio a los Empleados 6,293  
Capital contable  
BG29Capital contribuido 13,468  
BG30Capital ganado 65,217  
Cuentas de orden  
BG31Avales otorgados -  
BG32Activos y pasivos contingentes -  
BG33Compromisos crediticios 258,234  
BG34Bienes en fideicomisos o mandato 486,328  
BG35Agente financiero del gobierno federal -  
BG36Bienes en custodia o en administración 78,303  
BG37Colaterales recibidos por la entidad 15,338  
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad 8,383  
BG39Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto) -  
BG40Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de  
crédito etapa 3 1,601  
BG41Otras cuentas de registro 1,957,381

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 2023)

IdentificadorConceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del  
Capital NetoReferencia del formato de revelación de la integración de capital del  
apartado I del presente anexoMonto 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

1Crédito mercantil8 -  
2Otros Intangibles9 -  
3Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales  
10 1,533 BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,533  
4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización13 -  
5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e  
ilimitado15 -  
6Inversiones en acciones de la propia institución16 -  
7Inversiones recíprocas en el capital ordinario17 -  
8Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no  
posea más del 10% del capital social emitido18 -  
9Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no  
posea más del 10% del capital social emitido18  
10Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución  
posea más del 10% del capital social emitido19 -

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 30 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

posea más del 10% del capital social emitido<sup>19</sup>

12Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales<sup>21</sup> -  
BG 15 Impuestos y PTU dif (neto) \$0

13Reservas reconocidas como capital complementario<sup>50</sup> 396 BG 8 Total de cartera de  
crédito (neto) \$396

14Inversiones en deuda subordinada<sup>26-B</sup> -

15Inversiones en organismos multilaterales<sup>26-D</sup> -

16Inversiones en empresas relacionadas<sup>26-E</sup> -

17Inversiones en capital de riesgo<sup>26-F</sup> -

18Inversiones en sociedades de inversión<sup>26-G</sup> - BG 13 Inversiones Permanentes \$ 0

19Financiamiento para la adquisición de acciones propias<sup>26-H</sup> -

20Cargos diferidos y pagos anticipados<sup>26-J</sup> 8,502 BG 16 Activos Intangibles \$4,610 más  
Gastos de Instalación \$3,892

21Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)<sup>26-L</sup> -

22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos<sup>26-N</sup> -

23Inversiones en cámara de compensación<sup>26-P</sup> 574 BG 13 Inversiones Permanentes \$ 574

**PASIVO**

24Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil<sup>18</sup> -

25Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles<sup>9</sup> -

26Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado<sup>15</sup> -

27Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por  
beneficios definidos<sup>15</sup>

28Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los  
anteriores<sup>21</sup> -

29Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R<sup>31</sup> 3,583 BG 26  
Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,583

30Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No  
Fundamental<sup>33</sup> -

31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S<sup>46</sup> 3,373 BG 26  
Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,373

32Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital  
complementario<sup>47</sup> -

33Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos  
anticipados<sup>26-J</sup> -

**CAPITAL CONTABLE**

34Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q<sup>1</sup> 13,468 BG 29 Capital Social \$10,671  
más Prima en Venta de Acciones \$2,797

35Resultado de ejercicios anteriores<sup>2</sup> 44,837 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores  
\$44,837

36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas  
registradas a valor razonable<sup>3</sup> 702 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de  
Cobertura de Flujo de Efectivo \$702

37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores<sup>3</sup> 19,679 BG 30 Reservas  
de Capital \$9,112 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta  
(\$101) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$611) más Resultado  
Neto \$11,279

38Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R<sup>31</sup> -

39Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S<sup>46</sup> -

40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de  
partidas no registradas a valor razonable<sup>3</sup>, 11 -

41Efecto acumulado por conversión<sup>3</sup>, 26-A -

42Resultado por tenencia de activos no monetarios<sup>3</sup>, 26-A -

**CUENTAS DE ORDEN**

43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas<sup>26</sup> -K -

**CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL**

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 31 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

- 44Reservas pendientes de constituir12 -
- 45Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)26-C -
- 46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I -
- 47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M -
- 48Derogado

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

IdentificadorDescripción

1Crédito mercantil.

2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.

3Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales.

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.

5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado.

6Cualquier 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

7Inversiones 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.

8Inversiones 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.

9Inversiones 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.

10Inversiones 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.

11Inversiones 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.

12Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales.

13Estimaciones 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.

14Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

15Inversiones 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 32 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

16Inversiones 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.

17Inversiones 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.

18Las 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.

19Cualquier 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.

20Cargos diferidos y pagos anticipados.

21La 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.

22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos que tengan ser deducidas de acuerdo con el Artículo 2 Bis 8 de las presentes disposiciones.

23Las 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.

24Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al crédito mercantil.

25Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a otros intangibles (distintos al crédito mercantil).

26Pasivos del plan de pensiones por beneficios definidos asociados a inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos.

27Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al plan de pensiones por beneficios definidos.

28Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales distintos los de las referencias 24, 25, 27 y 33.

29Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.

30Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital Básico No Fundamental.

31Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.

32Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario.

33Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a cargos diferidos y pagos anticipados.

34Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-Q de las presentes disposiciones.

35Resultado de ejercicios anteriores.

36Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a valor razonable.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 33 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

- 37Resultado neto y resultado por valuación de títulos disponibles para la venta.  
38Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.  
39Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.  
40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a costo amortizado.  
41Efecto acumulado por conversión.  
42Resultado por tenencia de activos no monetarios.  
43Posiciones 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.  
44Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.  
45El 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.
- 46Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.  
47El 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.  
48Derogado

## Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	61,407	4,913
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	989	79
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA's	2,371	190
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's, UMA's o con rendimiento referido al INPC	30	2
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	7,196	576
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	2,164	173
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	60	5
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	12	1
Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	27	2
Grupo I-B (ponderados al 4%)	-	-
Grupo II (ponderados al 0%)	-	-
Grupo II (ponderados al 10%)	-	-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 34 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Grupo II (ponderados al 20%)	-	-
Grupo II (ponderados al 50%)	-	-
Grupo II (ponderados al 100%)	-	-
Grupo II (ponderados al 120%)	-	-
Grupo II (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 2.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 10%)	856	68
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	5,288	423
Grupo III (ponderados al 25%)	-	-
Grupo III (ponderados al 50%)	435	35
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%)	4,058	325
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	246	20
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	471	38
Grupo VI (ponderados al 20%)	4,395	352
Grupo VI (ponderados al 25%)	2,815	225
Grupo VI (ponderados al 30%)	10,820	866
Grupo VI (ponderados al 40%)	11,209	897
Grupo VI (ponderados al 50%)	36,727	2,938
Grupo VI (ponderados al 70%)	35	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	25,978	2,078
Grupo VI (ponderados al 85%)	6,183	495
Grupo VI (ponderados al 100%)	47,812	3,825
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%)	115	9
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	18,709	1,497
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	9,223	738
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	121,093	9,687
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	126	10
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,638	131
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%)	790	63
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 35 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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%)	7,158	573
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,592	287
Grupo IX (ponderados al 100%)	28,418	2,273
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-

Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	33	3
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 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	3,053	244
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	20	2
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	66	5

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Indicador de Negocio	46,046	3,684

## CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

Al 31 de diciembre del 2023, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 14.52% (Índice regulatorio más suplemento de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local más Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales), 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 13,468,335,561

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 36 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

9Valor nominal del instrumentoUn Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales  
9A Moneda del instrumentoPesos mexicanos  
10Clasificación contableCapital  
11Fecha de emisión13-ene-01  
12Plazo del instrumentoPerpetuidad  
13Fecha de vencimientoSin vencimiento  
14Cláusula de pago anticipadoNo  
15Primera fecha de pago anticipadoN.A.  
15A Eventos regulatorios o fiscalesNo  
15B Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipadoN.A.  
16Fechas subsecuentes de pago anticipadoN.A.  
Rendimientos / dividendos  
17Tipo de rendimiento / dividendoFijo o Variable  
18Tasa de Interés /DividendoLa 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.  
19Cláusula de cancelación de dividendosSujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.  
20Discrecionalidad en el pago Parcialmente discrecional.  
21Cláusula de aumento de interesesNo  
22Rendimientos / dividendosNo Acumulable  
23Convertibilidad del instrumentoN.A.  
24Condiciones de convertibilidadN.A.  
25Grado de convertibilidadN.A.  
26Tasa de conversiónN.A.  
27Tipo de convertibilidad del instrumentoN.A.  
28Tipo de instrumento financiero de la convertibilidadN.A.  
29Emisor del instrumento Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.  
30Cláusula de disminución de valor (Write-Down)No  
31Condiciones para disminución de valorN.A.  
32Grado de baja de valorN.A.  
33Temporalidad de la baja de valorN.A.  
34Mecanismos de disminución de valor temporalN.A.  
35Posición de subordinación en caso de liquidaciónLos 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.  
36Características de incumplimientoNO  
37Descripción de características de incumplimientoNO

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

ReferenciaDescripción

1Institución de crédito que emite el título que forma parte del Capital Neto.  
2Identificador o clave del título que forma parte del Capital Neto, (ISIN, CUSIP o número identificador de valor internacional).  
3Marco legal con el que el título deberá de cumplir, así como las leyes sobre a las cuales se sujetará.  
4Nivel 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.  
5Nivel de capital al que corresponde el título que cumple con el anexo 1-Q, 1-R, o 1-S de las presentes disposiciones.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 37 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 38 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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.

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 diferentes a las anteriores-  
España-Luxemburgo-  
Estados Unidos-México-

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

Referencia RUBRO Dic-231)

T Sep-23

T-1 Jun-23

T-2 Mar-23

T-3 Dic-22

T-4

1 Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones 16,280 7,799 7,585 7,638 7,719

1a No aplica

2 Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo 471,664 461,662 456,829 459,745 475,011

3 Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%) 3.25% 1.63% 1.63% 1.63% 1.63%

3a No aplica

4 Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-0 Bis de estas disposiciones 868,289 831,882 809,032 814,737 807,899

5 "Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%) 1.88% 0.94% 0.94% 0.94% 0.94%

5a No aplica

6a Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 39 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNoNoNo  
6bComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNoNoNo  
6cEn el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?0%0%0%0%  
1).El Banco al considerarse una institución de Importancia Sistemica Local debe de constituir el suplemento al capital neto en un plazo de cuatro años:

Scotiabank

Composición del Suplemento al Capital Neto

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2023)

ReferenciaMonto

Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes

1Capital Fundamental68,077

2Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto 3,583

3 Capital Básico No Fundamental no elegible, como Suplemento al Capital Neto, emitido por la institución en tenencia de terceros -

4 Otros ajustes -

5Instrumentos elegibles de Capital Básico No Fundamental para el Suplemento al Capital Neto 3,583

6Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto 3,768

7Porción amortizada de instrumentos de capital complementario, donde el vencimiento remanente > 1 año -

8"Capital complementario no elegible, como Suplemento al Capital Neto emitido por la institución en tenencia de terceros

9Otros ajustes -

10Instrumentos elegibles de Capital Complementario, de acuerdo a las reglas para el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales 3,768

11Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio 75,429

Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio

12Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco y subordinados a pasivos excluidos -

13"Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco los cuales no son subordinados a pasivos excluidos, pero que cumplen on todos los demás requisitos de la hoja de términos de Suplemento al Capital Neto

14Del cual: Monto elegible de Suplemento al Capital Neto, después de aplicar los límites superiores. No aplica

15Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos por vehículos de financiación, antes del 1 de enero de 2022 No aplica

16Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar a una Institución de importancia sistémica local en resolución No aplica

17Suplemento al Capital Neto surgido de instrumentos de capital no regulatorio antes de ajustes -

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 40 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes

18Suplemento al Capital Neto antes de deducciones 75,429

19Deducciones de exposiciones que corresponden a cuentas elegibles para Suplemento al Capital Neto (no aplicable a una institución de importancia sistémica local con un solo punto de entrada). No aplica

20Deducciones de inversiones en otros pasivos elegibles de Suplemento al Capital Neto -

21Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto -

22Suplemento al Capital Neto después de deducciones75,429

"Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto"

23Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo ajustados como es permitido bajo el régimen Suplemento al Capital Neto4 471,664

24Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-0 Bis de estas disposiciones 868,289

Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos

25"Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)15.99%

26"Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)8.69%

27Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto14.43%

28"Requerimientos de suplementos específicos del banco (suplemento de conservación de capital más requerimiento por suplemento de capital contracíclico más requerimientos por suplemento al capital neto, expresado como porcentaje de APSRT)4.05%

29" Del cual: Requerimiento por suplemento de conservación de capital0.60%

30 Del cual: Requerimiento por suplemento de capital contracíclico específico de banco0.00%

31 Del cual: Requerimiento por suplemento al capital neto3.45%

Scotiabank

Composición del Suplemento al Capital Neto

ReferenciaExplicación

Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes

1El Capital Fundamental calculado de conformidad con los artículos 2 Bis 5 y 2 Bis 6 de la CUB.

2Capital Básico No Fundamental. Esta línea proporcionará información sobre el Capital No Fundamental, calculado de conformidad con los artículos 2 Bis 5 y 2 Bis 6 de la CUB.

3Los instrumentos de capital Básico No Fundamental emitidos por la Institución en tenencia de terceros que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.

4Otros elementos del Capital Básico No Fundamental que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.

5Instrumentos de Capital Básico No Fundamental de acuerdo al último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, para ser calculado como línea 2 menos líneas 3 y 4.

6Capital Complementario, calculado con base en lo establecido en el artículo 2 Bis 5 y 2 Bis 7.

7Porción amortizada de Instrumentos de Capital Complementario donde el vencimiento remanente es mayor a un año. Esta línea reconoce que, en tanto el plazo remanente de un instrumento de capital complementario sea mayor al requerimiento de vencimiento residual de un año, el monto total podrá ser incluido en el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales, incluso si el instrumento es parcialmente del capital regulatorio vía el requerimiento para amortizar el instrumento en cinco años previo al vencimiento. Solo el monto no reconocido en el capital regulatorio, que cumpla con todos los criterios de elegibilidad del Suplemento al Capital Neto deberá ser reportados en esta línea.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 41 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

8 Instrumentos de capital complementario emitidos por la Institución en tenencia de terceros que no son elegibles para el Suplemento al Capital Neto. De acuerdo con la fracción IV, del artículo 2 Bis 5 de la CUB y los Anexos 1-R y 1-S, para cumplir con los requerimientos mínimos de Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales hasta el 31 de diciembre de 2021

9 Otros elementos de capital complementario que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.

10 Instrumentos de capital Complementario elegibles de Suplemento al Capital Neto de acuerdo al último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, para ser calculado como: línea 6 - línea 7 - línea 8 - línea 9.

11 Suplemento al Capital Neto surgido del capital regulatorio para ser calculado como: línea 1 + línea 5 + línea 10.

Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio

12 Instrumentos externos del Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por la institución y deuda subordinada excluida. El monto reportado en esta línea debe cumplir los requerimientos de subordinación señalados en el Anexo 1-R o Anexo 1-S.

13 Instrumentos externos emitidos directamente por institución que no son subordinados a pasivos excluidos, pero cumplen los otros requisitos de los Anexos 1-R o 1-S.

14 El monto reportado en la línea 13, después de la aplicación de los límites superiores 2.5% y 3.5% mostrados en el penúltimo párrafo de la sección 11 de la hoja de términos del TLAC

15 Instrumentos externos de TLAC emitidos con fines de financiamiento previo al 1 de enero de 2022. Montos emitidos después del 1 de enero de 2022 no son elegibles para efectos de Suplemento al Capital Neto y no deben ser reportados aquí. No aplica.

16 Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar una institución de importancia sistémica local en resolución, sujeta a las condiciones mostradas en el segundo párrafo de la sección 7 de la hoja de términos de TLAC. No aplica.

17 Elementos del capital no regulatorio del Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 12 + línea 13

Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes

18 Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 11 + línea 17.

19 Deducciones de exposiciones de la institución de importancia sistémica local que corresponden a cuentas elegibles para Suplemento al Capital Neto. Todos los montos reportados en esta línea deben corresponder a deducciones aplicadas después de los ajustes adecuados acordados por el grupo de administración de crisis (CMG) (siguiendo el penúltimo párrafo de la sección 3 de la hoja de términos de TLAC, el CMG debe discutir y, donde sea adecuado y consistente con la estrategia de resolución, acordar la asignación de las deducciones).

20 "Deducciones de inversiones en otros pasivos de TLAC propios, monto para ser deducido de recursos de TLAC. No aplica

21 Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto.

22 "El Suplemento al Capital Neto (como puede ser el caso) después de deducciones. Para ser calculado como: línea 18 - línea 20 - línea 21.

"Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto

23 APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.

24 Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-0 Bis de estas disposiciones bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.

Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos

25 Indicador Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto), para ser calculada como línea 22 dividido entre línea 23.

26 "Indicador Suplemento al Capital Neto (como porcentaje de Exposiciones totales

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 42 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

asociadas a la Razón de Apalancamiento), para ser calculado como línea 22 entre línea 24.

27Capital Fundamental (como porcentaje de APSRT) disponible después de cumplir con el requerimiento mínimo de capital y requerimiento Suplemento al Capital Neto de la institución. Para ser calculado como índice de capital fundamental adecuado, menos cualquier capital social (como un porcentaje de APSRT) usado para cumplir el capital fundamental, el capital básico, y el capital total mínimo, así como el requerimiento de Suplemento al Capital Neto.

28Requerimientos de suplementos específicos del banco (suplemento de conservación de capital más suplemento de capital contracíclico más requerimiento por suplemento para institución de importancia sistémica local, expresado como un porcentaje de APSRT). Calculado como la suma de: i) el suplemento de conservación de capital de la institución de importancia sistémica local; el requerimiento por suplemento contracíclico específico de la institución de importancia sistémica local; y iii) los requerimientos por suplemento al capital neto.

29"El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan al suplemento por conservación de capital), de acuerdo al nivel de importancia sistémica local.

30El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan con requerimientos por suplemento de capital contracíclico específico de la institución de importancia sistémica local).

31El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan con al requerimiento para absorción de pérdidas mayores.

## Gestión de Capital

Para evaluar la suficiencia de capital, Scotiabank parte de su plan anual de exposiciones para obtener una visión prospectiva de la institución que le permita identificar los riesgos a los que está expuesto y fundamentar su toma de decisiones al visualizar métricas e indicadores clave tales como: capital, liquidez, rentabilidad y pérdidas crediticias.

El Plan de Exposiciones es estructurado con base en una visión del escenario macroeconómico del país y los planes de las distintas líneas de negocio.

Al mismo tiempo, para asegurar el cumplimiento y el monitoreo continuo de la suficiencia de Capital, se ha documentado un "Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez", el cual tiene como propósito instrumentar indicadores de alerta temprana, los cuales son la base para que el Comité de Manejo de la Liquidez y el Capital lleve a cabo las evaluaciones y seguimientos de acuerdo a lo establecido en las Políticas correspondientes, según el impacto y la magnitud del evento de estrés.

De forma trimestral se incorporan a los reportes financieros las notas de capitalización. Estas notas contienen, entre otras, la siguiente información: composición e integración del capital, composición de los activos ponderados por riesgos totales y por tipo de riesgo, así como las estimaciones del Índice de Capital.

Asimismo, anualmente se realizan las pruebas de estrés que establece la Comisión Bancaria bajo diversos escenarios, con el objetivo de asegurar que el Banco cuente con el suficiente capital para continuar intermediando recursos y otorgando créditos ante estos escenarios de estrés, considerando sus estrategias de negocio. Adicionalmente se realiza un análisis de escenarios internos de estrés que, partiendo del Plan de Exposiciones como escenario base, integran diversas condiciones macroeconómicas adversas con el fin de revelar la exposición del Banco a los diferentes riesgos.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 43 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

La institución realizó durante 2023 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 y regulatorios. 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 3 de abril de 2023 como Institución de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local a Scotiabank Inverlat, S.A., mediante oficio Núm. 141-5/35035/2023 su grado de importancia sistémica y el suplemento de conservación de capital adicional, la institución fue calificada como Grado I por lo que deberá continuar con un suplemento de capital de 60 puntos base.

En base a lo anterior y continuando con la constitución del requerimiento de capacidad total de absorción de pérdidas (TLAC, que corresponde al máximo entre el 6.5% de los APSR Totales y el 3.75% de los Activos Ajustados) la institución tiene que añadir una cuarta parte desde diciembre 2022, por lo que el capital mínimo regulatorio que debe mantener Scotiabank, es de 14.55% y 12.73% al 31 de diciembre de 2023 y 2022.

## 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.

Al 30 de junio de 2021, mediante asamblea extraordinaria de accionistas se aprobó como consecuencia de la fusión llevar a cabo un aumento en el capital social del Banco por la cantidad de 53,523,304 acciones correspondientes a la serie "F" con valor nominal de un peso cada una, y el remanente del capital contable de SECOSA que excede a los valores nominales de las acciones que serán emitidas, es decir, la cantidad de \$644, fue reconocido en un rubro denominado prima en emisión de acciones, y que respecto de esta partida, los accionistas de SECOSA no tendrán derecho preferencial, ya que todos los accionistas de la Sociedad, participan de ese importe en proporción a sus respectivos porcentajes de participación.

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 y aprueba periódicamente los objetivos, lineamientos y políticas de administración de riesgos del Banco, 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 equipos expertos por tipo de riesgo, lo anterior para garantizar una gestión adecuada 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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 45 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 de diciembre de 2023 fue de \$17.49 millones y su promedio durante el cuarto trimestre de 2023 fue de \$17 millones mismo que corresponde a un 0.022% del capital neto (\$77,657 millones a noviembre 2023, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del cuarto trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)Cierre

Diciembre 2023Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés

Derivados1,202,7011,168,131

Mercado de Dinero 60,24959,047

Tipo de cambio

Cash4,9374,103

Derivados157,929129,534

Capitales

Derivados9,8749,480

VaR 1 día (millones de pesos)Cierre

Diciembre 2023Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés12.8914.99

Tipo de cambio6.839.15

Capitales--

VaR Global17.4917.00

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 2023 muestra una pérdida máxima de \$184.43 millones. 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 2023, 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 periódica 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.

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de diciembre 2023 así como el promedio del cuarto trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US\$79,21473,018  
Liquidity Buffer  
(bajo métrica CCL) 121,786117,275

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, con un CCL y CFEN promedio durante el cuarto trimestre de 2023 de 149% y 107% respectivamente.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 48 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

depósitos mientras que el segundo considera un análisis histórico para estimar una tasa de prepago aplicable al portafolio de créditos.

Tanto la sensibilidad del valor económico como de la sensibilidad de margen contemplan un impacto de  $\pm 100$  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.

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de diciembre 2023 y en promedio para el cuarto trimestre de 2023 es la siguiente:

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Valor Económico (+100 pbs) (1,540) (1,439)  
Sensibilidad de Margen (-100 pbs) (215) (313)

Los Instrumentos financieros para cobrar o vender 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)  
Instrumentos financieros para cobrar o vender 1) 102,024,973,369  
Derivados de Cobertura 85,597,874,406  
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 2023 y el promedio del cuarto trimestre del 2023 fueron \$3,129 millones y \$3,097 millones, 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.

La facultad para la autorización de créditos es responsabilidad del Consejo de Administración, quien delega esta función en los distintos niveles de resolución. Estos niveles de resolución funcionan mediante facultades mancomunadas con lo cual no se permite que un solo funcionario autorice un crédito, es decir, al menos dos funcionarios deben autorizar un crédito. Los niveles de autorización se asignan de acuerdo con la clasificación del riesgo, monto del crédito, tipo de cliente y/o naturaleza de la Presentación de Crédito (tales como crédito nuevo, incremento del crédito o revisión anual).

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.

En 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, A.M. Best y DBRS, 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.

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del cuarto trimestre corresponde a \$20 millones; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.

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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 51 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

Al cierre del cuarto trimestre de 2023, el Banco mantiene \$384 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

## 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<sup>1)</sup>.

(Cifras al 31 de diciembre 2023) Pérdida

Esperada Pérdida no Esperada

Hipotecas 0.31% 3.02%

Consumo 3.82% 15.84%

Cartera Comercial 0.56% 4.13%

Total 0.69% 4.50%

1). Excluye cartera en etapa de riesgo 3.y/o en incumplimiento El cálculo incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos inter-compañía.

## Parámetros de Riesgo<sup>1)</sup>.

(Cifras a millones al 31 de diciembre 2023) EI<sup>2)</sup>. PISP

Hipotecas 213,480 1.65% 17.06%

Consumo 54,990 4.75% 72.19%

Cartera Comercial 288,594 1.47% 44.07%

1). EI (Exposición al Incumplimiento) calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en etapa de riesgo 3 o 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 2023.

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 2023 y en promedio durante el cuarto trimestre de 2023, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.42% y 0.36% 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 políticas y una evaluación 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 con la metodología aprobada por el Comité de Riesgos.

Es importante 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.

#### Cálculo del requerimiento de capital por Riesgo Operacional

La Institución calcula su requerimiento de capital por riesgo operacional a través del Método del Indicador de Negocio, mismo que entró en vigor en enero 2023.

#### Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de octubre - diciembre 2023, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$66.1 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de diciembre 2023 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$45.2 millones, donde \$3.5 millones corresponden al Riesgo Operacional y \$41.7 millones al Riesgo Legal, donde las contingencias cuentan 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 55 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 Inversoristas 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: octubre 2023 - diciembre 2023 (T4 2023)

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

	Calculo Individual T4 2023	Calculo Consolidado T4 2023
(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe ponderado (promedio)
<b>ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES</b>		
1Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	124,253.74 No aplica
<b>SALIDAS DE EFECTIVO</b>		
2Financiamiento minorista no garantizado	166,420.65	13,390.89
3Financiamiento estable	98,427.23	6,591.54
4Financiamiento menos estable	67,993.42	6,799.34
5Financiamiento mayorista no garantizado	264,979.77	96,865.03
6Depósitos operacionales	127,099.64	31,011.06
7Depósitos no operacionales	133,153.72	61,127.55
8Deuda no garantizada	4,726.42	3,726.42
9Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	500.00
10Requerimientos adicionales:	234,019.41	116,861.04
11Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,066.35	5,395.23
12Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	---	---
13Líneas de crédito y liquidez	226,953.06	11,465.81
14Otras obligaciones de financiamiento contractuales	229.65	4,522.65
15Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,857.48	2,857.48
16TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	130,704.08 No aplica
<b>ENTRADAS DE EFECTIVO</b>		
17Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	4,013.49	347.03
18Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	46,259.66	29,895.81
19Otras entradas de efectivo	17,284.71	17,284.71
20TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	67,557.86	47,557.86
Importe ajustado		
21TOTAL DE ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	124,253.74 No aplica
22TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	83,176.53 No aplica
23COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]	No aplica	149.68 No aplica

a) Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando.  
91 días naturales

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 56 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

Durante diciembre 2023, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$66,135 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$35,675 millones, 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 \$1,904 millones y \$3,129 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$11,286 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$23,040 millones y por operaciones de call money de \$3,638 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$19,946 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$122,779 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$77,238 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$34,743 millones 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 \$8,151 millones y \$2,646 millones en títulos de nivel 2.

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

Promedio del tercer trimestre 2023: 154% - promedio del cuarto trimestre 2023: 149% El coeficiente de cobertura de liquidez disminuyó 500 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$7,975 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN \$7,000 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de \$423 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en \$7,719 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en \$5,149, millones.

d) La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables ;

Evolución de Activos Líquidos T4-2023

Efectivo 6%7%7%

Reservas en el Banco Central 38%23%28%

Nivel 1 154%67%63%

Nivel 2<sup>a</sup> 2%3%2%

Nivel 2B0%0%0%

Total de Activos Líquidos Ponderados 100%100%100%

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 57 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Concentración de fuentes de Financiamiento Octubre Noviembre Diciembre

CAPTACION TRADICIONAL

Depósitos de exigibilidad inmediata 47% 50% 48%

Depósitos a plazo

Del público en general 38% 35% 36%

Mercado de dinero 7% 7% 8%

Títulos de crédito emitidos 2% 2% 2%

Cuenta global de captación sin movimientos 0% 0% 0%

PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS

De exigibilidad inmediata 0% 0% 0%

De corto plazo 4% 5% 5%

De largo plazo 2% 1% 1%

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 con las políticas establecidas.

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

- 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.
- 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.
- Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
- 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.

Exposición Potencial Futura (diciembre 2023)

(Cifras en millones de pesos)

Con contrato de compensación 3,438

Sin contrato de compensación 10,044

Posibles llamadas de margen (diciembre 2023)

Colateral en Tránsito 21

Downgrade (diciembre 2023)

Baja calificación 3 niveles 3,129

---

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de diciembre 2023 es la siguiente:

Scotiabank-Exposición en Derivados  
(cifras en millones de pesos) Posición Cierre  
Factor de Riesgo  
Tasas de interés 1,202,701  
Tipo de cambio 157,621  
Capitales 9,874  
Total 1,370,195

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.

j) El impacto en el Coeficiente de la incorporación de las Entidades Objeto de Consolidación, así como de las salidas derivadas del apoyo financiero a entidades y sociedades que formen parte del mismo grupo financiero, consorcio o grupo empresarial que, de acuerdo con las Políticas y Criterios, el consejo de administración de la Institución haya autorizado otorgar.

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el cuarto trimestre del 2023, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -5% al cierre de diciembre del 2023 y en promedio durante cuarto trimestre del 2023 fue de -5%.

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 Límite MM  
Concepto  
Concentración de Depósitos (MXN) 9,500 MXN  
Concentración de Depósitos (USD) 175 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) La exposición al riesgo liquidez y las necesidades de financiamiento a nivel de la Institución, teniendo en cuenta las limitaciones legales, regulatorias y operacionales a la transferibilidad de liquidez.

Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con las siguientes exposiciones a finales de diciembre 2023.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 60 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Descripción Promedio

T4 2023Septiembre 2023

Cash GAP 30 d - Grupo - estresado (MXN MM) 39,65736,881

Cash GAP 90 d - Grupo - estresado (MXN MM) 119,542134,722

Horizonte de Supervivencia - Banco (días) 4042

Horizonte de Supervivencia - Banco - estresado (días) 3940

Horizonte de Supervivencia - Grupo (días) 4142

Horizonte de Supervivencia - Grupo - estresado (días) 4040

c) 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 2023 y el promedio del cuarto trimestre de 2023 son:

Scotiabank Posición

(Cierre) Posición (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 79,21473,018

Liquidity Buffer

(bajo métrica CCL) 121,786117,275

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.

## 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 con 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 63 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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:

- Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
- Apegarse a los sistemas de alertas tempranas, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.
- Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.
- 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.
- Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.
- 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 2023, 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 2023, 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 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)

Periodo Reportado: cuarto trimestre del 2023

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

(Cifras en millones de pesos) Cifras Individuales Cifras Consolidadas  
Importe sin ponderar por plazo residual Importe ponderado Importe sin ponderar por plazo residual Importe ponderado  
Sin vencimiento < 6 meses De 6 meses a < 1 año > 1 año Sin vencimiento < 6 meses De 6 meses a < 1 año > 1 año

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE

1Capital:	81,249.570.000.000.0081,249.5781,249.570.000.000.0081,249.57
2Capital fundamental y capital básico no fundamental.	81,249.570.000.000.0081,249.5781,249.570.000.000.0081,249.57
3Otros instrumentos de capital.	0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00
4Depósitos minoristas:	0.00204,816.411,395.4933.53190,177.910.00204,816.411,395.4933.53190,177.91
5Depósitos estables.	0.0090,437.99635.4121.3386,541.060.0090,437.99635.4121.3386,541.06
6Depósitos menos estables.	0.00114,378.43760.0812.20103,636.850.00114,378.43760.0812.20103,636.85
7Financiamiento mayorista:	0.00393,494.9327,048.4517,126.65165,347.550.00393,494.9327,048.4517,126.65165,347.55
8Depósitos operacionales.	0.0033,139.720.000.0016,569.860.0033,139.720.000.0016,569.86

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 64 / 14  
**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

---

9Otro financiamiento mayorista.0.00360,355.2127,048.4517,126.65148,777.690.00360,355.2127,048.4517,126.65148,777.69

10Pasivos interdependientes0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000

11Otros pasivos: 0.0038,730.42701.255,229.775,580.400.0038,730.42701.255,229.775,580.40

12Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000

13Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores. 0.0038,730.42701.255,229.775,580.400.0038,730.42701.255,229.775,580.40

14Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible81,249.57637,041.7629,145.1822,389.95442,355.4381,249.57637,041.7629,145.1822,389.95442,355.43

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO

15Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica7,785.54No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica7,785.54

16Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000

17Préstamos al corriente y valores:0.00126,800.7839,630.46321,987.84354,346.360.00126,800.7839,630.46321,987.84354,346.36

18Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.0.005,293.050.000.00529.300.005,293.050.000.00529.30

19Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.0.0014,673.723,811.525,070.909,177.720.0014,673.723,811.525,070.909,177.72

20Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:0.0086,804.6432,553.80134,159.52167,067.950.0086,804.6432,553.80134,159.52167,067.95

21Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000

22Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:0.003,551.393,776.61209,243.64167,429.250.003,551.393,776.61209,243.64167,429.25

23Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.0.00480.94511.4728,442.3118,983.700.00480.94511.4728,442.3118,983.70

24Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).0.0016,958.920.001,956.0810,142.130.0016,958.920.001,956.0810,142.13

25Activos interdependientes.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000

26Otros Activos:0.0048,770.212,450.814,431.5739,891.800.0048,770.212,450.814,431.5739,891.80

27Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro. 0.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.000.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.00

28Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centralesNo Aplica1,735.010.000.001,474.76No Aplica1,735.010.000.001,474.76

29Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No Aplica0.000.000.003,211.36No Aplica0.000.000.003,211.36

30Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicialNo Aplica0.000.000.002,860.36No Aplica0.000.000.002,860.36

31Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 47,035.202,450.814,431.5732,345.320.0047,035.202,450.814,431.5732,345.32

32Operaciones fuera de balance.No Aplica226,487.980.000.0011,324.40No Aplica226,487.980.000.0011,324.40

33Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica413,348.10No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica413,348.10

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 65 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

34 Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%). No Aplica No Aplica No Aplica No Aplica  
107.02 No Aplica No Aplica No Aplica No Aplica 107.02

a) Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto y la evolución de sus principales componentes.

Durante diciembre 2023, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:

• **Fondeo Estable Disponible:**

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$183,374 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$137,188 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$85,518 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$14,552 millones y \$15,275 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$7,631 millones.

• **Fondeo Estable Requerido:**

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$353,581 millones y por operaciones mercado de dinero de \$21,130 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$14,036 millones, deducciones de capital por \$10,610 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$6,470 millones.

b) Los cambios de las principales componentes dentro del trimestre que se reporte.

Promedio del tercer trimestre del 2023: 109.03% - Promedio del cuarto trimestre del 2023: 107.02%

El coeficiente de financiamiento neto disminuyó 201pb respecto al tercer trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

a. El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 6,408 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 3,556 millones.

b. El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas incrementaron \$10,768 millones.

c) La evolución de la composición del Monto de Financiamiento Estable Disponible y del Monto de Financiamiento Estable Requerido.

Monto Computable (MXN MM)	Octubre	Noviembre	Diciembre
Financiamiento Estable Disponible	441,223	437,609	445,735
Financiamiento Estable Requerido	406,439	416,047	417,559
Coeficiente de Fondeo Estable Neto	108.56%	105.18%	106.75%

d) El impacto en el Coeficiente de Financiamiento Estable Neto de la incorporación de las entidades objeto de consolidación.

Las entidades objeto de consolidación de acuerdo con las reglas contables, y con aprobación del consejo de administración son las siguientes:

- Inmobiliaria Scotia Inverlat, S.A. de C.V.
- Scotia Servicios de Apoyo, S.A. de C.V.
- Scotia Inverlat Derivados

Derivado a que sus actividades son limitadas ya sea a posiciones de clientes, o un volumen reducido, el impacto en el CFEN es menor al 1%.

Posiciones en Acciones

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 66 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Al cierre de diciembre de 2023 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$15.56 millones de pesos, con una minusvalía de \$(0.11) millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe	Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	220,000	2.78	2.63	0.15	
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	3,232	0.37	0.38	(0.01)	
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	1,100	2.05	2.08	(0.03)	
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	5,900	4.07	4.24	(0.17)	
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	300,000	4.72	4.77	(0.05)	
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	1,200	1.57	1.57	-	
<b>Total</b>			<b>531,432.00</b>	<b>15.56</b>	<b>15.67</b>	<b>(0.11)</b>	

Al cierre del cuarto trimestre del año 2023, se reflejó una pérdida acumulada proveniente de las ventas por \$0.30 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	188,524	-	(0.04)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	500	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	35,016	0.01	(0.02)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	3,532	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	175	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	337,300	-	(0.46)	(0.46)
Scotiabank	Pública	1-GAP-B	6,000	0.13	-	0.13
Scotiabank	Pública	1-OMA-B	2,500	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	341,835	-	(1.32)	(1.32)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	508,387	0.09	(0.03)	0.06
Scotiabank	Pública	1B-NAFTRAC-ISHRS	236,000	0.13	-	0.13
Scotiabank	Pública	1A-BAC-*	495	-	-	-
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	117	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	4,503	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	3,500	0.49	-	0.49
Scotiabank	Pública	1I-MCHI-*	2,010	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	22,357	0.17	-	0.17
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	267,064	-	(0.03)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	5,265	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	12,094	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	2,118	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	161,631	0.03	(0.02)	0.01
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	98,337	-	(0.15)	(0.15)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	87,334	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-AMX-B	120,000	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1A-BABA-N	203	-	-	-
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	19	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	3,005	0.02	(0.01)	0.01
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	100	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	2,216	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	1,100	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1CF-FIBRAPL-14	1,065	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	649	-	-	-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 67 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

ScotiabankPública1-PE&OLES-*	30,000	-	(0.01)	(0.01)
ScotiabankPública1-ARA-*	90,069	-	-	-
ScotiabankPública1-GCARSO-A1	21,212	0.01	(0.03)	(0.02)
ScotiabankPública1-GMEXICO-B	47,000	0.32	-	0.32
ScotiabankPública1-LIVEPOL-C-1	20,000	0.27	-	0.27
ScotiabankPública1-PE&OLES-*	25,597	0.03	-	0.03
ScotiabankPública1-GFNORTE-O	20,000	0.11	-	0.11
ScotiabankPública1-ALPEK-A	80,000	-	(0.08)	(0.08)
ScotiabankPública1-CUERVO-*	5,000	-	-	-
ScotiabankPública1A-BABA-N	626	-	(0.05)	(0.05)
ScotiabankPública1I-SHV-*	1,200	-	(0.04)	(0.04)
ScotiabankPúblicaCF-FIBRAPL-14	24,000	0.02	-	0.02
Total	2,819,655	2.04	(2.34)	(0.30)

La posición accionaria de títulos por cobrar o vender 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	BLADDEX COM8,095	---				
Total			9,317	---			

Al 31 de diciembre de 2023, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$4.78 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$ 3.52 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.27 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición
Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital		
Por Riesgo General de Mercado	15.82-15.82	22.23%	3.52
Por riesgo específico			
Canasta de acciones,	15.82-15.82	8.00%	1.26
Índices accionarios	---	4.00%	0.01
Requerimiento por riesgos específico	---	4.00%	0.01
Total Requerimiento de capital			4.78

Anexo 1-0 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-23 dic-23

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)	755,925	789,130
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,521)	(10,610)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	745,404	778,520
	Exposiciones a instrumentos financieros derivados		
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	9,981	6,359
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	4,913	5,352

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 68 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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) (2,479) (2,626)

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)  
12,415 9,085

Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores

12 Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas 2,690 8,004

13 (Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) (2,690) (998)

14 Exposición Riesgo de Contraparte por SFT 4 11

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) 4 7,017

Otras exposiciones fuera de balance

17 Exposición fuera de balance (importe nocional bruto) 257,626 258,234

18 (Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) (183,567) (185,583)

19 Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) 74,059 72,651

Capital y exposiciones totales

20 Capital de Nivel 1 74,087 71,660

21 Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) 831,882 867,273

Coeficiente de apalancamiento

22 Coeficiente de apalancamiento de Basilea III 8.91% 8.26%

## TABLA II.1

### COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

Referencia DESCRIPCIÓN sep-23 dic-23

1	Activos totales	807,087	839,876
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	(548)	(574)
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	(36,056)	(33,657)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(2,686)	(987)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	74,059	72,651
7	Otros ajustes	(9,973)	(10,036)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	831,882	867,273

## TABLA III.1

### CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

Referencia DESCRIPCIÓN sep-23 dic-23

1	Activos totales	807,087	839,876
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(48,472)	(42,742)
3	Operaciones en reporto y préstamos de valores	(2,690)	(8,004)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 69 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 755,925 789,130

## TABLA IV.1

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

CONCEPTO/PERIODO sep-23 dic-23 Variación

Capital Básico 1) 74,087 71,660 (2,426)

Activos Ajustados 2) 831,882 867,273 35,391

Razón de Apalancamiento 3) 8.91% 8.26% -65 pb

1). Reportado en la fila 20

2). Reportado en la fila 21 y

3). Reportado en la fila 22, de la Tabla I.1

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 2023.

El indicador se ubicó en 8.26%, 65pb menor al trimestre anterior, debido al incremento en los activos ajustados por \$35,391MM o 36pb; principalmente por las exposiciones dentro del balance netas y a una disminución del capital nivel 1 por \$2,426MM o 29pb, debido principalmente a la provisión de dividendos; compensada parcialmente por 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 Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a lo establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:

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,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 70 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.

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.

5Factor 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.

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.

6No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.

7Monto de márgenes de variación en efectivo entregados 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.

8No aplica.

9No 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.

10No 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.

11Suma de las líneas 4 a 10

12Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)

13Importe 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:

- a) Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.
- b) Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.
- c) 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.
- d) 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.

El monto se debe registrar con signo negativo.

14Valor 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.

15Tratándose 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.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 71 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

entregados por el cliente a la Institución.

16 Suma de las líneas 12 a 15

17 Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.

18 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%.

El monto se debe registrar con signo negativo.

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 Explicación

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.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 72 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

propósito específico.

2El 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.

3El 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.

4No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

5Suma de las líneas 1 a 4, la cual debe coincidir con la línea 1 de la Tabla I.1

## Agencias Calificadoras

Scotiabank-Calificaciones Escala NacionalLargo plazoCorto plazoPerspectiva

Fitch RatingsAAA (mex) F1+ (mex) Estable

Standard & Poor'smxAAAmx A-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 Importe

23 de abril de 2013 \$ 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 73 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 74 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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.

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de octubre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de \$2,400'000,000.00 (Dos mil cuatrocientos millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.254768944692 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientas veinte millones trescientas mil cuatrocientos treinta y tres) 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".

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de diciembre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de \$2,000'000,000.00 (Dos mil millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.212307453910 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientos veinte millones trescientos mil cuatrocientos treinta y tres) 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 "Resultado de Ejercicios Anteriores".

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 8 de febrero del 2023, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de \$2,850,000,000.00 (Dos mil ochocientos cincuenta millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.302538121822 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientos veinte millones trescientos mil cuatrocientos treinta y tres) 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 "Resultado de Ejercicios Anteriores".

El 31 de mayo de 2023, la Asamblea General Ordinaria de Accionistas acordó decretar dividendos provenientes de utilidades retenidas por la cantidad de \$5,000 a razón de \$0.530768634776 por acción, mismos que fueron provisionados y registrados en el rubro

---

de "Acreedores diversos y cuentas por pagar" y fueron pagados el 26 de enero 2024.

#### Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de diciembre del 2023, 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\$99,112 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$50,552 millones de pesos.

#### Adicionalmente:

- Se cuenta con líneas comprometidas con Instituciones Extranjeras por USD \$250 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 2023, 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 con 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 Riesgos 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.

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 la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura", en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las 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	Condición de Mercado
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 o Bonos 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)
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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 78 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

(pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

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

Subyacente\*FuturosOpcionesSwaps

MRMEMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, 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 nominales, 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 (Swaps) en especie y por diferenciales.

1). Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (CurrencySwaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (ForwardStarting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.

2). (MR) Mercados reconocidos

3). (ME) Mercados extrabursátiles

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.

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 Algortihmics 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 2023 y en promedio para el cuarto trimestre de 2023 es de:

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 79,21473,018

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 121,786117,275

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 80 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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/Peak & Wall Street).

Instrumentos valuados a valor razonable

Product Name Underlying Product Currency Valuation Model Valuation Input Daily Pricing Source  
Cross Currency Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD, EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER  
FX Rate VALMER  
Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD, EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER  
Interest Rate Cap/Floor (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest Rate Curve VALMER  
Surface Bloomberg/Reuters  
OTC Binary Interest rate Option (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest Rate Curve VALMER  
Surface Bloomberg/Reuters  
IRS Futures TIIE Fondeo MXN Price Price VALMER  
Listed Interest Rate Swap (CME) TIIE Fondeo MXN Swap Interest Rate Curve VALMER  
OTC European Index Call Spread Option OTC European Index Call Spread Option MXN, CAD, USD, EUR, JPY Call Spread Option Curve VALMER  
Price K2  
Surface Trader's mark  
Correlation  
Dividend  
OTC European Basket Option Equity Index, Common Stock MXN, CAD, USD, EUR, JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-Factor Curve VALMER  
Price K2  
Surface Trader's mark  
Correlation  
Dividend  
OTC European Equity Option Common Stock, Equity Index, ETF and Bond Index with Target Volatility (Vol Under 15%) MXN, CAD, USD, EUR, JPY Equity Option Curve VALMER  
Price K2  
Surface Trader's mark  
Correlation  
Dividend  
OTC Index Binary Equity Option Common Stock, Equity Index, ETF MXN, CAD, USD, EUR, JPY Equity Option Curve VALMER  
Price K2  
Surface Trader's mark  
Correlation  
Dividend

Product Name Underlying Product Currency Valuation Model Valuation Input Daily Pricing

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 81 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Source

OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

Bond Futures(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVVALMER

Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVVALMER

Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVVALMER

Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVVALMER

Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVVALMER

Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVVALMER

FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,

MXN,PEN,AUD,EUR,

JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVVALMER

OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER

FX Rate

Surface

Precious Metals European OptionGold/Silver BullionGold/Silver Black 76CurveVALMER

Price

SurfaceBloomberg/Reuters

Precious Metals ForwardGold/Silver BullionGold/Silver Forward OTC ModelCurveVALMER

Price

Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,

BRL,CLP,COP,PEN,

AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

Instrumentos valuados a costo

Product NameUnderlyingProduct CurrencyValuation ModelValuation InputDaily Pricing

Source

Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,

EUR,JPY PricePriceVALMER

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 82 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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.

#### 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.

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 con base en un análisis de regresión.

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 del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

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

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 el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de diciembre 2023 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el cuarto trimestre de 2023 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 actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

Cobertura de Flujos de efectivo:

La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de "Otro Resultado Integral" (ORI) y cualquier ganancia o pérdida remanente debe tratarse como ineffectividad de cobertura y reconocerse de inmediato en la utilidad o pérdida neta.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 86 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

El componente que forma parte de "Otro Resultado 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 en los 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 cubiertos 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 2023 y promedio del cuarto trimestre 2023 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 121,786,117,275

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 87 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

Parámetro Descripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

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 79,21476,08476,08276,080

Cambios en el Gap respecto al escenario normal (3,130) (3,132) (3,134)

d. 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 Black & Scholes.

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  $\gamma_{1\%}$  y  $\gamma_{5\%}$ .

$\gamma_{1\%}$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que  $\gamma_{5\%}$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio 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 portafolio 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 portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

#### Rho

Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio 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 portafolio 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 portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.

#### Theta

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 89 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio 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, 2023:

#### Scotiabank

	0 - 3 Años	3 - 5 Años	5 - 10 Años	10 - 30 Años	Total
Swaps	(54,553.88)	4,533.34	(4,476.53)	(1,289.01)	(55,786.08)
CCS	13,447.78	71.44	(131.67)	0.05	13,387.60
Caps&Floors	(0.03)	---	(0.03)		
Binary Caps&Floors	-----				
TIIE Futures	-----				
Mbonds Futures	-----				
Total DERIVADOS	(41,106.13)	4,604.78	(4,608.20)	(1,288.96)	(42,398.51)

1).Cifras expresadas en pesos

#### Análisis de sensibilidad

#### Supuestos de Cálculo.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, 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:

- a) Bajo el escenario probable una pérdida de (34.36) Millones de pesos.
- b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (68.72) Millones de pesos.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 90 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (169.69) Millones de pesos.

Los escenarios de stress 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.

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 TIIE

y Bono M - - 50.00 - 100.00 - 200.00 -

- 1pb a la tasa IRS & CCS & Delta Caps (0.04) (49.43) 50.00 (2.12) 100.00 (4.24) 200.00 (8.48)

Volatilidad al 1% Caps & Floors (0.03) (0.59) 0.10 - 0.40 (0.01) 1.00 (0.03)

a FX %Forwards 17.93322.360.10 (32.24) 0.20 (64.47) 0.50 (161.18)

a FX %Opciones Divisa - - 0.10 - 0.20 - 0.50 -

Total (34.36) (68.72) (169.69)

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 2023 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones Delta Vega Gamma

Options AAPL.OQ---

Options AMZN.OQ---

Options BNPUI5.INDX 457,120.00 11,582.00 117,965.00

Options EEM.P---

Options ENHFO5.INDX---

Options ENHGE5.INDX---

Options FXI.P---

Options GOOG.OQ---

Options ICLN.OQ---

Options IDBTV1.INDX 1,635.00 64.00 364.00

Options META.OQ---

Options MEXIPC.INDX---

Options MSFDV1.INDX---

Options QQQ.OQ---

Options SHELL.AS---

Options SOXX.OQ---

Options SPX.INDX---

Options SPXFP.INDX---

Options SPXSR5.INDX---

Options VLO.N---

TOTAL 458,755.00 11,646.00 118,329.00

1). Cifras expresadas en pesos

Análisis de Stress

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 91 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 AAPL.OQ---  
Options AMZN.OQ---  
Options BNPUI5.INDX(45,712.00) (137,136.00) (228,560.00)  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX(163.5) (490.5) (817.5)  
Options META.OQ---  
Options MEXIPC.INDX---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SHELL.AS---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPX.INDX---  
Options SPXFP.INDX---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
TOTAL(45,875.50) (137,626.50) (229,377.50)  
1).Cifras expresadas en pesos

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

Escenarios al alza(0.1) (0.3) (0.5)  
Options AAPL.OQ---  
Options AMZN.OQ---  
Options BNPUI5.INDX22,856.0068,568.0091,424.00  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX81.75245.25327.00  
Options META.OQ---  
Options MEXIPC.INDX---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SHELL.AS---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPX.INDX---  
Options SPXFP.INDX---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
TOTAL22,937.7568,813.2591,751.00

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 92 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

1). Cifras expresadas en pesos

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:

ScotiabankMonto

Probable(45,875.50)

Poco Probable(137,626.50)

Muy poco Probable(229,377.50)

1).Cifras expresadas en pesos

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 2023 se tienen los siguientes saldos:

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado

CLIENTE 1USD- (1,070,000)

CLIENTE 2MXN375,000,000 (639,000,000)

CLIENTE 3USD595,000-

CLIENTE 4USD5,830,000-

CLIENTE 5MXN43,905,000 (126,340,000)

CLIENTE 6MXN10,700,000 (23,300,000)

CLIENTE 7USD10,625,000 (16,500,000)

CLIENTE 8MXN145,503,132 (2,254,357,869)

CLIENTE 9USD29,940,000 (41,210,000)

CLIENTE 10USD35,760,000 (24,570,000)

CLIENTE 11USD130,900,000 (830,000,000)

CLIENTE 12USD280,000-

CLIENTE 13USD17,790,000 (3,840,000)

CLIENTE 14USD23,650,000 (35,560,000)

CLIENTE 15USD- (250,000)

CLIENTE 16MXN74,000,000 (222,400,000)

CLIENTE 17MXN121,400,000 (350,000,000)

CLIENTE 18USD91,100,000 (52,940,000)

CLIENTE 19MXN214,900,000 (419,500,000)

CLIENTE 20MXN565,567,142 (366,930,007)

CLIENTE 21MXN1,200,000-

CLIENTE 22USD5,110,000 (11,420,000)

CLIENTE 23MXN18,000,000-

CLIENTE 24USD8,280,000 (12,230,000)

CLIENTE 25USD- (2,180,000)

CLIENTE 26MXN- (35,566,000)

CLIENTE 27USD1,990,000 (510,000)

CLIENTE 28USD21,990,000 (9,010,000)

TOTAL 1,954,015,274 (5,478,683,876)

1).Cifras expresadas en pesos

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 93 / 14

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 94 / 14

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 95 / 14

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 96 / 14

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 97 / 14

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 98 / 14

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Liquidados anticipadamente

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

Producto	Fecha de evento	Contraparte
/Cliente	Divisa	Monto a liquidar
P1917102/10/2023	Cliente	1USD65,136
COLATERAL03/10/2023	Cliente	2USD1,460,000
202310120313516/10/2023	Cliente	3MXN99,226
SJS58318/10/2023	Cliente	4USD2,670
SX653930/10/2023	Cliente	5MXN(1,282,047)
SAK05530/10/2023	Cliente	6MXN(862,564)
202311030379810/11/2023	Cliente	7USD1,100,000
P1801517/11/2023	Cliente	8MXN24,656
COLATERAL24/11/2023	Cliente	9USD1,520,000
SAK05528/11/2023	Cliente	10MXN(776,784)
SX653929/11/2023	Cliente	11MXN(1,234,177)
210274314/12/2023	Cliente	12MXN672,000
211135415/12/2023	Cliente	13MXN109,575
E8795618/12/2023	Cliente	14MXN337,150
SHH60618/12/2023	Cliente	15USD104,897
P1801518/12/2023	Cliente	16MXN24,557
SIM80527/12/2023	Cliente	17USD119
202311170375428/12/2023	Cliente	18MXN5,222,700
SAK05528/12/2023	Cliente	19MXN(796,942)
SX653928/12/2023	Cliente	20MXN(1,223,883)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 99 / 14  
**CONSOLIDADO**  
Impresión Final

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos

ANEXO 1

Anexo - Desglose de créditos Moneda nacional [miembro] Moneda nacional [miembro] Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro]

Acumulado Actual  
(Cifras en pesos)

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
Tipo de Crédito / Institución Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]

Desglose de créditos [partidas]  
Bancarios [sinopsis]

TOTAL - - - - - - - - - - - - - -  
Con garantía (bancarios)

TOTAL - - - - - - - - - - - - - -  
Banca comercial

Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 30/05/2023 30/05/2024 5.38822 + 0.66 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 2,132,226,969.94

Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 17/08/2023 17/05/2024 5.36937 + 0.5 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,709,107,906.63

Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 30/11/2023 30/08/2024 5.36938 + 0.44 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,279,066,028.45

Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 22/12/2023 23/12/2024 5.37106 + 0.48 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,699,417,572.07

Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 22/12/2023 22/11/2024 5.37106 + 0.48 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,699,417,572.07

TOTAL - - - - - - - - 8,519,236,049.16 - - - -

Otros bancarios

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No 20/03/2020 20/02/2024 11.5041 + 0.43 SPREAD / VARIABLE MXN TIIIE 28D EOM 2,526,520,180.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No 20/03/2020 20/03/2024 11.5041 + 0.43 SPREAD / VARIABLE MXN TIIIE 28D EOM 2,526,520,180.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No 19/11/2019 19/11/2024 11.5041 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN TIIIE 28D EOM 2,526,342,402.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No 19/11/2019 19/09/2024 11.5041 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN TIIIE 28D EOM 2,526,342,402.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No 25/11/2019 25/07/2024 11.5041 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN TIIIE 28D EOM 2,526,342,402.78

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 100 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202331/08/202411.5041 + 0.37 SPREAD / VARIABLE MXN  
TIIE 28D EOM 2,526,386,847.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202331/08/202411.5041 + 0.37 SPREAD / VARIABLE MXN  
TIIE 28D EOM 2,526,386,847.22

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo14/12/201702/12/20278.48 + 0  
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,005,888,888.89

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo23/04/201814/04/20258.41 + 0  
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,017,988,055.56

FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo31/05/202201/01/20248.23  
Tasa Fija 1,797,848.29

FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo31/05/202201/01/20258.23  
Tasa Fija 489,983.11

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202229/01/20278.07 Tasa  
Fija 47,576,949.88

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa  
Fija 61,892,650.28

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa  
Fija 11,108,727.60

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa  
Fija 27,462,582.46

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa  
Fija 6,537,825.16

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa  
Fija 55,354,825.12

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202220/12/20287.4 Tasa  
Fija 24,672,416.24

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/03/202231/08/202512.735  
Tasa Fija 17,753,782.79

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202217/04/202611.754  
Tasa Fija 8,636,502.62

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202203/06/202711.774  
Tasa Fija 14,128,205.84

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202206/06/202511.7338  
Tasa Fija 39,218,449.27

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202205/07/202711.7751  
Tasa Fija 18,074,894.52

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.98694  
Tasa Fija 6,994,888.24

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.98694  
Tasa Fija 7,741,916.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202215/02/202411.6543  
Tasa Fija 178,756.15

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/202215/09/202611.7543  
Tasa Fija 4,147,896.40

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7725  
Tasa Fija 127,307,044.66

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7725  
Tasa Fija 4,960,014.67

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7725  
Tasa Fija 99,200,294.42

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202215/10/202711.774  
Tasa Fija 136,649,930.83

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202211/10/202711.756  
Tasa Fija 22,296,863.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 101 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202216/12/202211.37 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202216/12/202211.3957 Tasa Fija  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202223/10/20265.80595  
Tasa Fija 59,984,321.31  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa  
Fija 5,526,919.10  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa  
Fija 19,061,702.50  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa  
Fija 51,122,313.82  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202218/12/202611.7525  
Tasa Fija 9,035,257.50  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202323/01/202511.7041  
Tasa Fija 10,104,036.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202313/02/202511.7041  
Tasa Fija 14,145,651.02  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202314/02/202511.7041  
Tasa Fija 10,104,036.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202321/05/202411.6041  
Tasa Fija 10,103,147.56  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202315/02/202411.6043  
Tasa Fija 4,021,919.23  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202318/01/202411.604  
Tasa Fija 3,013,538.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/02/202312/01/202411.6075  
Tasa Fija 1,099,005.74  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202322/05/202411.6041  
Tasa Fija 14,144,406.58  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202324/05/202411.6041  
Tasa Fija 11,113,462.31  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202317/05/202411.6041  
Tasa Fija 10,103,147.56  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/03/202315/05/202411.6041  
Tasa Fija 10,103,147.56  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202331/03/20286.19835  
Tasa Fija 65,125,907.94  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202310/05/202411.6041  
Tasa Fija 9,092,832.80  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202313/05/202411.6041  
Tasa Fija 9,092,832.80  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/05/202314/05/202711.7543  
Tasa Fija 1,030,689.41  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202331/05/20285.86835  
Tasa Fija 13,830,904.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202325/05/20275.86595  
Tasa Fija 57,562,860.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202303/01/202411.604  
Tasa Fija 4,036,101.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202304/01/202411.604  
Tasa Fija 3,027,076.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202331/05/202411.6041  
Tasa Fija 25,256,537.29

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 102 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202330/03/20285.96822  
Tasa Fija 107,934,854.39  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/06/202315/06/202711.7543  
Tasa Fija 6,349,046.77  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/202315/06/202811.7743  
Tasa Fija 33,940,315.18  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/06/202315/01/202411.6043  
Tasa Fija 2,046,151.41  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202320/06/202511.7025  
Tasa Fija 18,064,363.77  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202328/06/202411.6041  
Tasa Fija 35,361,016.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/07/202315/03/202411.6043  
Tasa Fija 3,016,439.43  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202331/01/20245.56835  
Tasa Fija 25,453,859.83  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202306/07/202810.1 Tasa  
Fija 8,621,903.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294 Tasa Fija 240,921.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294 Tasa Fija 3,770.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294 Tasa Fija 86,516.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294 Tasa Fija 30,080.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294 Tasa Fija 21,611.73  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202302/01/202413.3403 Tasa Fija 24,576.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202302/01/202413.33 Tasa Fija 37,282.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202305/01/202413.3366 Tasa Fija 977,904.48  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202304/01/202413.3115 Tasa Fija 762,386.76  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202309/01/202413.3115 Tasa Fija 13,526.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202312/01/202413.3057 Tasa Fija 1,572,113.06  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202306/07/202810.24 Tasa  
Fija 6,264,657.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202312/01/20245.49978  
Tasa Fija 85,091,747.61  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202322/06/20275.65595  
Tasa Fija 39,353,759.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202302/01/202413.3147 Tasa Fija 11,762.52  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/202316/06/202811.7541  
Tasa Fija 120,522,478.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202309/01/202413.3142 Tasa Fija 5,019.03  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202316/01/202413.3142 Tasa Fija 10,747,577.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/07/202315/02/202411.6043  
Tasa Fija 2,046,151.41  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202316/01/202413.3201 Tasa Fija 517,853.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202316/01/202413.3201 Tasa Fija 12,675.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202316/01/202413.3201 Tasa Fija 292,940.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202309/01/202413.3201 Tasa Fija 220,605.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202311/01/202413.3201 Tasa Fija 2,129,953.82  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202308/01/20245.61193  
Tasa Fija 17,586,228.88  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/07/202318/01/202411.604  
Tasa Fija 1,001,934.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/07/202309/01/202413.3144 Tasa Fija 68,204.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/07/202311/01/202413.3144 Tasa Fija 1,193,441.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/07/202319/01/202413.3144 Tasa Fija 1,059,543.51  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/202319/01/202411.604  
Tasa Fija 2,008,380.67

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 103 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/07/202308/01/202413.3084 Tasa Fija 1,292,427.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/07/202309/01/202413.3084 Tasa Fija 128,216.45  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/07/202316/01/202413.3084 Tasa Fija 16,209.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/07/202316/01/202413.3054 Tasa Fija 146,864.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/07/202322/01/202411.6025  
Tasa Fija 5,016,114.58  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/07/202329/06/202811.7541  
Tasa Fija 152,048,379.11  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/07/202323/01/202411.6037  
Tasa Fija 5,009,669.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/07/202324/01/202411.6037  
Tasa Fija 5,009,669.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202323/01/202413.314 Tasa Fija 373,616.29  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202323/01/202413.314 Tasa Fija 8,238.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202323/01/202413.314 Tasa Fija 54,702.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202318/01/202413.314 Tasa Fija 8,201,195.64  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/07/202325/01/202411.6037  
Tasa Fija 5,009,669.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202319/01/202413.3305 Tasa Fija 1,210,677.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202324/01/202413.3305 Tasa Fija 8,772,349.19  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202327/02/202411.604  
Tasa Fija 1,151,482.73  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202326/01/202411.6037  
Tasa Fija 5,009,669.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202326/01/202411.6037  
Tasa Fija 2,003,867.90  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/08/202329/01/202411.6035  
Tasa Fija 9,008,702.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/08/202309/01/202413.3105 Tasa Fija 211,240.16  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/08/202330/01/202411.6041  
Tasa Fija 9,092,832.80  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/08/202323/01/202413.3053 Tasa Fija 98,340.29  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/08/202331/01/202411.6041  
Tasa Fija 9,092,832.80  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/08/202330/01/202413.305 Tasa Fija 710,000.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/08/202325/01/202413.305 Tasa Fija 14,047.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/08/202325/01/202413.305 Tasa Fija 7,616,973.87  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/202301/02/202411.6033  
Tasa Fija 9,089,925.58  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/08/202302/02/202411.604  
Tasa Fija 9,081,228.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202315/01/202413.3114 Tasa Fija 1,295,894.46  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202305/01/202413.3114 Tasa Fija 51,828.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202305/01/202413.3114 Tasa Fija 280,662.43  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202312/01/202413.3317 Tasa Fija 256,048.55  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/08/202302/02/202411.604  
Tasa Fija 9,081,228.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/08/202306/02/202411.6038  
Tasa Fija 9,075,424.70  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202330/01/202413.3087 Tasa Fija 82,987.70  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202305/01/202413.3087 Tasa Fija 58,988.49  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202305/01/202413.3087 Tasa Fija 225,163.96  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/08/202307/03/202411.6041  
Tasa Fija 121,237,770.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/08/202307/02/202411.604  
Tasa Fija 9,072,525.00

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 104 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/08/202305/01/202413.3086	Tasa Fija	912,352.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/08/202301/02/202413.3086	Tasa Fija	3,254,911.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/08/202305/01/202413.3086	Tasa Fija	2,490,707.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/08/202301/02/202413.3086	Tasa Fija	2,902,572.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/08/202308/02/202411.604	Tasa Fija	9,069,624.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/08/202305/01/202413.3162	Tasa Fija	545,296.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/08/202305/01/202413.3162	Tasa Fija	563,228.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/08/202305/01/202413.3162	Tasa Fija	98,046.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/202309/02/202411.606	Tasa Fija	9,060,931.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/08/202305/01/202413.3313	Tasa Fija	339,514.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/08/202306/02/202413.3313	Tasa Fija	17,746.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/08/202306/02/202413.3313	Tasa Fija	1,204,506.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/202312/03/20245.53835	Tasa Fija	42,423,064.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/08/202312/02/202411.6075	Tasa Fija	8,049,009.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/08/202305/01/202413.3482	Tasa Fija	59,870.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202305/01/202413.3535	Tasa Fija	23,622.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202312/01/202413.3535	Tasa Fija	114,002.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/202314/03/202411.606	Tasa Fija	6,034,818.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202305/01/202413.3526	Tasa Fija	55,758.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202308/02/202413.3526	Tasa Fija	4,479,467.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202305/01/202413.3526	Tasa Fija	205,042.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202308/02/202413.3526	Tasa Fija	4,063,281.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202305/01/202413.3589	Tasa Fija	185,766.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202309/01/202413.3589	Tasa Fija	194,748.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202305/01/202413.3589	Tasa Fija	29,540.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/08/202312/02/202413.3635	Tasa Fija	645,282.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202301/07/202711.7333	Tasa Fija	4,620,687.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/08/202305/01/202413.3814	Tasa Fija	135,477.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/08/202305/01/202413.3814	Tasa Fija	91,991.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/08/202301/02/202413.3618	Tasa Fija	506,608.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/08/202305/01/202413.3618	Tasa Fija	1,259,632.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202315/02/202413.332	Tasa Fija	2,018,739.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202305/01/202413.332	Tasa Fija	956,871.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202315/02/202413.332	Tasa Fija	3,293,196.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202305/01/202413.332	Tasa Fija	34,166.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202305/01/202413.332	Tasa Fija	125,764.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202325/08/20285.72444	Tasa Fija	82,796,767.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202305/01/202413.3669	Tasa Fija	1,366,336.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202323/01/202413.3669	Tasa Fija	130,323.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/08/202323/02/20245.59151	Tasa Fija	26,025,931.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202305/01/202413.349	Tasa Fija	814,228.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202305/01/202413.349	Tasa Fija	806,910.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/08/202323/02/202411.6041	Tasa Fija	8,587,675.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/08/202323/02/202411.6041	Tasa Fija	5,051,573.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/08/202326/02/202411.6041	Tasa Fija	15,154,721.33

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 105 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202305/01/202413.3598	Tasa Fija	9,879.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202305/01/202413.3598	Tasa Fija	15,505.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202305/01/202413.3598	Tasa Fija	29,971.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202305/01/202413.3598	Tasa Fija	14,433.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202323/01/202413.3598	Tasa Fija	114,595.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202326/02/202413.3598	Tasa Fija	1,035,556.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/08/202326/02/202411.6041	Tasa Fija	5,051,573.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/07/202315/01/202511.6543	Tasa Fija	726,769.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202305/01/202413.3563	Tasa Fija	149,766.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202318/01/202413.3563	Tasa Fija	249,248.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/08/202327/02/202411.6041	Tasa Fija	11,618,619.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202305/01/202413.3563	Tasa Fija	213,345.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/08/202331/08/20285.64835	Tasa Fija	11,339,436.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202305/01/202413.3563	Tasa Fija	154,681.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202325/01/202413.3563	Tasa Fija	114,514.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202327/02/202411.6041	Tasa Fija	5,051,573.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202327/02/202411.6041	Tasa Fija	5,051,573.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202322/02/202413.3532	Tasa Fija	6,255,546.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/09/202328/02/202411.6041	Tasa Fija	5,051,573.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/09/202301/03/202411.6033	Tasa Fija	5,049,958.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/09/202301/03/202411.6033	Tasa Fija	2,524,979.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202323/01/202413.3643	Tasa Fija	152,786.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	1,717,667.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	1,956,129.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	6,609.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/09/202303/01/202411.604	Tasa Fija	10,090,253.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/09/202301/03/202411.6041	Tasa Fija	5,051,573.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/09/202304/03/202411.604	Tasa Fija	2,522,563.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/09/202309/01/202413.3643	Tasa Fija	116,034.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	1,422,938.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	5,680.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/09/202304/03/20245.57938	Tasa Fija	8,098,964.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/09/202304/03/202411.6041	Tasa Fija	5,051,573.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	39,716.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	128,470.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	148,294.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	12,342.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/09/202305/03/202411.6051	Tasa Fija	2,521,759.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202303/01/202412.7537	Tasa Fija	63,431.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	1,809,980.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	46,766.92

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 106 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202322/02/202413.375 Tasa Fija 2,670,836.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202305/01/202411.6051  
Tasa Fija 15,130,557.38  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202306/03/202411.6038  
Tasa Fija 1,705,171.46  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202305/01/202411.6051  
Tasa Fija 1,008,703.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543 Tasa Fija 336,149.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543 Tasa Fija 23,817.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543 Tasa Fija 10,121.79  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202322/02/202413.383 Tasa Fija 6,166,368.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202302/01/202412.7543 Tasa Fija 2,073.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543 Tasa Fija 141,938.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543 Tasa Fija 47,826.39  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202306/03/202411.6041  
Tasa Fija 5,051,573.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202304/01/202412.7543 Tasa Fija 311,049.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202302/01/202412.7543 Tasa Fija 435,784.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202302/01/202412.7543 Tasa Fija 269,597.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543 Tasa Fija 87,435.17  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202306/03/202411.6041  
Tasa Fija 5,051,573.78  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202305/01/202411.6041  
Tasa Fija 1,515,472.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202329/02/202413.383 Tasa Fija 5,071,881.53  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202306/03/202411.6038  
Tasa Fija 10,083,805.22  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/202307/03/202411.604  
Tasa Fija 2,464,702.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202302/01/202412.7572 Tasa Fija 16,551.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202302/01/202412.7572 Tasa Fija 872,655.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202302/01/202412.7572 Tasa Fija 1,297,377.60  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202305/01/202412.7572 Tasa Fija 520,839.86  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/202307/03/202411.6041  
Tasa Fija 5,051,573.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202305/01/202412.7572 Tasa Fija 15,788.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202305/01/202412.7572 Tasa Fija 242,234.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202305/01/202412.7572 Tasa Fija 27,924.03  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202308/03/202411.604  
Tasa Fija 2,519,340.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755 Tasa Fija 101,316.73  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755 Tasa Fija 53,330.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755 Tasa Fija 15,210.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755 Tasa Fija 5,580.29  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202309/02/202413.3783 Tasa Fija 351,156.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755 Tasa Fija 7,794.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755 Tasa Fija 38,918.87  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202309/01/202412.255 Tasa Fija 12,911,296.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755 Tasa Fija 51,851.96  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202308/03/202411.6041  
Tasa Fija 5,051,573.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202305/01/202412.7525 Tasa Fija 26,100.46  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202305/01/202412.7525 Tasa Fija 31,896.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202306/02/202413.3855 Tasa Fija 839,127.86  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/09/202311/03/202411.606  
Tasa Fija 2,516,925.42

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 107 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	1,938,442.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202306/02/202413.3855	Tasa Fija	3,145,344.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202312/03/202411.6075	Tasa Fija	2,465,009.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	44,936.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	260,621.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	25,007.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202323/02/202413.3879	Tasa Fija	301,615.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202306/02/202413.3879	Tasa Fija	8,474.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202306/02/202413.3879	Tasa Fija	456,478.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202303/01/202412.7569	Tasa Fija	20,670.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	6,253.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	95,003.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	75,195.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202306/02/202413.3879	Tasa Fija	130,399.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202313/03/202411.6043	Tasa Fija	2,393,041.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202310/01/202412.7585	Tasa Fija	140,501.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202305/01/202412.7585	Tasa Fija	132,535.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202305/01/202412.7585	Tasa Fija	9,219.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202306/02/202413.3756	Tasa Fija	102,065.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202312/01/202411.6041	Tasa Fija	1,262,893.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202306/02/202413.3756	Tasa Fija	1,193,982.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202306/02/202413.3756	Tasa Fija	30,185.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202305/01/202412.7585	Tasa Fija	22,653.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202308/01/202412.7585	Tasa Fija	89,625.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202306/02/202413.3756	Tasa Fija	489,527.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202307/03/202413.3756	Tasa Fija	5,255,206.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202313/03/202411.6075	Tasa Fija	15,091,892.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202314/03/202411.6043	Tasa Fija	2,514,505.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202312/03/202411.6075	Tasa Fija	9,256,360.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202315/03/202411.6043	Tasa Fija	27,147,954.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202310/01/202412.7525	Tasa Fija	261,890.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	568,180.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202308/01/202412.7525	Tasa Fija	493,943.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	1,661,299.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	170,480.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	14,466.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202301/02/202413.3801	Tasa Fija	25,041.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202316/01/202411.6041	Tasa Fija	1,262,893.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202308/01/202412.7525	Tasa Fija	4,431.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202308/01/202412.7525	Tasa Fija	149,613.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	12,914.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	788,791.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/09/202313/03/202411.6075	Tasa Fija	9,256,360.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202312/01/202412.7525	Tasa Fija	667,883.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202308/01/202412.7525	Tasa Fija	1,108,128.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	72,197.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202306/02/202413.3745	Tasa Fija	657,324.35

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 108 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/09/202317/01/202411.6041  
Tasa Fija 1,515,472.13

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/09/202315/03/202411.6043  
Tasa Fija 1,508,219.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202305/01/202412.7525 Tasa Fija 138,791.58

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202309/02/202413.3745 Tasa Fija 114,622.73

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202306/02/202413.3745 Tasa Fija 26,660.84

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/09/202312/09/202411.6075  
Tasa Fija 5,030,630.90

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/202315/03/202411.6043  
Tasa Fija 1,583,630.70

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/202318/01/202411.6041  
Tasa Fija 2,020,629.51

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/202314/03/202411.606  
Tasa Fija 9,253,387.60

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202316/01/202412.7563 Tasa Fija 354,908.32

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202308/01/202412.7563 Tasa Fija 326,391.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202305/01/202412.7563 Tasa Fija 654,195.82

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202309/02/202413.3809 Tasa Fija 195,839.46

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202305/01/202412.7563 Tasa Fija 216,101.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202305/01/202412.7563 Tasa Fija 65,719.24

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202315/03/202411.6043  
Tasa Fija 9,250,414.24

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202319/03/202411.604  
Tasa Fija 1,757,333.08

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202319/01/202411.6041  
Tasa Fija 2,020,629.51

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202312/01/202412.7575 Tasa Fija 275,432.69

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575 Tasa Fija 2,759.08

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575 Tasa Fija 650,768.06

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575 Tasa Fija 489,973.04

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575 Tasa Fija 226,455.72

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202306/02/202413.3915 Tasa Fija 96,731.48

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202312/01/202412.7575 Tasa Fija 327,883.59

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202308/01/202412.7575 Tasa Fija 17,195.67

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575 Tasa Fija 59,272.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202308/01/202412.7575 Tasa Fija 27,177.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575 Tasa Fija 187,530.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575 Tasa Fija 132,241.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202317/01/202412.7575 Tasa Fija 77,751.22

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202320/03/202411.6025  
Tasa Fija 1,756,768.13

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202319/01/202412.7612 Tasa Fija 48,868.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202318/01/202412.7612 Tasa Fija 388,830.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202302/01/202412.7612 Tasa Fija 119,596.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612 Tasa Fija 490,327.83

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612 Tasa Fija 14,363.28

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028 Tasa Fija 101,413.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028 Tasa Fija 141,517.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612 Tasa Fija 26,449.54

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612 Tasa Fija 132,006.18

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202316/02/202413.4028 Tasa Fija 168,818.39

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028 Tasa Fija 1,057,845.51

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028 Tasa Fija 438,425.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202312/01/202412.7612 Tasa Fija 88,078.46

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/09/202315/01/202412.7612 Tasa Fija 486,764.03

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 109 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612	Tasa Fija	471,189.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202315/01/202412.7612	Tasa Fija	78,697.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202314/03/202413.4028	Tasa Fija	2,217,262.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	135,705.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	39,066.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	40,497.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/09/202321/03/202411.6025			
Tasa Fija			1,756,204.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202315/01/202412.7581	Tasa Fija	1,918,834.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202305/01/202412.7581	Tasa Fija	1,682,561.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202315/01/202412.7581	Tasa Fija	569,897.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202305/01/202412.7581	Tasa Fija	152,245.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202305/01/202412.7581	Tasa Fija	57,502.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202315/03/202413.4134	Tasa Fija	118,472.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202326/02/202413.4134	Tasa Fija	420,824.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202314/03/202413.4134	Tasa Fija	2,270,946.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202306/02/202413.4134	Tasa Fija	466,026.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202315/01/202412.7581	Tasa Fija	31,519.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202305/01/202412.7581	Tasa Fija	55,189.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/09/202315/09/202711.7543			
Tasa Fija			1,689,266.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/09/202322/03/202411.6025			
Tasa Fija			1,755,640.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202304/03/202413.4152	Tasa Fija	1,170,460.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202305/01/202412.754	Tasa Fija	227,797.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202305/01/202412.754	Tasa Fija	52,873.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202305/01/202412.754	Tasa Fija	42,193.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202316/02/202413.4152	Tasa Fija	103,142.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202315/02/202413.4152	Tasa Fija	140,073.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202306/02/202413.4152	Tasa Fija	494,472.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202306/02/202413.4152	Tasa Fija	31,911.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202308/03/202413.4152	Tasa Fija	114,619.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/09/202323/04/202411.6037			
Tasa Fija			50,096,697.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/202325/03/202411.6037			
Tasa Fija			1,753,384.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/202325/03/202411.6037			
Tasa Fija			1,502,900.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/09/202302/01/202412.752	Tasa Fija	15,043.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/09/202306/02/202413.4306	Tasa Fija	1,825,518.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/09/202306/02/202413.4306	Tasa Fija	46,159.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/09/202305/01/202412.752	Tasa Fija	67,928.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/09/202305/01/202412.752	Tasa Fija	17,484.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/09/202306/02/202413.4306	Tasa Fija	23,463.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/09/202306/02/202413.4306	Tasa Fija	308,183.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202315/01/20246.86327	Tasa Fija	59,873.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202326/03/202411.6037			
Tasa Fija			1,753,384.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202326/03/202411.6037			
Tasa Fija			1,753,384.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202317/01/202412.7583	Tasa Fija	6,031.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	593,393.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	1,013,365.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	103,584.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202322/03/202413.4397	Tasa Fija	2,164,344.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202314/02/202413.4397	Tasa Fija	52,773.22

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 110 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202304/03/202413.4397	Tasa Fija	326,171.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202314/03/202413.4397	Tasa Fija	3,694,667.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	46,172.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	49,863.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	10,035.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	2,611.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	69,786.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	2,364.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	13,566.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	7,385.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202331/07/202411.6041	Tasa Fija	36,738,718.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202315/03/202413.4397	Tasa Fija	123,099.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	57,492.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202325/04/202411.6041	Tasa Fija	20,206,295.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202325/04/202411.6037	Tasa Fija	1,703,287.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/09/202326/04/202411.6041	Tasa Fija	19,701,137.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/09/202327/03/202411.605	Tasa Fija	1,752,820.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/09/202327/03/202411.605	Tasa Fija	1,502,417.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202315/01/202412.7566	Tasa Fija	11,913.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202305/01/202412.7566	Tasa Fija	83,170.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202322/01/202412.7566	Tasa Fija	1,507,597.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202305/01/202412.7566	Tasa Fija	232,908.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202305/01/202412.7566	Tasa Fija	36,719.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202321/03/202413.441	Tasa Fija	2,538,169.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202314/03/202413.441	Tasa Fija	2,282,495.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202306/02/202413.441	Tasa Fija	376,183.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202319/01/202412.7566	Tasa Fija	443,097.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202322/01/202412.7566	Tasa Fija	3,391,997.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202323/02/202413.441	Tasa Fija	45,913.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202322/01/202412.7566	Tasa Fija	39,994.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202322/01/202412.7566	Tasa Fija	328,387.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202306/02/202413.441	Tasa Fija	38,024.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/09/202327/03/202411.6041	Tasa Fija	30,309,442.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/09/202329/09/202711.7535	Tasa Fija	9,384,182.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/10/202329/04/202411.6041	Tasa Fija	5,170,716.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/10/202327/03/202411.605	Tasa Fija	1,752,820.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202322/01/202412.7583	Tasa Fija	139,231.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	567,690.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202322/01/202412.7583	Tasa Fija	24,261.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	817,291.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	73,485.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	364,433.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202306/02/202413.4114	Tasa Fija	8,269.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202306/02/202413.4114	Tasa Fija	27,870.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202306/02/202413.4114	Tasa Fija	162,802.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202319/01/202412.7583	Tasa Fija	378,565.76

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 111 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202322/01/202412.7583	Tasa Fija	82,583.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	255,765.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	65,764.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/10/202306/02/202413.4114	Tasa Fija	1,306,199.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/10/202329/09/202810.74	Tasa Fija	30,328,408.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/10/202302/10/202810.83	Tasa Fija	8,588,069.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/10/202327/03/202411.605	Tasa Fija	1,752,820.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202322/01/202412.7541	Tasa Fija	132,062.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202327/03/202413.4091	Tasa Fija	1,061,111.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202305/01/202412.7541	Tasa Fija	2,691,280.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202305/01/202412.7541	Tasa Fija	258,115.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202305/01/202412.7541	Tasa Fija	91,871.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202305/01/202412.7541	Tasa Fija	30,075.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202306/02/202413.4091	Tasa Fija	1,473,181.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202306/02/202413.4091	Tasa Fija	395,689.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202305/01/202412.7541	Tasa Fija	29,033.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202305/01/202412.7541	Tasa Fija	312,691.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202305/01/202412.7541	Tasa Fija	21,343.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/10/202327/08/202711.6041	Tasa Fija	41,092,083.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/10/202301/02/202411.6033	Tasa Fija	2,019,983.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/10/202301/04/202411.6033	Tasa Fija	1,767,485.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202305/01/202412.752	Tasa Fija	79,403.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202312/03/202413.4295	Tasa Fija	2,092,364.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202305/01/202412.752	Tasa Fija	534,438.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202306/02/202413.4295	Tasa Fija	1,455,217.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202305/01/202412.752	Tasa Fija	158,883.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202305/01/202412.752	Tasa Fija	225,549.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202306/02/202413.4295	Tasa Fija	1,443,341.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202306/02/202413.4295	Tasa Fija	247,055.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202322/01/20246.88573	Tasa Fija	316,587.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202302/02/202412.7535	Tasa Fija	101,263.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202322/01/202412.7535	Tasa Fija	286,371.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202326/01/202412.7535	Tasa Fija	480,437.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202303/01/20245.91835	Tasa Fija	51,167,571.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202302/02/202411.604	Tasa Fija	20,180,506.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202317/01/202412.7535	Tasa Fija	17,421.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202305/01/202412.7535	Tasa Fija	137,916.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202309/02/202412.9411	Tasa Fija	13,880,561.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202306/02/202413.4411	Tasa Fija	3,625,187.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202319/02/20245.93399	Tasa Fija	2,543,642.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202319/02/20245.93399	Tasa Fija	2,543,642.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202302/04/202411.6041	Tasa Fija	25,257,868.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202305/10/202611.7365	Tasa Fija	14,293,041.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202330/01/202412.7542	Tasa Fija	86,181.71

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 112 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202322/01/202412.7542	Tasa Fija	154,605.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202305/01/202412.7542	Tasa Fija	209,444.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202305/01/202412.7542	Tasa Fija	99,688.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202325/03/202413.422	Tasa Fija	324,185.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202321/03/202413.422	Tasa Fija	6,913,563.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202306/02/202413.422	Tasa Fija	424,738.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202306/02/202413.422	Tasa Fija	37,818.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/10/202304/01/202411.604		Tasa Fija	403,610.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202329/01/202412.7542	Tasa Fija	2,588,744.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202305/01/202412.7542	Tasa Fija	210,924.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202305/01/202412.7542	Tasa Fija	30,566.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202306/02/202413.422	Tasa Fija	586,168.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/10/202306/02/202413.422	Tasa Fija	46,180.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202301/02/202412.7546	Tasa Fija	1,213,243.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202329/01/202412.7546	Tasa Fija	1,207,150.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202306/02/202412.7546	Tasa Fija	866,064.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202329/01/202412.7546	Tasa Fija	1,075,067.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202305/01/202412.7546	Tasa Fija	126,157.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202305/01/202412.7546	Tasa Fija	42,928.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202305/01/202412.7546	Tasa Fija	134,423.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202305/01/202412.7546	Tasa Fija	136,626.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202319/01/202412.7546	Tasa Fija	1,270,063.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202302/01/202412.7546	Tasa Fija	116,780.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202305/01/202412.7546	Tasa Fija	376,763.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202305/01/202412.7546	Tasa Fija	1,243,957.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202305/01/202412.7546	Tasa Fija	270,366.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202329/01/202412.7546	Tasa Fija	664.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202306/02/202412.7546	Tasa Fija	121,742.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/10/202306/02/202412.7546	Tasa Fija	112,349.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202302/02/202412.7548	Tasa Fija	2,730.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202302/02/202412.7548	Tasa Fija	740,179.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202329/01/202412.7548	Tasa Fija	145,671.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202305/01/202412.7548	Tasa Fija	32,456.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202305/01/202412.7548	Tasa Fija	66,704.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202302/02/202412.7548	Tasa Fija	387,841.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202322/01/202412.7548	Tasa Fija	413,848.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202305/01/202412.7548	Tasa Fija	166,053.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202306/02/202412.7548	Tasa Fija	1,478,924.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202304/03/202413.4245	Tasa Fija	22,007.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202308/01/202411.604		Tasa Fija	453,481.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202329/01/202412.7548	Tasa Fija	26,948.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/10/202306/02/202412.7548	Tasa Fija	12,482.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202318/01/20245.91835		Tasa Fija	51,167,571.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202316/01/20245.91835		Tasa Fija	51,167,571.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202308/01/20245.91835		Tasa Fija	51,167,571.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202305/04/20245.93587		Tasa Fija	42,605,334.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202305/04/20245.93587		Tasa Fija	51,126,400.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202305/04/202411.6041		Tasa Fija	10,103,147.53

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 113 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202331/01/202412.7535	Tasa Fija	171,600.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202302/01/202412.7535	Tasa Fija	32,652.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202306/02/202412.7535	Tasa Fija	118,866.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202306/02/202412.7535	Tasa Fija	17,359.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202306/02/202412.7535	Tasa Fija	349,573.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202306/02/202412.7535	Tasa Fija	1,962,758.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202304/03/202413.4255	Tasa Fija	72,548.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202308/04/20245.93582	Tasa Fija	42,584,351.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202319/01/202412.7535	Tasa Fija	30,874.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202302/02/202412.7535	Tasa Fija	43,084.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202305/01/202412.7535	Tasa Fija	68,486.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202305/01/202412.7535	Tasa Fija	50,342.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202305/01/202412.7535	Tasa Fija	4,002.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202305/01/202412.7535	Tasa Fija	15,182.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202327/03/202413.4255	Tasa Fija	415,183.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202304/03/202413.4255	Tasa Fija	66,909.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202308/04/202411.6041	Tasa Fija	10,103,147.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202308/04/202411.6041	Tasa Fija	20,206,295.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202329/01/20246.88439	Tasa Fija	410,650.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202303/01/202412.7567	Tasa Fija	259,249.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202306/02/202412.7567	Tasa Fija	172,300.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202305/01/202412.7567	Tasa Fija	206,671.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202305/01/202412.7567	Tasa Fija	282,314.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202306/02/202412.7567	Tasa Fija	163,241.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202306/02/202412.7567	Tasa Fija	101,955.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202309/04/202411.6041	Tasa Fija	15,154,721.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202306/02/202412.7567	Tasa Fija	39,900.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202306/02/202412.7567	Tasa Fija	52,294.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202304/04/202413.4075	Tasa Fija	118,299.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202304/03/202413.4075	Tasa Fija	800,907.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202304/03/202413.4075	Tasa Fija	11,280.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202309/02/202412.7567	Tasa Fija	3,086,107.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202306/02/202412.7567	Tasa Fija	9,276.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202306/02/202412.7567	Tasa Fija	125,795.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202309/04/202411.6041	Tasa Fija	10,103,147.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/10/202311/01/202411.606	Tasa Fija	250,483.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/10/202311/01/202411.606	Tasa Fija	201,354.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202309/01/202412.7583	Tasa Fija	6,970.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202306/02/202412.7583	Tasa Fija	1,206,757.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202306/02/202412.7583	Tasa Fija	64,189.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202304/04/202413.4052	Tasa Fija	3,467,825.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202307/02/202412.7583	Tasa Fija	146,676.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202322/01/202412.7583	Tasa Fija	44,800.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202318/01/202412.7583	Tasa Fija	251,021.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	377,555.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202305/04/202413.4052	Tasa Fija	1,066,869.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/10/202310/04/202411.6041	Tasa Fija	7,779,896.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202306/02/202412.7583	Tasa Fija	3,291,112.57

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 114 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202306/02/202412.7583	Tasa Fija	249,230.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202306/02/202412.7583	Tasa Fija	21,652.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202304/03/202413.4052	Tasa Fija	163,258.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202304/03/202413.4052	Tasa Fija	135,991.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/10/202307/02/20245.77377		
Tasa Fija		2,122,260.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/10/202312/04/202411.6041		
Tasa Fija		4,041,259.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	539,861.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	2,430,392.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	590,059.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	419,699.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	847,980.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	389,394.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202304/03/202413.4187	Tasa Fija	87,222.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	446,672.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	153,394.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	71,859.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202304/03/202413.4187	Tasa Fija	156,576.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202302/02/202412.7575	Tasa Fija	1,000,820.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202302/02/202412.7575	Tasa Fija	423,965.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202322/01/202412.7575	Tasa Fija	63,486.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202305/01/202412.7575	Tasa Fija	25,757.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	157,025.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202305/04/202413.4187	Tasa Fija	430,215.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202307/03/202412.9187	Tasa Fija	11,389,664.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202315/01/20246.60283	Tasa Fija	104,939.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202329/01/20246.86408	Tasa Fija	2,520,947.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202306/02/202412.7612	Tasa Fija	350,687.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202306/02/202412.7612	Tasa Fija	362,254.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202306/02/202412.7612	Tasa Fija	485,668.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202305/01/202412.7612	Tasa Fija	378,766.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202306/02/202412.7612	Tasa Fija	86,289.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202306/02/202412.7612	Tasa Fija	1,413.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202305/01/202412.7612	Tasa Fija	39,828.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202305/01/202412.7612	Tasa Fija	41,416.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202306/02/202412.7612	Tasa Fija	8,006.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202308/03/202413.4165	Tasa Fija	112,773.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202304/03/202413.4165	Tasa Fija	62,656.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202315/01/202411.6043		
Tasa Fija		402,191.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202329/01/20246.84913	Tasa Fija	2,436.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202308/01/202412.7575	Tasa Fija	19,169.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202305/01/202412.7575	Tasa Fija	11,162.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202312/04/202413.4225	Tasa Fija	3,260,506.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202309/02/202412.7575	Tasa Fija	897,501.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	18,641.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	268,907.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	688,276.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202306/02/202412.7575	Tasa Fija	5,850.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202304/03/202413.4225	Tasa Fija	18,702.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202306/02/20246.85477	Tasa Fija	55,319.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202316/02/202412.7588	Tasa Fija	2,446,088.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202306/02/202412.7588	Tasa Fija	12,433.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202306/02/202412.7588	Tasa Fija	15,768.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202301/04/202413.4342	Tasa Fija	322,718.80

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 115 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/10/202304/03/202413.4342	Tasa Fija	83,805.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/10/202304/03/202413.4342	Tasa Fija	28,364.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/10/202305/01/202412.7588	Tasa Fija	32,265.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/10/202302/01/202412.7588	Tasa Fija	3,012.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/10/202306/02/202412.7588	Tasa Fija	132,249.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/10/202312/04/202413.4342	Tasa Fija	733,692.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/10/202309/02/202412.7588	Tasa Fija	406,014.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/10/202314/02/202412.7588	Tasa Fija	167,612.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/10/202306/02/202412.7588	Tasa Fija	1,246,072.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202319/10/202811.774		Tasa Fija	77,662,133.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202319/10/202811.774		Tasa Fija	7,029,762.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202312/01/20246.61582	Tasa Fija	28,687.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202309/02/202412.7594	Tasa Fija	146,533.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202306/02/202412.7594	Tasa Fija	37,205.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202312/02/202412.7594	Tasa Fija	507,737.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202311/04/202413.4411	Tasa Fija	3,952,453.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202305/01/202412.7594	Tasa Fija	37,275.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202312/02/202412.7594	Tasa Fija	794,867.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202306/02/202412.7594	Tasa Fija	118,530.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202315/01/202412.7594	Tasa Fija	171,661.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202312/02/202412.7594	Tasa Fija	3,580,982.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202306/02/202412.7594	Tasa Fija	87,117.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202306/02/202412.7594	Tasa Fija	88,059.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/10/202315/01/202412.7594	Tasa Fija	13,624.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202316/01/202412.76	Tasa Fija	166,852.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202306/02/202412.76	Tasa Fija	101,425.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202306/02/202412.76	Tasa Fija	276,039.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202306/02/202412.76	Tasa Fija	750,563.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202306/02/202412.76	Tasa Fija	198,038.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202306/02/202412.76	Tasa Fija	1,368.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202315/01/202412.76	Tasa Fija	248,225.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202304/03/202413.4451	Tasa Fija	16,142.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202304/03/202413.4451	Tasa Fija	45,683.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202307/02/202412.76	Tasa Fija	21,249.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202306/02/202412.76	Tasa Fija	35,424.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202306/02/202412.76	Tasa Fija	459,107.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202315/01/202412.76	Tasa Fija	136,115.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202306/02/202412.76	Tasa Fija	13,441.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202306/02/202412.76	Tasa Fija	7,090.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/10/202304/03/202413.4451	Tasa Fija	320,218.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/10/202319/04/202411.604		Tasa Fija	6,025,142.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/10/202319/04/202411.604		Tasa Fija	5,020,951.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/10/202319/04/202411.604		Tasa Fija	14,058,664.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202317/02/202711.604		Tasa Fija	37,100,253.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/10/202318/04/202411.61		Tasa Fija	10,763,931.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202302/01/202412.761	Tasa Fija	9,751.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202306/02/202412.761	Tasa Fija	131,995.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202327/02/202413.428	Tasa Fija	108,358.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/10/202322/01/202411.6025			

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 116 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Tasa Fija 401,289.17

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202306/02/202412.761	Tasa Fija	50,205.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202306/02/202412.761	Tasa Fija	1,293,132.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202306/02/202412.761	Tasa Fija	60,115.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202306/02/202412.761	Tasa Fija	95,028.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202306/02/202412.761	Tasa Fija	15,715.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202319/04/202413.428	Tasa Fija	1,025,737.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202308/04/202413.428	Tasa Fija	1,077,739.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202311/04/202413.428	Tasa Fija	219,287.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202315/01/202412.761	Tasa Fija	23,186.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202312/02/20246.83909	Tasa Fija	460,067.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202318/01/202412.762	Tasa Fija	49,304.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202306/02/202412.762	Tasa Fija	96,741.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202306/02/202412.762	Tasa Fija	3,417.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202312/02/202412.762	Tasa Fija	71,802.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202306/02/202412.762	Tasa Fija	146,983.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202306/02/202412.762	Tasa Fija	16,141.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202306/02/202412.762	Tasa Fija	7,909.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202304/03/202413.4347	Tasa Fija	1,925,296.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202316/02/202412.762	Tasa Fija	534,736.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202312/01/20246.5796	Tasa Fija	20,867.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202316/02/202412.7625	Tasa Fija	294,145.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202316/01/202412.7625	Tasa Fija	430,823.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202315/01/202412.7625	Tasa Fija	103,491.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	49,880.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/10/202323/04/202411.6037			
Tasa Fija			2,027,354.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202316/02/202412.7625	Tasa Fija	495,491.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202305/01/202412.7625	Tasa Fija	11,084.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202305/01/202412.7625	Tasa Fija	43,343.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202321/02/202412.7625	Tasa Fija	210,837.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202310/01/202412.7625	Tasa Fija	108,712.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	92,723.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	20,040.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202319/04/202413.4457	Tasa Fija	1,032,337.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/10/202315/04/202413.4457	Tasa Fija	405,698.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/10/202320/02/20246.0096			
Tasa Fija			5,112,596.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/10/202324/04/202411.6037			
Tasa Fija			2,026,512.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202329/01/20246.85583	Tasa Fija	88,111.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/10/202323/02/202411.6037			
Tasa Fija			1,001,933.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202308/01/202412.7625	Tasa Fija	604,818.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202319/02/202412.7625	Tasa Fija	577,546.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	120,822.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202315/04/202413.4458	Tasa Fija	343,191.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202318/04/202413.4458	Tasa Fija	11,639,752.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202304/03/202413.4458	Tasa Fija	23,337.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202316/02/202412.7625	Tasa Fija	534,065.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/10/202325/01/202411.6037			
Tasa Fija			450,870.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202319/01/202412.7625	Tasa Fija	11,588.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202319/02/202412.7625	Tasa Fija	3,011,943.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	132,349.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/10/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	195,052.62

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 117 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/10/202321/02/20246.07749

Tasa Fija 2,556,190.84

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/10/202319/04/202411.604

Tasa Fija 19,819,704.61

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/10/202326/04/202411.6037

Tasa Fija 1,727,106.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202312/02/20246.85691 Tasa Fija 137,055.52

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202326/01/202412.7567 Tasa Fija 671,566.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202316/02/202412.7567 Tasa Fija 194,163.21

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202319/02/202412.7567 Tasa Fija 219,256.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 350,263.41

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202322/01/202412.7567 Tasa Fija 2,651.34

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 42,457.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202322/01/202412.7567 Tasa Fija 18,955.24

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 1,046,778.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 166,552.16

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 9,481.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202322/01/202412.7567 Tasa Fija 16,649.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202326/01/202412.7567 Tasa Fija 11,913.99

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202303/01/202412.7567 Tasa Fija 403,313.02

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202319/02/202412.7567 Tasa Fija 97,640.64

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 503,141.55

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202319/02/202412.7567 Tasa Fija 26,548.18

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 569,058.62

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 105,703.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 10,229.99

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202306/02/202412.7567 Tasa Fija 7,911.88

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202322/01/202412.7567 Tasa Fija 8,870.69

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202304/03/202413.4395 Tasa Fija 146,938.69

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202304/03/202413.4395 Tasa Fija 25,059.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/10/202304/03/202413.4395 Tasa Fija 86,652.86

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202319/02/202412.761 Tasa Fija 117,750.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202306/02/202412.761 Tasa Fija 41,523.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202322/01/202412.761 Tasa Fija 15,461.58

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202315/04/202413.4369 Tasa Fija 409,256.60

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202304/03/202413.4369 Tasa Fija 20,588.14

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202306/02/202412.761 Tasa Fija 21,888.75

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/10/202329/01/202411.6035

Tasa Fija 450,435.13

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202323/02/202412.761 Tasa Fija 146,668.13

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202308/01/202412.761 Tasa Fija 131,908.81

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202306/02/202412.761 Tasa Fija 663,266.37

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202329/01/20246.57712 Tasa Fija 124,543.84

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202325/01/202412.7605 Tasa Fija 68,286.64

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202306/02/202412.7605 Tasa Fija 121,939.82

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202306/02/202412.7605 Tasa Fija 362,115.34

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202306/02/202412.7605 Tasa Fija 16,377.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202306/02/202412.7605 Tasa Fija 224,969.36

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202326/04/202413.4338 Tasa Fija 725,288.84

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202322/04/202413.4338 Tasa Fija 309,952.19

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202304/03/202413.4338 Tasa Fija 71,830.06

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202304/03/202413.4338 Tasa Fija 284,503.24

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202316/02/202412.7605 Tasa Fija 70,645.26

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202319/02/202412.7605 Tasa Fija 259,442.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202306/02/202412.7605 Tasa Fija 354,582.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202306/02/202412.7605 Tasa Fija 231,366.30

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 118 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202316/02/202412.7605	Tasa Fija	122,948.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202306/02/202412.7605	Tasa Fija	249,619.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202306/02/202412.7605	Tasa Fija	573,456.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202304/03/202413.4338	Tasa Fija	941,187.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202304/03/202413.4338	Tasa Fija	1,177,530.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/11/202330/01/202411.6041	Tasa Fija	50,515,737.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202302/01/202412.6555	Tasa Fija	164,598.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	688,502.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202304/01/202412.7625	Tasa Fija	417,160.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	671,036.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202319/02/202412.7625	Tasa Fija	117,893.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	175,215.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	194,558.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202304/03/202413.3055	Tasa Fija	123,989.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202304/03/202413.3055	Tasa Fija	22,013.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202323/02/202412.7625	Tasa Fija	1,353,758.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202326/02/202412.7625	Tasa Fija	889,113.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	555,826.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202305/01/202412.7625	Tasa Fija	14,832.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	340,299.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	334,006.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202304/03/202413.3055	Tasa Fija	4,889.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202304/03/202413.3055	Tasa Fija	4,243.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202304/03/202413.3055	Tasa Fija	3,264.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202304/03/202413.3055	Tasa Fija	826.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202301/02/202411.6033	Tasa Fija	454,496.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202301/02/202411.6033	Tasa Fija	50,499,586.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202301/03/202411.6033	Tasa Fija	1,009,991.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202301/03/202411.6033	Tasa Fija	30,299,751.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202302/01/202412.6555	Tasa Fija	482,823.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202302/01/202412.6555	Tasa Fija	465,997.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202301/03/202411.6033	Tasa Fija	1,009,991.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202302/01/202412.6555	Tasa Fija	144,256.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202319/01/202412.7625	Tasa Fija	4,185.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202326/02/202412.7625	Tasa Fija	5,335,698.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	468,135.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	72,203.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202306/02/202412.7625	Tasa Fija	1,623.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202329/01/202412.7625	Tasa Fija	116,692.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202326/03/202413.3055	Tasa Fija	223,274.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202325/04/202413.3055	Tasa Fija	430,020.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202301/03/202411.6033	Tasa Fija	605,995.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202330/04/202411.6041	Tasa Fija	5,051,573.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202301/03/202411.6033	Tasa Fija	4,039,966.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202331/10/202811.7741	Tasa Fija	28,815,112.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/11/202326/01/20246.5927	Tasa Fija	17,797.79

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04

AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 119 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202302/01/2024	6.5927	Tasa Fija	547,249.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202305/01/2024	12.6565	Tasa Fija	209,601.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202302/01/2024	12.6565	Tasa Fija	14,526.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202305/01/2024	12.6565	Tasa Fija	4,131.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202302/01/2024	12.6565	Tasa Fija	238,682.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202302/01/2024	12.6565	Tasa Fija	1,517,792.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202328/02/2024	12.76	Tasa Fija	445,002.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202309/01/2024	12.76	Tasa Fija	504,751.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202329/01/2024	12.76	Tasa Fija	14,488.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202306/02/2024	12.76	Tasa Fija	806,139.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202329/01/2024	12.76	Tasa Fija	81,042.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202326/02/2024	12.76	Tasa Fija	1,979,361.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202306/02/2024	12.76	Tasa Fija	190,327.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202304/03/2024	12.76	Tasa Fija	126,337.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202315/03/2024	13.4227	Tasa Fija	146,997.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202325/04/2024	13.4227	Tasa Fija	1,267,281.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202305/01/2024	12.6565	Tasa Fija	258,338.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202312/01/2024	12.76	Tasa Fija	34,332.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202312/01/2024	12.76	Tasa Fija	186,499.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202301/03/2024	12.76	Tasa Fija	547,391.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202304/03/2024	12.76	Tasa Fija	906,767.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202306/02/2024	12.76	Tasa Fija	140,090.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202306/02/2024	12.76	Tasa Fija	442,884.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/11/202315/01/2024	12.76	Tasa Fija	13,566.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURA	No06/11/202303/06/2024	11.604	Tasa Fija	3,107,798.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202319/01/2024	6.58017	Tasa Fija	31,437.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202305/01/2024	12.657	Tasa Fija	103,104.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202310/01/2024	12.76	Tasa Fija	19,650.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202319/02/2024	12.76	Tasa Fija	106,544.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202306/02/2024	12.76	Tasa Fija	664,468.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202306/02/2024	12.76	Tasa Fija	637,074.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202322/01/2024	12.76	Tasa Fija	8,500.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURA	No07/11/202302/02/2024	11.604	Tasa Fija	454,061.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202305/01/2024	12.657	Tasa Fija	242,083.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202301/03/2024	12.76	Tasa Fija	201,477.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202322/01/2024	12.76	Tasa Fija	14,976.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202306/02/2024	12.76	Tasa Fija	334,551.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202326/02/2024	12.76	Tasa Fija	22,079.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202306/02/2024	12.76	Tasa Fija	304,630.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202304/03/2024	12.76	Tasa Fija	72,813.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/11/202324/04/2024	13.374	Tasa Fija	1,163,695.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURA	No07/11/202302/05/2024	11.604	Tasa Fija	11,099,278.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURA	No07/11/202306/03/2024	11.6038	Tasa Fija	1,008,380.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURA	No08/11/202307/03/2024	11.604	Tasa Fija	1,008,058.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/11/202326/02/2024	6.79819	Tasa Fija	366,899.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURA	No08/11/202303/05/2024	11.604	Tasa Fija	15,135,380.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/11/202302/01/2024	12.657	Tasa Fija	35,786.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/11/202316/02/2024	12.7615	Tasa Fija	756,646.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/11/202329/01/2024	12.7615	Tasa Fija	15,499.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/11/202315/01/2024	12.7615	Tasa Fija	886.23

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 120 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202303/05/202413.3762	Tasa Fija	1,597,836.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202315/03/202413.3762	Tasa Fija	30,144.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202312/02/202412.7615	Tasa Fija	9,864.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/202306/05/202411.6041	Tasa Fija	101,031,475.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202308/03/202411.604	Tasa Fija	1,007,736.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202306/05/202411.6038	Tasa Fija	15,125,707.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202301/03/202412.756	Tasa Fija	3,831,667.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202321/02/202412.756	Tasa Fija	65,033.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202312/02/202412.756	Tasa Fija	60,327.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202306/05/202413.379	Tasa Fija	558,989.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202301/03/202412.756	Tasa Fija	1,155,622.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202328/02/202412.756	Tasa Fija	90,235.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202307/03/202412.756	Tasa Fija	2,037,559.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202319/04/202413.379	Tasa Fija	1,049,470.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202315/01/202412.756	Tasa Fija	33,709.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202302/05/202413.379	Tasa Fija	5,868,730.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202307/05/202411.604	Tasa Fija	15,120,875.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202310/01/202412.758	Tasa Fija	98,542.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202329/01/202412.758	Tasa Fija	355,522.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202308/02/202411.604	Tasa Fija	453,481.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202308/01/202412.657	Tasa Fija	346,480.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202301/03/202412.758	Tasa Fija	109,980.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202304/03/202412.758	Tasa Fija	3,566,031.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202322/01/202412.758	Tasa Fija	24,812.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202302/01/202412.657	Tasa Fija	503,053.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202304/01/202412.657	Tasa Fija	69,354.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202308/01/202412.657	Tasa Fija	82,603.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202313/02/202412.758	Tasa Fija	56,451.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202304/03/202412.758	Tasa Fija	5,451.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202302/05/202413.367	Tasa Fija	5,760,948.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202308/02/202411.604	Tasa Fija	50,386,800.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202308/02/202411.604	Tasa Fija	20,154,720.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202302/02/20246.57103	Tasa Fija	27,703.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/11/202308/05/202411.604	Tasa Fija	5,038,680.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202311/01/202412.657	Tasa Fija	339,437.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202310/01/202412.657	Tasa Fija	26,667.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202308/01/202412.657	Tasa Fija	113,757.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202308/01/202412.657	Tasa Fija	9,592.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202308/01/202412.657	Tasa Fija	1,069,652.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202308/01/202412.657	Tasa Fija	69,311.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202306/02/202412.7566	Tasa Fija	104,256.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202308/03/202412.7566	Tasa Fija	426,246.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202306/02/202412.7566	Tasa Fija	863,895.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202306/02/202412.7566	Tasa Fija	13,608.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202304/03/202412.7566	Tasa Fija	421,016.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202306/02/202412.7566	Tasa Fija	160,268.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202302/02/202412.7566	Tasa Fija	60,279.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202301/03/202412.7566	Tasa Fija	120,346.98

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 121 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202302/02/202412.7566	Tasa Fija	70,919.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202308/02/202412.7566	Tasa Fija	3,309.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202306/02/202412.7566	Tasa Fija	122,865.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202307/05/202413.3558	Tasa Fija	173,090.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202308/01/20246.57764	Tasa Fija	1,106,612.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202329/01/20246.57764	Tasa Fija	9,014.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202326/02/20246.81447	Tasa Fija	138,229.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202309/05/202411.606	Tasa Fija	15,101,552.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202312/02/202411.6075	Tasa Fija	503,063.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202326/02/202412.7583	Tasa Fija	108,337.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202327/03/20246.14536	Tasa Fija	16,981,081.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202308/01/202412.6564	Tasa Fija	53,582.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202302/01/202412.6564	Tasa Fija	18,115.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202313/02/202412.7583	Tasa Fija	41,452.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202313/03/202412.7583	Tasa Fija	2,034,022.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202306/02/202412.7583	Tasa Fija	38,931.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202308/05/202413.3148	Tasa Fija	965,847.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202326/01/20246.57972	Tasa Fija	760,294.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202308/01/20246.57972	Tasa Fija	71,984.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202304/03/20246.81924	Tasa Fija	20,653.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202310/05/202411.606	Tasa Fija	15,101,552.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202310/01/202412.6555	Tasa Fija	110,311.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202302/01/202412.6555	Tasa Fija	115.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202308/03/202412.7592	Tasa Fija	1,003,321.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202306/02/202412.7592	Tasa Fija	37,951.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202306/02/202412.7592	Tasa Fija	275,225.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202310/05/202413.3282	Tasa Fija	1,597,388.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202308/04/202412.8282	Tasa Fija	10,314,339.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202315/01/202412.7592	Tasa Fija	9,035.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202313/05/202411.6075	Tasa Fija	4,698,609.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202310/05/202411.606	Tasa Fija	15,108,358.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202313/05/202411.6075	Tasa Fija	9,055,135.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202312/03/202412.7596	Tasa Fija	597,994.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202326/02/202412.7596	Tasa Fija	45.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202306/02/202412.7596	Tasa Fija	2,939.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202314/05/202411.606	Tasa Fija	4,023,212.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202308/01/202412.6551	Tasa Fija	5,683.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202301/03/202412.7596	Tasa Fija	330,109.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202326/01/202412.7596	Tasa Fija	466,632.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202326/02/202412.7596	Tasa Fija	20,257.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202314/05/202413.3066	Tasa Fija	259.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202314/02/202411.606	Tasa Fija	20,116,060.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202314/02/202411.606	Tasa Fija	60,348,180.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202315/05/202411.6043	Tasa Fija	2,513,699.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202302/02/20246.56937	Tasa Fija	41,280.59

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 122 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202312/01/202412.655	Tasa Fija	31,729.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202305/01/202412.655	Tasa Fija	1,613,854.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202315/01/202412.655	Tasa Fija	1,386,617.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202305/03/202412.7556	Tasa Fija	19,343.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202306/02/202412.7556	Tasa Fija	910,884.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202304/03/202412.7556	Tasa Fija	687,650.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202311/03/202412.7556	Tasa Fija	238,359.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202311/01/202412.655	Tasa Fija	371,671.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202308/01/202412.655	Tasa Fija	671,472.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202301/03/202412.7556	Tasa Fija	390,768.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202325/01/202412.7556	Tasa Fija	1,165,216.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202319/02/202412.7556	Tasa Fija	190,164.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202309/05/202413.3158	Tasa Fija	3,278,350.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202309/05/202413.3158	Tasa Fija	735,034.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202302/01/202412.655	Tasa Fija	166,032.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202313/03/202412.7556	Tasa Fija	38,758.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202311/03/202412.7556	Tasa Fija	1,343,724.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/11/202309/05/202413.3158	Tasa Fija	1,593,025.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202307/05/202411.604	Tasa Fija	5,040,291.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202309/05/202411.606	Tasa Fija	5,033,850.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202310/05/202411.606	Tasa Fija	5,033,850.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202308/05/202411.604	Tasa Fija	5,038,680.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202314/05/202411.606	Tasa Fija	5,029,015.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202315/05/202411.6043	Tasa Fija	5,027,399.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202316/05/202411.604	Tasa Fija	5,022,563.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202317/05/202411.604	Tasa Fija	5,022,563.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202319/02/202411.604	Tasa Fija	451,885.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202319/10/202811.754	Tasa Fija	93,394,738.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202310/01/202412.6537	Tasa Fija	35,385.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202315/01/202412.6537	Tasa Fija	94,983.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202315/01/202412.6537	Tasa Fija	117,512.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202312/02/202412.755	Tasa Fija	104,189.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202312/03/202412.755	Tasa Fija	165,214.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202311/03/202412.755	Tasa Fija	5,062,173.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202306/02/202412.755	Tasa Fija	7,063.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202317/05/202413.3039	Tasa Fija	57,995.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202313/05/202411.6075	Tasa Fija	5,030,630.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202312/01/202412.6537	Tasa Fija	169,817.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202310/01/202412.6537	Tasa Fija	76,255.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202308/01/202412.6537	Tasa Fija	1,219,438.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202315/01/202412.6537	Tasa Fija	141,530.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202306/02/202412.755	Tasa Fija	142,729.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202312/02/202412.755	Tasa Fija	146,230.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202322/01/202412.755	Tasa Fija	470,684.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202312/01/202412.6537	Tasa Fija	416,823.30

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 123 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202317/05/202413.3039	Tasa Fija	46,844.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202319/01/202412.6537	Tasa Fija	285,155.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202315/01/202412.6537	Tasa Fija	545,956.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/11/202315/01/202412.6537	Tasa Fija	5,205.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/11/202315/01/20246.57151	Tasa Fija	82,754.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/11/202315/01/20246.57151	Tasa Fija	82,668.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/11/202308/01/202412.654	Tasa Fija	15,140.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/11/202312/02/202412.7571	Tasa Fija	7,575.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/11/202313/05/202413.304	Tasa Fija	798,225.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/11/202315/01/202412.654	Tasa Fija	64,774.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/11/202322/01/202412.7571	Tasa Fija	12,257.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/11/202317/05/202413.304	Tasa Fija	1,983,870.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/11/202320/02/202411.6025		Tasa Fija	50,161,145.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/11/202312/01/202412.654	Tasa Fija	335,522.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/11/202321/03/202412.7553	Tasa Fija	2,261,310.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/11/202315/01/202412.654	Tasa Fija	1,105,824.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/11/202315/01/202412.654	Tasa Fija	437.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/11/202323/02/202412.7553	Tasa Fija	77,505.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/11/202320/03/202412.7553	Tasa Fija	11,179.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/11/202313/03/202412.7553	Tasa Fija	23,305.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/11/202317/05/202413.304	Tasa Fija	7,232.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202316/01/202412.654	Tasa Fija	61,252.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202322/01/202412.654	Tasa Fija	84,345.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202322/01/202412.654	Tasa Fija	1,131,956.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202322/01/202412.654	Tasa Fija	324.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202316/02/202412.7578	Tasa Fija	803,795.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202312/02/202412.7578	Tasa Fija	219,316.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202311/03/202412.7578	Tasa Fija	1,639,691.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202319/03/202412.7578	Tasa Fija	1,016,561.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202302/05/202413.304	Tasa Fija	2,153,837.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202315/01/202412.654	Tasa Fija	348,408.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202318/01/202412.654	Tasa Fija	483,935.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202315/01/202412.654	Tasa Fija	7,802.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202302/02/202412.7578	Tasa Fija	53,790.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202319/03/202412.7578	Tasa Fija	226,151.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202306/02/202412.7578	Tasa Fija	7,775.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202322/01/202412.654	Tasa Fija	617,408.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202322/01/202412.654	Tasa Fija	502,012.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/11/202319/03/202412.7578	Tasa Fija	2,448,970.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202322/05/202411.6025		Tasa Fija	2,809,024.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202322/05/202411.6025		Tasa Fija	3,711,924.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202322/02/202411.6025		Tasa Fija	50,161,145.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202322/05/202411.6025		Tasa Fija	3,511,280.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202322/05/202411.6025		Tasa Fija	3,511,280.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202309/02/20246.57968	Tasa Fija	300,138.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202322/01/20246.57968	Tasa Fija	265,570.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202311/03/20246.777	Tasa Fija	205,873.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202322/01/202412.654	Tasa Fija	26,364.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202319/02/202412.755	Tasa Fija	2,011,585.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202319/02/202412.755	Tasa Fija	52,446.24

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 124 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202319/03/202412.755	Tasa Fija	11,102.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202319/02/202412.755	Tasa Fija	33,566.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202320/05/202413.304	Tasa Fija	43,324.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202313/05/202413.304	Tasa Fija	411,096.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202326/01/202412.654	Tasa Fija	268,885.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202325/01/202412.654	Tasa Fija	66,031.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202322/01/202412.654	Tasa Fija	42,374.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202326/03/202412.755	Tasa Fija	40,395.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/11/202304/03/202412.755	Tasa Fija	2,177.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/11/202306/08/202411.6038			
Tasa Fija	44,816,912.09		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/11/202324/05/202411.605			
Tasa Fija	12,520,147.57		
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/11/202322/01/20246.58658	Tasa Fija	1,203,442.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/11/202319/03/20246.79152	Tasa Fija	197,031.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/11/202305/01/202412.6532	Tasa Fija	45,722.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/11/202322/01/202412.6532	Tasa Fija	15,998.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/11/202315/03/202412.755	Tasa Fija	251,768.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/11/202323/01/202412.6532	Tasa Fija	1,007,297.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/11/202314/05/202413.3032	Tasa Fija	5,960.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/11/202326/01/202412.654	Tasa Fija	1,424,076.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/11/202325/01/202412.654	Tasa Fija	98,615.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/11/202323/01/202412.654	Tasa Fija	708,539.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/11/202302/01/202412.654	Tasa Fija	69,795.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/11/202319/02/202412.755	Tasa Fija	21,410.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/11/202314/03/202412.755	Tasa Fija	103,712.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/11/202324/05/202413.304	Tasa Fija	1,159,149.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/11/202309/05/202413.304	Tasa Fija	104,472.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202327/03/202411.605			
Tasa Fija	400,644.72		
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/11/202313/02/202412.755	Tasa Fija	19,897.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202327/02/20246.11835			
Tasa Fija	51,176,620.26		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202331/07/202411.6041			
Tasa Fija	3,860,594.54		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202331/07/202411.6041			
Tasa Fija	1,744,608.49		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/11/202328/02/202411.604			
Tasa Fija	350,451.27		
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202326/01/202412.6541	Tasa Fija	1,169,461.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202308/01/202412.6541	Tasa Fija	99,911.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202322/01/202412.6541	Tasa Fija	68,136.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202315/01/202412.6541	Tasa Fija	523.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202315/03/202412.755	Tasa Fija	52,307.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202319/02/202412.755	Tasa Fija	17,746.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202317/05/202413.3041	Tasa Fija	5,897.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202315/03/202412.755	Tasa Fija	30,809.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202312/02/202412.755	Tasa Fija	196,675.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202314/05/202413.3041	Tasa Fija	63,561.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202319/01/202412.6541	Tasa Fija	27,853.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202322/01/202412.6541	Tasa Fija	41,705.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202316/02/202412.755	Tasa Fija	346,088.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202326/03/202412.755	Tasa Fija	72,659.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202324/05/202413.3041	Tasa Fija	303,682.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/11/202323/05/202413.3041	Tasa Fija	2,232,648.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/11/202328/02/202411.6041			

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
 ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
 DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
 COMPAÑÍA

PAGINA 125 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Tasa Fija 20,206,295.11			
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202322/01/20246.57709	Tasa Fija	41,405.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202319/03/20246.77111	Tasa Fija	200,675.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202305/01/202412.6533	Tasa Fija	60,721.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202302/01/202412.6533	Tasa Fija	57,034.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202318/01/202412.6533	Tasa Fija	455,543.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202322/03/202412.7537	Tasa Fija	1,352,477.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202326/03/202412.7537	Tasa Fija	616,432.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202319/03/202412.7537	Tasa Fija	86,854.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202319/02/202412.7537	Tasa Fija	18,267.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202328/05/202413.3033	Tasa Fija	17,422.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202305/01/202412.6533	Tasa Fija	2,873,216.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202315/01/202412.6533	Tasa Fija	4,366.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202325/03/202412.7537	Tasa Fija	617,383.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202330/01/202412.6533	Tasa Fija	346,325.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202322/01/202412.6533	Tasa Fija	191,993.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202322/03/202412.7537	Tasa Fija	140,217.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202306/02/202412.7537	Tasa Fija	1,191,402.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202325/03/202412.7537	Tasa Fija	2,582,377.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/12/202326/02/202412.7537	Tasa Fija	79,111.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202309/01/202412.654	Tasa Fija	86,274.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202329/01/202412.654	Tasa Fija	383,692.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202329/01/202412.654	Tasa Fija	1,360,895.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202305/01/202412.654	Tasa Fija	12,069,648.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202329/01/202412.654	Tasa Fija	621,754.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202326/02/202412.755	Tasa Fija	12,188.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202325/03/202412.755	Tasa Fija	285,038.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202326/02/202412.755	Tasa Fija	143,929.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202302/02/202412.654	Tasa Fija	45,677.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202329/01/202412.654	Tasa Fija	1,204,419.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202302/01/202412.654	Tasa Fija	32,257.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202305/01/202412.654	Tasa Fija	17,745.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202329/01/202412.654	Tasa Fija	13,323.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202325/03/202412.755	Tasa Fija	2,447,244.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202319/02/202412.755	Tasa Fija	35,937.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202328/05/202413.304	Tasa Fija	4,400.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/12/202325/03/202412.755	Tasa Fija	239,916.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/202330/11/20276.37097			
Tasa Fija 13,981,551.71			
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202302/01/20246.54587	Tasa Fija	45,284.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202329/01/20246.57523	Tasa Fija	1,675,904.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202329/01/20246.57523	Tasa Fija	61,726.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202302/01/202412.6551	Tasa Fija	70,967.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202305/01/202412.6551	Tasa Fija	5,965.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202325/03/202412.7551	Tasa Fija	901,833.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202304/03/202411.6051			
Tasa Fija 453,916.72			
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202329/01/202412.6551	Tasa Fija	190,283.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202329/01/202412.6551	Tasa Fija	43,637.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202305/01/202412.6551	Tasa Fija	29,065.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202329/01/202412.6551	Tasa Fija	1,082.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202325/03/202412.7551	Tasa Fija	532,779.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202329/04/202412.8051	Tasa Fija	12,779,803.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202327/05/202413.3051	Tasa Fija	1,195,158.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202329/01/20246.56297	Tasa Fija	257,918.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202301/02/202412.6538	Tasa Fija	610,282.64

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 126 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202325/01/202412.6538	Tasa Fija	140,976.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202312/01/202412.6538	Tasa Fija	169,787.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202322/01/202412.6538	Tasa Fija	104,806.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202329/01/202412.6538	Tasa Fija	31,068.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202305/01/202412.6538	Tasa Fija	797,383.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202325/03/202412.755	Tasa Fija	253,157.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202304/04/202412.755	Tasa Fija	313,074.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202319/03/202412.755	Tasa Fija	32,634.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202306/02/202412.755	Tasa Fija	493,568.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202329/01/202412.6538	Tasa Fija	87,573.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202305/01/202412.6538	Tasa Fija	29,881.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202322/01/202412.6538	Tasa Fija	5,859.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202319/02/202412.755	Tasa Fija	10,507.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202320/05/202413.3038	Tasa Fija	10,055.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202329/01/202412.6538	Tasa Fija	90,243.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202329/01/202412.6538	Tasa Fija	9,967.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202304/04/202412.755	Tasa Fija	549,135.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202304/04/202412.755	Tasa Fija	83,076.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202319/02/202412.755	Tasa Fija	20,520.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202311/01/202412.654	Tasa Fija	128,701.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202326/02/202412.755	Tasa Fija	217,888.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202305/03/202412.755	Tasa Fija	109,937.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202325/03/202412.755	Tasa Fija	10,464.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202303/06/202413.355	Tasa Fija	58,651.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202329/01/202412.654	Tasa Fija	113,339.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202329/01/202412.654	Tasa Fija	8,419.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202305/01/202412.654	Tasa Fija	11,943.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202315/01/202412.654	Tasa Fija	147,187.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202326/02/202412.755	Tasa Fija	60,898.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202326/02/202412.755	Tasa Fija	62,326.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202323/02/202412.755	Tasa Fija	576,578.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202304/03/202412.755	Tasa Fija	56,689.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/12/202304/03/202412.755	Tasa Fija	77,523.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202327/05/202411.605		Tasa Fija	2,003,223.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202304/06/202411.604		Tasa Fija	10,080,583.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202329/05/202411.6035		Tasa Fija	2,001,933.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202302/02/202412.654	Tasa Fija	928,624.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202329/01/202412.654	Tasa Fija	1,608,346.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202306/02/202412.654	Tasa Fija	5,754,581.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202315/01/202412.654	Tasa Fija	14,775.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202315/01/202412.654	Tasa Fija	19,073.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202305/04/202412.755	Tasa Fija	547,766.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202313/02/202412.755	Tasa Fija	10,442.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202319/02/202412.755	Tasa Fija	10,141.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202304/04/202412.755	Tasa Fija	81,826.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202304/04/202412.755	Tasa Fija	49,136.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202330/05/202413.355	Tasa Fija	5,638,530.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202323/05/202413.355	Tasa Fija	999,776.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202306/02/202412.654	Tasa Fija	695,293.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202322/03/202412.755	Tasa Fija	1,653,255.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202305/06/202411.604		Tasa Fija	2,720,887.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202302/01/202412.654	Tasa Fija	105,483.78

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 127 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202330/01/202412.654	Tasa Fija	1,255,395.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202322/01/202412.654	Tasa Fija	80,465.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202301/02/202412.654	Tasa Fija	315,313.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202306/02/202412.654	Tasa Fija	1,914,496.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202306/02/202412.654	Tasa Fija	10,659.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202303/04/202412.755	Tasa Fija	149,870.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202301/04/202412.755	Tasa Fija	2,374,263.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202308/02/202412.755	Tasa Fija	110,194.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202301/04/202412.755	Tasa Fija	1,066,786.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202304/04/202412.755	Tasa Fija	25,126.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202304/03/202412.755	Tasa Fija	39,303.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202331/05/202413.355	Tasa Fija	1,726,529.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/12/202303/06/202413.355	Tasa Fija	10,343.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/12/202307/03/202411.604		Tasa Fija	302,320.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/12/202304/03/202411.604		Tasa Fija	4,837,132.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/12/202307/03/202411.604		Tasa Fija	422,243.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202301/03/20246.57183	Tasa Fija	91,264.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/12/202303/06/202411.606		Tasa Fija	2,013,540.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202325/01/202412.656	Tasa Fija	183,493.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202306/02/202412.656	Tasa Fija	828,029.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202306/02/202412.656	Tasa Fija	19,153.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202306/02/202412.656	Tasa Fija	2,244,299.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202304/04/202412.7575	Tasa Fija	510,223.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202312/02/202412.7575	Tasa Fija	26,942.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202325/03/202412.7575	Tasa Fija	3,662,785.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202304/04/202412.7575	Tasa Fija	29,586.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202304/03/202412.7575	Tasa Fija	1,498.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202304/04/202412.7575	Tasa Fija	8,856.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202304/03/202412.7575	Tasa Fija	307,049.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202304/03/202412.7575	Tasa Fija	62,828.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202303/06/202413.3575	Tasa Fija	185,516.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/12/202307/06/202411.606		Tasa Fija	2,718,279.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202319/01/202412.656	Tasa Fija	106,096.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202326/02/202412.7575	Tasa Fija	11,164.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/12/202308/03/202411.606		Tasa Fija	352,413.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/12/202304/04/202412.7575	Tasa Fija	40,001.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/12/202307/06/202411.606		Tasa Fija	11,074,471.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/12/202305/03/202411.606		Tasa Fija	9,262,285.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/12/202310/06/202411.6075		Tasa Fija	2,716,540.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202305/01/202412.6575	Tasa Fija	170,331.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202306/02/202412.6575	Tasa Fija	139,961.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202306/02/202412.6575	Tasa Fija	3,995.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202326/02/202412.7585	Tasa Fija	251,670.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202301/04/202412.7585	Tasa Fija	176,811.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585	Tasa Fija	4,917.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202304/03/202412.7585	Tasa Fija	70,074.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202304/03/202412.7585	Tasa Fija	27,693.14

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 128 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202307/06/202413.3585	Tasa Fija	1,010,505.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202306/05/202413.3585	Tasa Fija	223,212.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202306/05/202413.3585	Tasa Fija	77,175.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202323/01/202412.6575	Tasa Fija	73,525.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202306/02/202412.6575	Tasa Fija	3,944.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202305/01/202412.6575	Tasa Fija	307,589.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202304/03/202412.7585	Tasa Fija	31,724.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585	Tasa Fija	1,164,398.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585	Tasa Fija	39,318.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585	Tasa Fija	502,253.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585	Tasa Fija	6,334.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202306/05/202413.3585	Tasa Fija	64,049.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202312/03/202411.6075		Tasa Fija	402,450.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202305/06/202411.6075		Tasa Fija	3,018,378.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585	Tasa Fija	11,917.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202311/04/202411.6075		Tasa Fija	2,012,252.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202301/03/202411.6075		Tasa Fija	277,285.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202312/03/202411.6075		Tasa Fija	305,637.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202308/03/202411.6075		Tasa Fija	244,066.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202306/03/202411.6075		Tasa Fija	9,256,360.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202307/03/202411.6075		Tasa Fija	9,256,360.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202307/06/202411.606		Tasa Fija	3,017,409.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202306/02/20246.58606	Tasa Fija	2,725,779.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202301/04/20246.7465	Tasa Fija	366,427.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202309/02/202412.656	Tasa Fija	85,059.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202305/04/202412.755	Tasa Fija	981,884.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202304/04/202412.755	Tasa Fija	199,110.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202304/04/202412.755	Tasa Fija	27,798.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202304/03/202412.755	Tasa Fija	70,481.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202304/04/202412.755	Tasa Fija	13,178.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202310/06/202413.355	Tasa Fija	1,220,348.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202306/05/202413.355	Tasa Fija	197,048.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202311/06/202411.606		Tasa Fija	2,715,668.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202312/02/202412.656	Tasa Fija	2,789,457.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202312/01/202412.656	Tasa Fija	5,068,318.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202305/04/202412.755	Tasa Fija	1,347,457.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202301/04/202412.755	Tasa Fija	180,442.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202306/05/202413.355	Tasa Fija	15,105.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202308/03/202411.606		Tasa Fija	9,253,387.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/12/202322/01/202412.656	Tasa Fija	361,011.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202304/03/202411.606		Tasa Fija	350,221.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202305/03/202411.606		Tasa Fija	330,353.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202310/06/202411.6043			

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 129 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 3,016,439.43  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202302/01/20246.56181 Tasa Fija 348,144.96  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202302/01/20246.56181 Tasa Fija 79,525.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202301/03/20246.58463 Tasa Fija 38,299.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202306/02/20246.58463 Tasa Fija 7,561,760.82  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/04/202411.6043  
Tasa Fija 1,005,479.81  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/04/202411.6043  
Tasa Fija 1,005,479.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202309/02/202412.6543 Tasa Fija 38,600.93  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202315/01/202412.6543 Tasa Fija 741,374.76  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202312/02/202412.6543 Tasa Fija 100,896.38  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202312/02/202412.6543 Tasa Fija 2,639,585.54  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202312/01/202412.6543 Tasa Fija 507,011.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202327/02/202412.754 Tasa Fija 235,621.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/03/202412.754 Tasa Fija 1,313,015.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202308/04/202412.754 Tasa Fija 712,443.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/04/202412.754 Tasa Fija 79,729.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/03/202412.754 Tasa Fija 34,854.93  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202306/05/202413.354 Tasa Fija 44,699.03  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202306/03/202411.6043  
Tasa Fija 480,428.31  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/03/202411.6043  
Tasa Fija 369,006.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202306/02/202412.6543 Tasa Fija 8,840.45  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/03/202412.754 Tasa Fija 5,254.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/04/202412.754 Tasa Fija 113,425.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/04/202412.754 Tasa Fija 135,055.43  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202316/05/202413.354 Tasa Fija 796,994.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202306/05/202413.354 Tasa Fija 132,181.16  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202311/03/202411.6043  
Tasa Fija 9,250,414.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202312/01/202412.6543 Tasa Fija 1,807,754.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202329/01/202412.6543 Tasa Fija 122,179.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202308/02/202412.6543 Tasa Fija 340,012.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202308/04/202412.754 Tasa Fija 414,457.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/03/202412.754 Tasa Fija 3,151.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202316/05/202413.354 Tasa Fija 999,172.89  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,022,371.64  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,022,371.64  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,022,371.64  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,022,371.64  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,022,371.64  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 130 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.6043  
Tasa Fija 5,027,399.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202308/01/20246.55825 Tasa Fija 22,915.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202306/02/20246.57774 Tasa Fija 47,073.66  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202306/02/20246.57774 Tasa Fija 93,820.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202312/02/202412.654 Tasa Fija 1,156,328.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202312/02/202412.654 Tasa Fija 4,054.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202312/02/202412.654 Tasa Fija 1,101,401.86  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202319/01/202412.654 Tasa Fija 1,673,575.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202312/02/202412.654 Tasa Fija 34,054.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202305/04/202412.7475 Tasa Fija 519,409.08  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202311/03/202412.7475 Tasa Fija 114,868.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202305/04/202412.7475 Tasa Fija 898.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202308/04/202412.7475 Tasa Fija 6,780,236.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202311/03/202412.7475 Tasa Fija 231,336.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202311/03/202412.7475 Tasa Fija 328,975.93  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/202314/06/202411.604  
Tasa Fija 3,515,794.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/202314/06/202411.604  
Tasa Fija 5,022,563.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/202322/02/202411.604  
Tasa Fija 369,204.61  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/202323/02/202411.604  
Tasa Fija 365,768.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202312/02/202412.654 Tasa Fija 149,687.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202315/01/202412.654 Tasa Fija 21,446.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202305/04/202412.7475 Tasa Fija 282,599.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202308/04/202412.7475 Tasa Fija 267,413.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202312/04/202412.7475 Tasa Fija 2,009,914.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202304/04/202412.7475 Tasa Fija 43,498.29  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202304/04/202412.7475 Tasa Fija 14,150.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202310/05/202413.3475 Tasa Fija 416,158.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202323/05/202413.3475 Tasa Fija 1,407,266.98  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/202312/06/202411.604  
Tasa Fija 3,013,538.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202323/02/20246.56399 Tasa Fija 17,268.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202312/02/20246.56399 Tasa Fija 230,091.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202312/02/20246.56399 Tasa Fija 16,493.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202312/02/202412.654 Tasa Fija 1,171,211.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202306/02/202412.654 Tasa Fija 343,569.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202312/02/202412.654 Tasa Fija 775,367.49  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202305/01/202412.654 Tasa Fija 7,637.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202306/02/202412.654 Tasa Fija 295,805.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202322/01/202412.654 Tasa Fija 15,878.21

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 131 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202308/04/202412.7475	Tasa Fija	136,955.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202311/03/202412.7475	Tasa Fija	886,663.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202311/03/202412.7475	Tasa Fija	61,729.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202316/02/202412.654	Tasa Fija	384,847.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202319/01/202412.654	Tasa Fija	404,683.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202319/01/202412.654	Tasa Fija	146,826.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202329/01/202412.654	Tasa Fija	4,004.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202311/03/202412.7475	Tasa Fija	55,913.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202304/03/202412.7475	Tasa Fija	254,905.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202304/04/202412.7475	Tasa Fija	566,094.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202304/03/202412.7475	Tasa Fija	26,751.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202306/05/202413.3475	Tasa Fija	611,685.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202302/02/202412.654	Tasa Fija	242,503.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202315/03/202411.604		Tasa Fija	401,676.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202326/02/202411.604		Tasa Fija	373,006.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202327/02/202411.604		Tasa Fija	420,757.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202317/04/202411.604		Tasa Fija	15,062,855.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202314/06/202411.604		Tasa Fija	3,012,571.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202312/01/202412.654	Tasa Fija	18,288.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202305/01/202412.654	Tasa Fija	72,787.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202306/02/202412.654	Tasa Fija	622,852.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202306/02/202412.654	Tasa Fija	1,482,288.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202306/02/202412.654	Tasa Fija	4,358.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202304/03/202412.7475	Tasa Fija	45,101.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202304/03/202412.7475	Tasa Fija	136,124.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202304/03/202412.7475	Tasa Fija	955,569.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202304/03/202412.7475	Tasa Fija	78,045.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202303/06/202413.3475	Tasa Fija	566,044.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/12/202306/05/202413.3475	Tasa Fija	13,047.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202316/07/202411.604		Tasa Fija	50,209,516.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202315/01/20246.55792	Tasa Fija	12,151.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202312/02/20246.57039	Tasa Fija	582,628.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202312/02/202412.6525	Tasa Fija	136,137.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202312/04/202412.7425	Tasa Fija	645,062.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202308/04/202412.7425	Tasa Fija	168,194.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202304/04/202412.7425	Tasa Fija	1,170,624.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202319/03/202411.6025		Tasa Fija	349,548.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202315/03/202411.6025		Tasa Fija	403,411.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202306/02/202412.6525	Tasa Fija	3,114,738.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202305/01/202412.6525	Tasa Fija	458,601.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202305/01/202412.6525	Tasa Fija	43,959.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202308/04/202412.7425	Tasa Fija	946,246.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202317/07/202411.6025		Tasa Fija	41,158,567.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202317/06/202411.6025		Tasa Fija	3,011,602.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202312/02/202412.6525	Tasa Fija	187,171.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/12/202319/01/202412.6525	Tasa Fija	2,152,209.45

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 132 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202305/01/202412.6525	Tasa Fija	112,659.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202305/01/202412.6525	Tasa Fija	52,099.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202305/01/202412.6525	Tasa Fija	341,062.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202311/03/202412.7425	Tasa Fija	79,023.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202304/04/202412.7425	Tasa Fija	15,644.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202303/06/202413.3425	Tasa Fija	240,062.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202306/05/202413.3425	Tasa Fija	90,209.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202318/06/202411.6025	Tasa Fija	12,544,315.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202315/01/20246.55756	Tasa Fija	1,278,421.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202312/02/20246.57462	Tasa Fija	360,038.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202313/02/202412.6525	Tasa Fija	479,346.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202329/01/202412.6525	Tasa Fija	163,786.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202306/02/202412.6525	Tasa Fija	1,532.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202320/03/202412.7485	Tasa Fija	89,804.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485	Tasa Fija	85,866.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485	Tasa Fija	485,185.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202306/05/202413.3485	Tasa Fija	645,271.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202318/06/202411.6025	Tasa Fija	3,010,635.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202302/02/202412.6525	Tasa Fija	4,154,942.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202306/02/202412.6525	Tasa Fija	1,192,233.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202326/01/202412.6525	Tasa Fija	176,461.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202309/04/202412.7485	Tasa Fija	196,688.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/03/202412.7485	Tasa Fija	8,353.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202306/05/202413.3485	Tasa Fija	70,938.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202330/01/202412.6525	Tasa Fija	1,864,587.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202317/04/202412.7485	Tasa Fija	88,761.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202319/03/202412.7485	Tasa Fija	60,409.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485	Tasa Fija	21,253.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485	Tasa Fija	922,276.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485	Tasa Fija	39,111.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202320/03/202411.6025	Tasa Fija	245,284.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202329/02/202411.6035	Tasa Fija	326,039.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202328/02/202411.604	Tasa Fija	313,785.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202321/03/202411.6025	Tasa Fija	451,450.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/06/202411.6025	Tasa Fija	12,540,286.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202302/01/20246.55689	Tasa Fija	30,126.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202315/03/20246.57106	Tasa Fija	12,545.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202312/02/20246.57106	Tasa Fija	478,417.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202312/02/20246.57106	Tasa Fija	47,572.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/04/202411.6025	Tasa Fija	1,003,222.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/04/202411.6025	Tasa Fija	1,003,222.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/06/202411.6025	Tasa Fija	2,006,445.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202320/02/202412.6525	Tasa Fija	52,212.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202325/01/202412.6525	Tasa Fija	153,275.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202309/02/202412.6525	Tasa Fija	2,326,350.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202302/01/202412.6525	Tasa Fija	27,807.04

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 133 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202306/02/202412.6525	Tasa Fija	2,115,765.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202301/04/202412.7515	Tasa Fija	164,251.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202317/04/202412.7515	Tasa Fija	476,423.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202326/02/202412.7515	Tasa Fija	28,209.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202308/04/202412.7515	Tasa Fija	17,943.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202304/04/202412.7515	Tasa Fija	102,733.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202304/03/202412.7515	Tasa Fija	166,410.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202314/06/202413.3515	Tasa Fija	1,061,697.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202330/04/202413.3515	Tasa Fija	105,803.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202306/05/202413.3515	Tasa Fija	417,331.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202306/05/202413.3515	Tasa Fija	26,470.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202312/02/202412.6525	Tasa Fija	745,891.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202329/01/202412.6525	Tasa Fija	73,536.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202315/02/202412.6525	Tasa Fija	450,902.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202326/01/202412.6525	Tasa Fija	12,188.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/03/202411.6025		Tasa Fija	351,172.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/04/202411.6025		Tasa Fija	1,003,222.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202320/03/202411.6025		Tasa Fija	258,111.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202326/01/202412.6525	Tasa Fija	919,853.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202319/02/202412.6525	Tasa Fija	2,405,610.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202322/01/202412.6525	Tasa Fija	51,654.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202319/01/202412.6525	Tasa Fija	17,409.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202326/02/202412.7515	Tasa Fija	28,689.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202315/04/202412.7515	Tasa Fija	11,927,186.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202304/03/202412.7515	Tasa Fija	519,803.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202304/03/202412.7515	Tasa Fija	625,256.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202313/06/202413.3515	Tasa Fija	2,392,016.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202321/03/202411.6025		Tasa Fija	340,637.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/12/202320/06/202411.6037		Tasa Fija	15,029,009.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/12/202324/04/202411.6037		Tasa Fija	1,001,933.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/12/202325/03/202411.6037		Tasa Fija	450,870.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202302/02/202412.6537	Tasa Fija	41,433.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/02/202412.6537	Tasa Fija	328,867.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202305/01/202412.6537	Tasa Fija	1,310,649.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/02/202412.6537	Tasa Fija	4,563,171.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/02/202412.6537	Tasa Fija	22,113.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/02/202412.6537	Tasa Fija	698,727.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/02/202412.6537	Tasa Fija	286,287.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202315/04/202412.7516	Tasa Fija	9,109,351.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/03/202412.7516	Tasa Fija	13,419.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202315/04/202412.7516	Tasa Fija	546,929.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/03/202412.7516	Tasa Fija	112,658.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202312/01/202412.6537	Tasa Fija	501,612.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/01/202412.6537	Tasa Fija	367,173.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/01/202412.6537	Tasa Fija	149,122.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202305/04/202412.7516	Tasa Fija	465,421.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202319/01/202412.6537	Tasa Fija	425,511.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/12/202301/04/202412.7516	Tasa Fija	623,363.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/12/202322/03/202411.6037			

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 134 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Tasa Fija 353,660.64

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/12/202325/03/202411.6037

Tasa Fija 368,256.82

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202316/02/202412.6537 Tasa Fija 176,965.85

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202319/02/202412.6537 Tasa Fija 320,812.10

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202306/02/202412.6537 Tasa Fija 2,757.95

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202326/01/202412.6537 Tasa Fija 11,706.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202306/02/202412.6537 Tasa Fija 31,704.13

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202306/02/202412.6537 Tasa Fija 2,413.19

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202306/02/202412.6537 Tasa Fija 2,962.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202306/02/202412.6537 Tasa Fija 3,802.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202312/02/202412.6537 Tasa Fija 159,454.47

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202315/04/202412.7516 Tasa Fija 3,337,126.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202304/04/202412.7516 Tasa Fija 104,261.07

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202304/04/202412.7516 Tasa Fija 171,745.63

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202304/04/202412.7516 Tasa Fija 12,082.05

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202304/03/202412.7516 Tasa Fija 2,930.99

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202304/04/202412.7516 Tasa Fija 25,505.37

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202317/06/202413.3516 Tasa Fija 319,816.43

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202316/02/202412.6537 Tasa Fija 138,735.98

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202312/02/202412.6537 Tasa Fija 947,232.54

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202319/02/202412.6537 Tasa Fija 38,704.14

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202319/02/202412.6537 Tasa Fija 50,526.97

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202308/03/202412.7516 Tasa Fija 21,453.63

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202315/04/202412.7516 Tasa Fija 520,353.37

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202311/03/202412.7516 Tasa Fija 2,021.73

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202321/06/202411.605

Tasa Fija 12,520,147.57

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202322/01/20246.55536 Tasa Fija 593,074.12

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202319/02/20246.55111 Tasa Fija 589,158.57

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202319/02/20246.55111 Tasa Fija 26,010.14

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202315/04/20246.58726 Tasa Fija 607,754.47

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202306/02/202412.655 Tasa Fija 189,186.20

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202306/02/202412.655 Tasa Fija 80,804.20

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202305/01/202412.655 Tasa Fija 212,697.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202319/02/202412.655 Tasa Fija 16,690.72

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202326/01/202412.655 Tasa Fija 756,736.98

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202329/01/202412.655 Tasa Fija 57,328.54

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202315/04/202412.7412 Tasa Fija 556,334.43

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202308/04/202412.7412 Tasa Fija 137,576.04

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202319/03/202412.7412 Tasa Fija 13,687.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202320/06/202413.3412 Tasa Fija 611,130.30

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202325/04/202411.605

Tasa Fija 20,032,236.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202326/01/202412.655 Tasa Fija 6,115,506.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202305/01/202412.655 Tasa Fija 8,247.82

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202315/04/202412.7412 Tasa Fija 139,540.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202304/04/202412.7412 Tasa Fija 233,500.76

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202304/04/202412.7412 Tasa Fija 13,906.90

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202306/05/202413.3412 Tasa Fija 35,302.18

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202328/02/202411.605

Tasa Fija 1,502,417.71

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202326/03/202411.605

Tasa Fija 279,785.23

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202326/03/202411.605

Tasa Fija 331,324.17

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 135 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202327/12/20289.73 Tasa Fija 300,405,416.67

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202323/02/202412.654 Tasa Fija 15,084.61

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202302/02/202412.654 Tasa Fija 1,276,867.98

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202319/04/202412.7462 Tasa Fija 1,807,634.63

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202319/04/202412.7462 Tasa Fija 358,363.21

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202326/04/202411.604 Tasa Fija 10,012,893.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202322/01/20246.55694 Tasa Fija 317,610.51

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202319/02/20246.54791 Tasa Fija 285,673.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202319/02/20246.54791 Tasa Fija 369,474.52

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202326/02/202412.654 Tasa Fija 4,671.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 1,465,892.30

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202326/02/202412.654 Tasa Fija 79,672.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202306/02/202412.654 Tasa Fija 713,870.97

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 38,890.24

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 1,894,537.55

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202306/05/202413.3462 Tasa Fija 1,177,666.08

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202306/05/202413.3462 Tasa Fija 463,732.06

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202302/02/202412.654 Tasa Fija 22,876.03

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202306/02/202412.654 Tasa Fija 40,435.47

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202306/02/202412.654 Tasa Fija 293,844.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202320/03/202412.7462 Tasa Fija 627,827.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202315/04/202412.7462 Tasa Fija 774,685.10

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 407,273.76

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 2,059,214.91

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 314,337.89

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 28,532.42

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 1,661.06

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202311/03/202412.7462 Tasa Fija 14,810.39

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202327/03/202411.604 Tasa Fija 329,465.24

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202327/03/202411.604 Tasa Fija 257,613.72

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202326/04/202411.6035 Tasa Fija 1,000,966.96

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202326/04/202411.6035 Tasa Fija 1,000,966.96

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202326/04/202411.6035 Tasa Fija 2,001,933.92

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202326/04/202411.6035 Tasa Fija 15,014,504.38

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202320/02/202412.6535 Tasa Fija 1,423,184.18

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202326/02/202412.6535 Tasa Fija 55,933.97

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202302/02/202412.6535 Tasa Fija 317,792.42

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202319/04/202412.725 Tasa Fija 97,565.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202315/04/202412.725 Tasa Fija 91,860.34

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202321/06/202413.325 Tasa Fija 855,377.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202312/02/202412.6535 Tasa Fija 2,285,324.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202302/02/202412.6535 Tasa Fija 146,820.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202323/02/202412.6535 Tasa Fija 274,853.07

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202326/06/202411.6035 Tasa Fija 24,023,207.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202326/02/202412.6535 Tasa Fija 175,021.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202302/02/202412.6535 Tasa Fija 6,787.05

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202325/03/202412.725 Tasa Fija 217,097.10

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 136 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202304/04/202412.725 Tasa Fija 10,856.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202306/05/202413.325 Tasa Fija 126,890.93  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202306/05/202413.325 Tasa Fija 11,108.06  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202327/03/202411.6035  
Tasa Fija 470,913.91  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa  
Fija 9,934,502.13  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa  
Fija 3,284,048.46  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201919/02/20246.22575  
Tasa Fija 1,700,475.11  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201929/01/202411.6035  
Tasa Fija 109,006,572.39  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/201931/05/202411.6041  
Tasa Fija 732,147.69  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/07/201928/06/202411.6041  
Tasa Fija 41,774,959.61  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.6041  
Tasa Fija 1,946,400.16  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.6041  
Tasa Fija 1,638,191.95  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.6041  
Tasa Fija 357,539.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.6041  
Tasa Fija 6,312,563.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/201928/06/202411.6041  
Tasa Fija 3,925,620.26  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/201928/06/202411.6041  
Tasa Fija 4,446,190.24  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6043  
Tasa Fija 75,410.96  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6043  
Tasa Fija 1,742,253.76  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6043  
Tasa Fija 1,820,265.25  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6043  
Tasa Fija 520,075.61  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6043  
Tasa Fija 520,075.61  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6043  
Tasa Fija 520,075.61  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201928/06/202411.6041  
Tasa Fija 2,224,024.10  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/201917/10/202411.604  
Tasa Fija 2,211,690.09  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201928/06/202411.6041  
Tasa Fija 23,227,334.52  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/11/201926/11/202411.6037  
Tasa Fija 2,755,318.36  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/201928/06/202411.6041  
Tasa Fija 13,272,762.51  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/201928/06/202411.6041  
Tasa Fija 13,272,762.51  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201928/06/202411.6041  
Tasa Fija 5,278,702.97  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201917/10/202411.604

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA

PAGINA 137 / 14

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Fija 1,527,756.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201928/06/202411.6041	
Tasa Fija 3,650,009.58	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202016/01/202511.604	
Tasa Fija 15,476,936.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202026/01/202411.6037	
Tasa Fija 146,115.28	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202017/10/202411.604	
Tasa Fija 1,382,496.24	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202026/11/202411.6037	
Tasa Fija 3,132,361.76	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202006/09/202411.6038	
Tasa Fija 216,683.14	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202010/01/20255.81158	
Tasa Fija 6,689,651.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202028/06/202411.6041	
Tasa Fija 7,453,402.30	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202026/03/20256.76 Tasa	
Fija 1,726,214.44	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202004/04/202511.6038	
Tasa Fija 4,033,522.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.604	
Tasa Fija 4,309,761.03	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.604	
Tasa Fija 3,804,799.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202025/10/202411.605	
Tasa Fija 1,915,582.58	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa	
Fija 909,837.91	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa	
Fija 2,642,200.57	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa	
Fija 2,136,128.62	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202007/05/202511.604	
Tasa Fija 2,142,123.98	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202008/01/202411.604	
Tasa Fija 3,024,014.27	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202026/11/202411.6037	
Tasa Fija 761,469.76	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202027/03/20255.66 Tasa	
Fija 2,855,301.60	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202029/02/202411.6041	
Tasa Fija 64,363.05	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.605	
Tasa Fija 217,169.52	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.605	
Tasa Fija 310,223.91	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202031/05/202411.605	
Tasa Fija 264,940.58	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202006/09/202411.6038	
Tasa Fija 107,439.14	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202006/03/20256.07 Tasa	
Fija 3,692,299.43	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202020/06/202511.6025	
Tasa Fija 3,009,668.61	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.72835	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 138 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 4,961,393.02	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.72835	
Tasa Fija 951,137.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.72835	
Tasa Fija 462,473.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20255.91835	
Tasa Fija 453,978.71	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20256.24835	
Tasa Fija 411,638.39	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202026/06/202511.6037	
Tasa Fija 6,011,603.64	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.605	
Tasa Fija 14,773,774.07	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.6041	
Tasa Fija 16,165,036.05	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.605	
Tasa Fija 15,024,177.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.605	
Tasa Fija 15,024,177.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa	
Fija 108,957.86	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa	
Fija 843,447.04	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202006/09/202411.6038	
Tasa Fija 177,025.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202020/08/20255.77 Tasa	
Fija 13,356,840.58	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202025/08/202511.6037	
Tasa Fija 5,248,225.39	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/08/202026/08/202511.6041	
Tasa Fija 11,772,743.35	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202006/03/20255.51 Tasa	
Fija 2,340,108.71	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa	
Fija 1,133,512.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa	
Fija 1,458,615.51	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202019/09/202511.6025	
Tasa Fija 3,512,408.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202016/04/20255.39 Tasa	
Fija 592,894.59	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202019/09/202511.6025	
Tasa Fija 3,512,408.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202024/09/202511.6037	
Tasa Fija 14,925,859.73	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202006/12/202411.6038	
Tasa Fija 7,562,853.79	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202006/09/202411.6038	
Tasa Fija 169,922.82	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202025/09/202411.6037	
Tasa Fija 647,810.62	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/10/202030/10/202511.6041	
Tasa Fija 56,529,516.12	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202004/11/202511.604	
Tasa Fija 45,848,510.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202025/09/202411.6037	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 139 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 1,572,985.32	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202019/12/202511.6025	
Tasa Fija 56,198,531.59	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/01/202105/01/202411.604	
Tasa Fija 140,994.99	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/01/202126/01/202411.604	
Tasa Fija 420,410.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202130/01/202611.604	
Tasa Fija 8,744,886.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202125/09/202411.6037	
Tasa Fija 1,176,307.10	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202106/09/202411.6038	
Tasa Fija 261,668.86	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.604	
Tasa Fija 135,597,526.52	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.604	
Tasa Fija 51,831,715.41	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202110/03/202511.606	
Tasa Fija 13,728,831.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202131/03/202611.6041	
Tasa Fija 4,950,542.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202101/04/202611.6051	
Tasa Fija 65,901,983.32	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12	Tasa Fija 1,218,805.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12	Tasa Fija 9,984,669.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202115/04/202511.6043	
Tasa Fija 754,109.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202105/07/20245.33	Tasa Fija 2,099,496.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202123/04/202611.6037	
Tasa Fija 8,238,568.81	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/04/202128/04/202611.604	
Tasa Fija 1,255,893.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202115/04/202511.6043	
Tasa Fija 1,843,379.71	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202120/05/202611.6025	
Tasa Fija 145,560,787.60	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202130/04/20245.87	Tasa Fija 97,228,675.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202130/04/20266.28	Tasa Fija 6,535,087.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202128/02/202511.551	
Tasa Fija 2,081,143.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202130/04/20266.28	Tasa Fija 6,154,402.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14	Tasa Fija 109,552,879.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14	Tasa Fija 120,265,394.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/05/202126/05/20266.14	Tasa Fija 135,471,824.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202115/05/202511.6043	
Tasa Fija 712,214.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202110/06/202511.606	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 140 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Tasa Fija 2,733,637.46  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/07/202109/07/20267.04 Tasa Fija 2,530,194.42  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202129/06/202611.6041 Tasa Fija 75,571,543.72  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/202611.6041 Tasa Fija 51,292,903.05  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.6041 Tasa Fija 278,307,490.74  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.6041 Tasa Fija 93,811,513.73  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202129/07/202611.6035 Tasa Fija 9,308,992.73  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/08/202123/04/202611.6037 Tasa Fija 1,192,301.32  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202114/09/20266.57 Tasa Fija 7,694,143.51  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202115/07/202611.6043 Tasa Fija 243,825,334.35  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202109/09/202611.606 Tasa Fija 140,738,515.82  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202114/09/20267.17 Tasa Fija 4,062,896.26  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 30,197,066.68  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 30,197,066.68  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/11/202129/07/202611.6035 Tasa Fija 9,798,939.76  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa Fija 996,581.37  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa Fija 1,536,454.09  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa Fija 10,740,714.25  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa Fija 28,862,447.50  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202225/09/202411.6037 Tasa Fija 1,887,678.59  
 TOTAL - 21,074,230,757.65 1,866,906,141.75 1,268,891,355.58 1,815,416,842.36  
 1,119,326,192.81 - 659,721,839.13 13,930,272.70 59,984,321.31 125,634,976.35  
 281,027,870.39  
 Total bancarios - 21,074,230,757.65 1,866,906,141.75 1,268,891,355.58  
 1,815,416,842.36 1,119,326,192.81 - 9,178,957,888.29 13,930,272.70 59,984,321.31  
 125,634,976.35 281,027,870.39  
 Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de  
 interés y/o sobretasaDenominación [eje]  
 Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]  
 Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]  
 Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]  
 Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año  
 [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años  
 o más [miembro]  
 Bursátiles y colocaciones privadas [sinopsis]  
 Bursátiles listadas en bolsa (quiropgrafarios)  
 CEBUR\_SCOTIAB\_23No18/08/202302/03/2026TIIE28 + 0.04 7,125,499,300.00



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 142 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

CEDEFB_BSCTIA_23017No31/08/202309/05/2024TIIIE28	+0.02	1,500,000,000.00							
CEDEFB_BSCTIA_23018No31/08/202309/05/2024TIIIE28	+0.02	500,000,000.00							
CEDEFB_BSCTIA_23019No27/11/202311/11/2024TIIIE28	+0.02	2,000,000,000.00							
CEDEFB_BSCTIA_23020No30/11/202331/10/2024TIIIE28	+0.02	2,000,000,000.00							
CEDEFB_BSCTIA_23021No30/11/202331/10/2024TIIIE28	+0.02	600,000,000.00							
CEDEFB_BSCTIA_23022No30/11/202331/10/2024TIIIE28	+0.02	1,500,000,000.00							
CEDEFB_BSCTIA_23023No01/12/202323/02/2024TIIIE28	FLAT	3,000,000,000.00							
CEDEFB_BSCTIA_23024No01/12/202322/03/2024TIIIE28	FLAT	2,000,000,000.00							
CEDEFB_BSCTIA_23025No15/12/202315/11/2024TIIIE28	+0.02	1,000,000,000.00							
CEDEFB_BSCTIA_23026No18/12/202302/12/2024TIIIE28	+0.02	2,000,000,000.00							
Obligaciones SubordinadasQ_SCOTIAS_14No18/12/201405/12/20247.4		2,093,000,000.00							
Obligaciones SubordinadasQ_SCOTIAS_18No28/06/201809/06/203312.3		3,360,000,000.00							
Obligaciones SubordinadasQ_SCOTIAS_18-2No11/09/2018PERPETUO11.32		3,455,000,000.00							
TOTAL - 36,443,000,000.00	-	-	-	-	6,815,000,000.00	-	-	-	-

Colocaciones privadas (con garantía)

TOTAL -	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total bursátiles listados en bolsa y colocaciones privadas	-	46,710,403,141.00																	
7,125,499,300.00	-	6,815,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Institución Extranjera (Si/No)	Fecha de firma/contrato	Fecha de vencimiento	Tasa de interés y/o sobretasa	Denominación [eje]															
Moneda nacional [miembro]	Moneda extranjera [miembro]																		
Intervalo de tiempo [eje]	Intervalo de tiempo [eje]																		
Año actual [miembro]	Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]	Año actual [miembro]	Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]								
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo [sinopsis]																			
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo																			

TOTAL -	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total otros pasivos circulantes y no circulantes con costo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Institución Extranjera (Si/No)	Fecha de firma/contrato	Fecha de vencimiento	Tasa de interés y/o sobretasa	Denominación [eje]															
Moneda nacional [miembro]	Moneda extranjera [miembro]																		
Intervalo de tiempo [eje]	Intervalo de tiempo [eje]																		
Año actual [miembro]	Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]	Año actual [miembro]	Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]								
Proveedores [sinopsis]																			
Proveedores																			

TOTAL -	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total proveedores	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Institución Extranjera (Si/No)	Fecha de firma/contrato	Fecha de vencimiento	Tasa de interés y/o sobretasa	Denominación [eje]															
Moneda nacional [miembro]	Moneda extranjera [miembro]																		
Intervalo de tiempo [eje]	Intervalo de tiempo [eje]																		
Año actual [miembro]	Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]	Año actual [miembro]	Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]								

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 143 / 14

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

[miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años  
o más [miembro]

Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo [sinopsis]

Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

TOTAL - - - - -

Total otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo - - - - -

Total de créditos 0.0067,784,633,898.658,992,405,441.751,268,891,355.581,815,416,842.36

7,934,326,192.810.009,178,957,888.2913,930,272.7059,984,321.31125,634,976.35

281,027,870.39

Comentarios:

El tipo de cambio tomado al cierre de diciembre es de 16.9666

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 29 de febrero de 2024, 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), Ángel Omar Estrada Valencia (Director General Adjunto Interino de Auditoría de México) y Julián Felipe Vásquez Wilches (Director Corporativo Contabilidad General y Reportes Regulatorios) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

De conformidad con la Ley General de Sociedades Mercantiles (LGSM), los estatutos del Grupo y las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito (las Disposiciones), emitidas por la Comisión los accionistas y la Comisión tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2023 adjuntos, se someterán a la aprobación de los Accionistas.

Bases de presentación

Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados adjuntos están preparados de conformidad con la legislación aplicable, y de acuerdo con los criterios de contabilidad contenidos en las Disposiciones de carácter general aplicables a las sociedades controladoras de grupos financieros sujetas a la supervisión de la Comisión (los Criterios Contables), quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las sociedades controladoras de grupos financieros y realiza la revisión de su información financiera.

Los Criterios de Contabilidad establecen que la contabilidad de los grupos financieros debe ajustarse a la estructura básica de las Normas de Información Financiera (NIF) definida por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A.C. (CINIF) en la NIF A-1 "Estructura de las normas de información financiera", considerando en primera instancia las NIF contenidas en la Serie NIF A "Marco conceptual", así como lo establecido en el criterio de contabilidad A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad". Asimismo, establecen que las instituciones deben observar los lineamientos contables de las NIF, excepto cuando sea necesario, a juicio de la Comisión, aplicar una normatividad o criterios de contabilidad específicos sobre el reconocimiento, valuación, presentación y revelación aplicables a rubros específicos de los estados financieros consolidados y los aplicables a su elaboración.

Los Criterios de Contabilidad señalan que a falta de criterio contable específico de la Comisión para las instituciones de crédito, o en un contexto más amplio, de las NIF emitidas por el CINIF, se aplicarán las bases de supletoriedad previstas por la NIF A-8 "Supletoriedad", 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 citada NIF y el mismo criterio contable, debiéndose aplicar la supletoriedad en el siguiente orden: los principios de contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP por sus siglas en inglés) y cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando cumpla con los requisitos del criterio A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad" de la Comisión.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(Continúa)

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 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 siguientes notas:

Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros: definición del modelo de negocio: Instrumento Financiero para Cobrar Principal e Interés (IFCPI), Instrumento Financiero para Cobrar o Vender (IFCV), o Instrumento Financiero Negociable (IFN).

Nota 9 - Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: determinación sobre si los instrumentos financieros son de negociación o son designados con fines de cobertura.

Nota 10 - Cartera de crédito: definición del modelo de negocio, ya sea para cobrar principal e interés (IFCPI), o para cobrar o vender (IFCV).

Nota 14 - Activos por derecho de uso: determinación de si un acuerdo contiene un arrendamiento.

Nota 15 - Inversiones en asociadas y otras inversiones permanentes: determinación si el Grupo tiene influencia significativa (inversiones en asociadas) y determinación de si el Grupo tiene control de facto sobre una participada.

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 libros de activos y pasivos en el siguiente año se incluye en las notas a continuación:

-Nota 3(j) - Valuación de instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo.

Nota 4 - Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.

Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros.

Notas 10 y 11 - Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios y de recuperabilidad de cuentas por cobrar: supuestos e insumos utilizados en su determinación.

Nota 18 - Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables, y la materialización de los impuestos diferidos.

Nota 21 - Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves.

Determinación del valor razonable

Algunas de las políticas y revelaciones contables del Grupo requieren la medición de los valores razonables tanto de los activos y pasivos financieros como de los no financieros.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 3 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(Continúa)

El Grupo cuenta con un marco de control establecido en relación con la medición de los valores razonables. Esto incluye la autorización por parte del Consejo de Administración de la contratación de un proveedor de precios, además de la autorización por parte del Comité de Riesgos del Grupo de los modelos de valuación internos y sus modificaciones, los métodos de estimación de las variables usadas en estos modelos de valuación cuando no son proporcionadas directamente por el proveedor de precios que el Grupo haya contratado, y de aquellos valores y demás instrumentos financieros a los que les son aplicables los modelos de valuación internos.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable, incluyendo los valores razonables de Nivel 3, y que reporta directamente a la Dirección de Finanzas. El equipo de valuación revisa regularmente los datos de entrada no observables significativos y los ajustes de valuación. Si se usa información de terceros, como cotizaciones de corredores o servicios de fijación de precios, para medir los valores razonables, el equipo de valuación evalúa la evidencia obtenida de los terceros para respaldar la conclusión de que esas valuaciones satisfacen los requerimientos de las NIF, incluyendo el nivel dentro de la jerarquía del valor razonable dentro del que deberían clasificarse esas valuaciones. Los asuntos de valuación significativos son informados al Comité de Auditoría y al Consejo de Administración del Grupo.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable.

Cuando se mide el valor razonable de un activo o pasivo, el Grupo utiliza datos de mercado observables siempre que sea posible. Los valores razonables se clasifican en distintos niveles dentro de una jerarquía del valor razonable que se basa en los datos de entrada (observabilidad de los insumos) usados en las técnicas de valoración, como sigue:

Nivel 1: precios cotizados (no-ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos, que corresponde al nivel más alto.

Nivel 2: datos de entrada diferentes de los precios cotizados incluidos en el Nivel 1, que sean observables para el activo o pasivo, ya sea directa (es decir, precios) o indirectamente (es decir, provenientes de los precios).

Nivel 3: datos o insumos para medir el activo o pasivo que no se basan en datos de mercado observables (datos de entrada no observables), que corresponde a el nivel más bajo.

Los instrumentos financieros que son valuados mediante el uso de un modelo de valuación interno del Grupo no son considerados bajo ninguna circunstancia como Nivel 1.

Si los datos de entrada usados para medir el valor razonable de un activo o pasivo se clasifican en niveles distintos de la jerarquía del valor razonable, entonces la medición del valor razonable se clasifica en su totalidad en el mismo nivel de la jerarquía del valor razonable que la variable de más baja observabilidad que sea significativa para la medición total.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 4 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(Continúa)

Conforme a lo establecido en las Disposiciones, el Grupo determina el valor razonable de los siguientes instrumentos financieros mediante la valuación directa a vector, que consiste en aplicar a la posición en títulos o contratos del Grupo el precio actualizado para valuación proporcionado por un proveedor de precios:

Valores inscritos en el registro nacional de valores o autorizados, inscritos o regulados en mercados reconocidos por la Comisión.

Instrumentos financieros derivados que cotizan en bolsas de derivados nacionales o que pertenecen a mercados reconocidos por Banco Central.

Activos subyacentes y demás instrumentos financieros que forman parte de las operaciones estructuradas o paquetes de derivados, cuando se trata de valores o instrumentos financieros previstos en las fracciones I y II referidas anteriormente.

El proveedor de precios contratado por el Grupo que le proporciona los precios e insumos para la determinación de la valuación de los instrumentos financieros es Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S. A. de C. V. (VALMER).

Durante los años terminados al 31 de diciembre de 2023 y 2022, no se observó una disminución significativa en el volumen (o nivel de actividad) en relación con la actividad normal del mercado. Lo anterior considerando el tipo de instrumentos financieros que mantiene el Grupo, su baja complejidad y por la disminución de la volatilidad en los mercados financieros en 2023 y 2022.

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022, no existe una reducción en la disponibilidad de precios e insumos proporcionados por el proveedor de precios, por lo que no hay un deterioro evidente y que resulte significativo de las condiciones observables en los insumos utilizados para la valuación de los valores y los otros instrumentos financieros que requiera el reconocimiento de un deterioro en su valor. Como parte de los controles del Grupo, se monitorea la evolución de los mercados financieros, liquidez y condiciones de disponibilidad de precios e insumos para la valuación de los instrumentos con el fin de anticipar cualquier deterioro en el valor de los mismos.

El Grupo reconoce las transferencias entre los niveles de la jerarquía del valor razonable al final del período sobre el que se informa durante el cual ocurrió el cambio.

Las siguientes notas incluyen información adicional sobre los supuestos hechos al medir los valores razonables:

Nota 4 - Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.

Nota 7 - Inversión en instrumentos financieros; y

Nota 9 - Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 53  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

Estados Unidos de América.

(Continúa)

Presentación del resultado integral

En cumplimiento con el criterio contable D-2 "Estado de resultado integral" establecido por la Comisión, el Grupo presenta el resultado integral en un solo estado que presenta en un único documento todos los rubros que conforman el resultado neto, incrementado o disminuido por los Otros Resultados Integrales (ORI) del período, así como de la participación en los ORI de otras entidades, y se denomina "Estado de resultado integral".

Reconocimiento de activos y pasivos financieros en su fecha de concertación

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

Resumen de las principales políticas contables

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en la preparación de los estados financieros consolidados que se adjuntan.

Reconocimiento de los efectos de la inflación

Los estados financieros consolidados que se acompañan fueron preparados de conformidad con los Criterios de Contabilidad, los cuales debido a que el Grupo opera en un entorno económico no inflacionario conforme lo establece la NIF B-10 "Efectos de la inflación", incluyen el reconocimiento de los efectos de la inflación hasta el 31 de diciembre de 2007 con base en el valor de la Unidad de Inversión (UDI), que es una unidad de cuenta cuyo valor es determinado por el Banco de México (Banco Central) en función de la inflación. El porcentaje de inflación anual, acumulada en los tres últimos ejercicios y los valores de la UDI utilizados para determinar la inflación, se muestran a continuación:

Inflación

31 de diciembre de UDI Del año Acumulada

2023 7.98 164.38 % 20.83 %

2022 7.64 687.58 % 19.50 %

2021 7.10 827.61 % 14.16 %

Bases de consolidación-

Los estados financieros consolidados incluyen los de Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, S. A. de C. V. (Sociedad Controladora Filial) y los de sus subsidiarias en las que ejerce control. Los saldos y operaciones importantes entre las compañías del Grupo se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las entidades al 31 de diciembre de 2023 y 2022, los que se prepararon de acuerdo con los Criterios de Contabilidad establecidos por la Comisión.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 6 / 53

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

(Continúa)

Las subsidiarias consolidadas con el Grupo al 31 de diciembre de 2023 y 2022, se detallan a continuación:

Subsidiaria Participación Ubicación Actividad

Banco 99.99% Ciudad de México Operación de banca múltiple  
Casa de Bolsa 99.98% Ciudad de México Intermediación en operaciones de valores y financieras.  
Operadora de Fondos 99.99% Ciudad de México Operación de Fondo de Inversión.  
Crédito Familiar (1) 99.99% Ciudad de México Otorgamiento de créditos al consumo.  
(1) Crédito Familiar fue consolidable hasta el 30 de junio de 2022.

Operaciones en moneda extranjera

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las sociedades controladoras de grupos financieros y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio de cierre de jornada de operación 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 de cierre de jornada de operación 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 período en que se originan dentro del rubro "Resultado por intermediación", según sea el caso.

Compensación de activos financieros y pasivos financieros

Un activo y pasivo financiero serán objeto de compensación de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado su importe neto, sólo cuando el Grupo tiene el derecho legalmente exigible y vigente de compensarlos en cualquier circunstancia, y a su vez la intención de liquidarlos sobre una base compensada, o de realizar el activo financiero y liquidar el pasivo financiero simultáneamente.

Efectivo y equivalentes de efectivo

El efectivo se reconoce a su valor nominal. Se consideran efectivo, la moneda de curso legal y moneda extranjera en caja, los depósitos en el Banco Central y los depósitos en entidades financieras del país y el extranjero, ya sea en cuentas de cheques, giros bancarios, telegráficos o postales y remesas en tránsito.

Los equivalentes de efectivo se reconocen inicialmente a su valor razonable. Éstos incluyen valores a corto plazo, de alta liquidez, fácilmente convertibles en efectivo que están sujetos a riesgos poco importantes en su valor (donde estos últimos son aquellos cuyo plazo de vencimiento se prevé dentro de un máximo de 48 horas a partir de su adquisición), entre otros, los préstamos interbancarios con vencimientos iguales o menores a tres días hábiles (operaciones de "Call Money"), las compras de divisas que no se consideren instrumentos financieros derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable, y otros equivalentes de efectivo tales como corresponsales, documentos de cobro inmediato, metales preciosos amonedados e inversiones disponibles a la vista.

(Continúa)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 53  
**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

---

La valuación de los equivalentes de efectivo representados por metales preciosos amonedados se realiza a su valor razonable, considerándose como tal a la cotización aplicable a la fecha de valuación, excepto aquellos que por su naturaleza no tengan valor razonable, los cuales se reconocen a su costo de adquisición.

Las divisas adquiridas que se pacta liquidar en una fecha posterior a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como efectivo y equivalentes de efectivo restringidos (divisas a recibir); en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de efectivo y equivalentes de efectivo (divisas a entregar). Los derechos originados por las ventas de divisas se registran en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y las obligaciones derivadas de las compras de divisas se registran en el rubro de "Acreedores por liquidación de operaciones". El monto de los sobregiros en cuentas de cheques, el saldo compensado, de divisas a recibir y divisas a entregar, o de algún concepto que integra el efectivo y equivalentes de efectivo, cuando muestran saldos negativos, se presenta en el rubro de "Otras cuentas por pagar".

Las operaciones de préstamos interbancarios pactadas a un plazo menor o igual a 3 días hábiles, así como los depósitos en el Banco Central sobre las cuales no pueda disponer el Grupo, se reconocen como equivalentes de efectivo restringidos.

Los intereses ganados y las utilidades o pérdidas por valuación se incluyen en los resultados del ejercicio conforme se devengan como parte de los ingresos o gastos por intereses. Los resultados por valuación y compraventa de metales preciosos amonedados y divisas se reconocen en el resultado por intermediación.

## Cuentas de margen

Las cuentas de margen están asociadas a transacciones con instrumentos financieros derivados celebrados en mercados o bolsas reconocidos, y corresponden al margen inicial, aportaciones y retiros posteriores efectuados en la vigencia de los contratos correspondientes. En las cuales se depositan activos financieros altamente líquidos destinados a procurar el cumplimiento de las obligaciones correspondientes a dichos instrumentos, a fin de mitigar el riesgo de incumplimiento. El monto de los depósitos corresponde al margen inicial y a las aportaciones o retiros posteriores que efectúen el Grupo y la cámara de compensación durante la vigencia del contrato de los instrumentos financieros derivados.

Las cuentas de margen en efectivo se reconocen a su valor nominal y se presentan dentro del rubro de "Cuentas de margen". 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", afectando como contrapartida una cuenta específica que puede ser de naturaleza deudora o acreedora, según corresponda y que representa un anticipo recibido, o bien, un financiamiento otorgado por la cámara de compensación y que reflejará los efectos de la valuación de los derivados previos a su liquidación.

---

---

(Continúa)

Inversiones en instrumentos financieros

i.Reconocimiento y medición inicial

Las inversiones en instrumentos financieros comprenden instrumentos de patrimonio neto, obligaciones, bonos, certificados y demás títulos de crédito y documentos que se emiten en serie o en masa, cotizados y no cotizados, que la entidad mantiene como posición propia. Se miden y reconocen inicialmente a su valor razonable más, en el caso de activos o pasivos financieros no medidos a valor razonable con cambios en éste, llevados a través de resultado integral, los costos de transacción directamente atribuibles a su adquisición o emisión, cuando en lo subsecuente se midan a su costo amortizado.

ii.Clasificación y medición posterior

En el reconocimiento inicial, las inversiones en instrumentos financieros se clasifican en las siguientes categorías, conforme al modelo de negocio y las características de los flujos contractuales de los mismos, como:

Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), que tienen por objeto en su tenencia, recuperar los flujos contractuales que conlleva el instrumento. Los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden sólo a pagos de principal e interés (rendimiento), usualmente sobre el monto del principal pendiente de pago. El IFCPI debe tener características de un financiamiento otorgado y administrarse con base en su rendimiento contractual.

Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV), medidos a valor razonable con cambios en otros resultados integrales (VRCORI), que tienen por objetivo tanto cobrar los flujos contractuales de principal e interés, como obtener una utilidad en su venta cuando ésta resulte conveniente. El Grupo de forma irrevocable reconoce los cambios en el valor razonable de los IFCV a través del ORI; e

Instrumentos financieros negociables (IFN), medidos a valor razonable con cambios en resultados (VRCR) que representan la inversión en instrumentos financieros de deuda o de capital, y que tienen por objetivo obtener una utilidad entre el precio de compra y el de venta.

La clasificación de las inversiones en instrumentos financieros se basa tanto en el modelo de negocios como en las características de los flujos contractuales de los mismos. Atendiendo al modelo de negocios, un instrumento financiero o una clase de instrumentos financieros (un portafolio), puede ser administrado bajo:

Un modelo que busca recuperar los flujos contractuales (representado por el monto del principal e intereses).

Un modelo de negocio que busca, tanto la recuperación de los flujos contractuales como en el modelo anterior, como la obtención una utilidad mediante la venta de los instrumentos financieros, lo cual conlleva a desplazar un modelo combinado de gestión de estos instrumentos financieros.

Un modelo que busca obtener un máximo rendimiento a través de compra y venta de los instrumentos financieros.

(Continúa)

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 9 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Los instrumentos financieros no se reclasifican después de su reconocimiento inicial, excepto si el Grupo cambia su modelo de negocio, en cuyo caso todos los instrumentos financieros afectados son reclasificados a la nueva categoría en el momento en que el cambio en el modelo de negocio ha ocurrido.

La reclasificación de inversiones en instrumentos financieros entre categorías se aplica prospectivamente a partir de la fecha de cambio en el modelo de negocio, sin modificar ninguna utilidad o pérdida reconocida con anterioridad, tales como intereses o pérdidas por deterioro. Cuando se realice alguna reclasificación conforme a lo antes mencionado, el Grupo deberá informar de este hecho por escrito a la Comisión dentro de los 10 días hábiles siguientes a su determinación, exponiendo detalladamente el cambio en el modelo de negocio que las justifique. Dicho cambio deberá estar autorizado por el Comité de Riesgos del Grupo.

Un instrumento financiero se mide al costo amortizado si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a su valor razonable con cambios a través de resultados conforme se describe a continuación:

el instrumento financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los instrumentos financieros para obtener la recuperación de los flujos de efectivo contractuales; y

las condiciones contractuales del instrumento financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe del principal pendiente (Sólo Pago del Principal e Intereses, o SPPI por sus siglas).

Una inversión en un instrumento de deuda se mide a valor razonable con cambios en ORI si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a valor razonable con cambios en resultados:

-el activo financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo se logra tanto obteniendo los flujos de efectivo contractuales como vendiendo los activos financieros; y

-las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe de SPPI.

Todos los instrumentos financieros no clasificados como medidos al costo amortizado o a valor razonable con cambios en ORI como se describe anteriormente, son medidos a valor razonable con cambios en resultados. Esto incluye todos los instrumentos financieros derivados (ver inciso (j) de esta nota).

Instrumentos financieros: Evaluación del modelo de negocio -

El Grupo determina su modelo de negocio para la administración de sus inversiones en instrumentos financieros y para clasificarlos adecuadamente. El modelo de negocio se basa en la forma en que los instrumentos financieros se administran para generar flujos de efectivo para el negocio y no en una intención particular de tenencia del instrumento. Se requiere de juicio para determinar el modelo de negocio, ya que este no se basa en un solo factor o actividad, por lo que se considera toda la evidencia disponible al momento de realizar la evaluación. De forma enunciativa mas no limitativa, la evidencia relevante a evaluar es como se muestra en la hoja siguiente.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(Continúa)

las políticas y los objetivos señalados para el portafolio y la operación de esas políticas en la práctica. Estas incluyen si la estrategia de la Administración se enfoca en cobrar ingresos por intereses contractuales, mantener un perfil de tasa de interés concreto o coordinar la duración de los instrumentos financieros con la de los pasivos que dichos instrumentos están financiando o las salidas de efectivo esperadas, o realizar flujos de efectivo mediante la venta de los instrumentos;

cómo se evalúa el rendimiento del portafolio y cómo éste se informa a la Administración del Grupo;

los riesgos que afectan al rendimiento del modelo de negocio (y los instrumentos financieros mantenidos en el modelo de negocio) y, en concreto, la forma en que se gestionan dichos riesgos;

cómo se retribuye a los gestores del negocio (por ejemplo, si la compensación se basa en el valor razonable de los instrumentos gestionados o sobre los flujos de efectivo contractuales obtenidos); y

la frecuencia, el volumen y la oportunidad de las ventas en períodos anteriores, las razones de esas ventas y las expectativas sobre la actividad de ventas futuras.

Las transferencias de instrumentos financieros a terceros en transacciones que no califican para la baja en cuentas no se consideran ventas para este propósito, de forma consistente con el reconocimiento continuo de los instrumentos por parte del Grupo.

Los instrumentos financieros que son mantenidos para negociación y cuyo rendimiento es evaluado sobre una base de valor razonable son medidos a valor razonable con cambios en resultados.

Instrumentos financieros: Evaluación de si los flujos de efectivo contractuales son solo pagos del principal y los intereses (SPPI).

Para propósitos de esta evaluación, el monto del "principal" se define como el valor razonable del instrumento financiero en el momento del reconocimiento inicial. El "interés" se define como la contraprestación por el valor del dinero en el tiempo y por el riesgo crediticio asociado con el importe principal pendiente, durante un período de tiempo concreto y por otros riesgos y costos básicos de los préstamos (por ejemplo, el riesgo de liquidez y los costos administrativos), así como un margen de utilidad.

Al evaluar si los flujos de efectivo contractuales son solo pagos del principal e intereses (SPPI), el Grupo considera los términos contractuales del instrumento. Esto incluye evaluar si un instrumento financiero contiene una condición contractual que pudiera cambiar la oportunidad o importe de los flujos de efectivo contractuales de manera que no cumpliría esta condición.

Al hacer esta evaluación, el Grupo toma en cuenta:

eventos contingentes que cambiarían el importe o la oportunidad de los flujos de efectivo;

términos que pudieran generar apalancamiento;

términos que hacen referencia al valor del dinero en el tiempo, como por ejemplo ajustar la tasa del cupón, incluyendo las características de tasa variable;

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 11 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(Continúa)

términos que generen instrumentos derivados implícitos, o cambios en sus términos y condiciones, por indexación a variables ajenas a la naturaleza del contrato;

características de pago anticipado y prórroga; y

términos que limitan el derecho del Grupo a los flujos de efectivo procedentes de instrumentos específicos (por ejemplo, características de "sin recurso").

Una característica de pago anticipado es consistente con el criterio de únicamente pago del principal e intereses si el importe del pago anticipado representa sustancialmente los importes no pagados del principal e intereses sobre el importe principal, que puede incluir compensaciones adicionales razonables para el termino anticipado del contrato. Adicionalmente, en el caso de un instrumento financiero adquirido con un descuento o prima significativo de su importe nominal contractual, una característica que permite o requiere el pago anticipado de un importe que representa sustancialmente el importe nominal contractual más los intereses contractuales devengados (pero no pagados) (que también pueden incluir una compensación adicional razonable por termino anticipado) se trata como consistente con este criterio si el valor razonable de la característica de pago anticipado es insignificante en el reconocimiento inicial.

Instrumentos financieros: Medición posterior y ganancias y pérdidas -

Instrumentos financieros negociables (IFN) 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 compraventa 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 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". No obstante, ver inciso (j) de esta nota en el caso de los derivados designados como instrumentos de cobertura. Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI) Estos instrumentos se miden posteriormente al costo amortizado usando el método del interés efectivo. El costo amortizado se reduce por las pérdidas por deterioro. El ingreso por intereses, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en resultados. Cualquier ganancia o pérdida en la baja en cuentas se reconoce en resultados del ejercicio.

(Continúa)

Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV) Estos instrumentos se miden posteriormente a valor razonable. El ingreso por intereses calculado bajo el método de interés efectivo, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en los resultados del ejercicio. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otros resultados integrales (VRCORI), el cual se ajusta por el

---

efecto de impuestos diferidos. En el momento de la baja en cuentas, las ganancias y pérdidas acumuladas en otros resultados integrales se reclasifican en resultados.

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".

Inversiones en acciones a través de ORI. Estos activos se miden posteriormente al valor razonable. Los dividendos se reconocen como ingresos en resultados a menos que el dividendo claramente represente una recuperación de parte del costo de la inversión. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otro resultado integral.

#### iii. Baja en cuentas

El Grupo da de baja en cuentas un instrumento financiero cuando expiran los derechos contractuales sobre los flujos de efectivo del instrumento financiero, o cuando transfiere los derechos a recibir los flujos de efectivo contractuales en una transacción en la que se transfieren sustancialmente todos los riesgos y beneficios de la propiedad del instrumento financiero, o en la cual el Grupo no transfiere ni retiene sustancialmente todos los riesgos y beneficios relacionados con la propiedad y no retiene el control sobre los instrumentos financieros.

El Grupo participa en transacciones en las que transfiere los instrumentos reconocidos en su estado de situación financiera consolidado, pero retiene todos o sustancialmente todos los riesgos y beneficios de los instrumentos financieros transferidos. En estos casos, los instrumentos financieros transferidos no son dados de baja en cuentas. (ver incisos (h) e (i) de esta nota).

#### iv. Deterioro

El Grupo evalúa desde su reconocimiento inicial las pérdidas crediticias esperadas (PCE) de los IFCV y los IFCPI, las cuales se determinan considerando el nivel de recuperabilidad esperada que corresponda a los distintos IFCV y reconoce el efecto de la pérdida, con base en el costo amortizado de los IFCV y los IFCPI. Dado que el valor razonable del IFCV ya reconoce el deterioro por pérdidas crediticias esperadas, el Grupo no procede a crear una estimación que reduzca el valor razonable del IFCV; por lo tanto, el efecto se reconoce en la utilidad o pérdida neta, afectando el valor del IFCV antes de reconocer el efecto en ORI por valuación a valor razonable. Para los IFCPI, se reconoce la PCE determinada afectando el valor razonable del IFCPI. Lo anterior no afecta a los IFN, pues en éstos no surge la cuestión de cobrabilidad al no existir la intención de cobro y porque el valor de mercado de los mismos capta generalmente los efectos de pérdidas crediticias esperadas de los mismos.

(Continúa)

Las PCE son el promedio ponderado por la probabilidad de las pérdidas crediticias y se miden como el valor presente de las insuficiencias de efectivo. Al estimar las PCE, el Grupo considera la información razonable y sustentable que sea relevante y esté disponible sin costos o esfuerzos indebidos. Esto incluye información cuantitativa y cualitativa y análisis, basados en la experiencia histórica del Grupo y en una evaluación de crédito informada e incluyendo información prospectiva.

El Grupo vigila que las PCE por el deterioro de los títulos emitidos por una contraparte, guarda consistencia con el deterioro determinado para créditos que se otorguen a la misma contraparte.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 13 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

En caso de que existan cambios favorables en la calidad crediticia de los IFCV que estén debidamente sustentados con base en eventos posteriores observables, la PCE ya reconocida se revierte en el período en que ocurren dichos cambios, contra la utilidad o pérdida neta del período, como una reversión de PCE previamente reconocida.

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 contraparte 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".

Operaciones de reporto

Las operaciones de reporto que no cumplen con los términos establecidos en la NIF C-14 "Transferencia y baja de activos financieros", se les da el tratamiento de financiamiento con colateral atendiendo a la sustancia económica de dichas transacciones e independientemente si se trata de operaciones de reporto "orientadas a efectivo" u "orientadas a valores". En las transacciones "orientadas a efectivo" la intención como reportada es obtener un financiamiento en efectivo y la intención de la reportadora es el invertir su exceso de efectivo, y en la transacción "orientada a valores" la reportadora tiene como objetivo acceder a ciertos valores en específico y la intención de la reportada es la de aumentar los rendimientos de sus inversiones en valores.

Actuando como reportada-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Grupo reconoce la entrada de efectivo o equivalentes de efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar medida inicialmente al precio pactado que se presenta en el rubro "Acreedores por reporto", la cual representa la obligación de restituir dicho efectivo a la reportadora. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por pagar se valúa a su costo amortizado mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Gastos por intereses". Los activos financieros transferidos a la reportadora ("colateral otorgado") se reclasifican en el estado de situación financiera consolidado, presentándolos como restringidos, y se siguen valuando de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda al activo.

(Continúa)

Actuando como reportadora-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, se reconoce la salida de efectivo y equivalentes de efectivo, o bien una cuenta liquidadora acreedora, registrando una cuenta por cobrar al precio pactado que se presenta en el rubro de "Deudores por reporto", la cual representa el derecho a recuperar el efectivo entregado. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por cobrar se valúa a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Ingresos por intereses". Los activos financieros recibidos como colateral se registran en cuentas de orden y se valúan a valor razonable.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

En caso de que el Grupo venda el colateral o lo otorgue en garantía, se reconoce la entrada de los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral a la reportada (inicialmente al precio pactado), 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. El diferencial que llegara a resultar entre el precio recibido y el valor de la cuenta por pagar se reconoce en los resultados del ejercicio, en adición, se lleva en cuentas de orden el control de dicho colateral vendido o dado en garantía siguiendo para su valuación el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

Asimismo, en el caso en que la reportadora se convierta a su vez en reportada por la concertación de otra operación de reporto con el mismo colateral recibido en garantía de la operación inicial, el interés por reporto pactado en la segunda operación se deberá reconocer en los resultados del ejercicio conforme se devengue, de acuerdo al método de interés efectivo, afectando la cuenta por pagar valuada a costo amortizado mencionada anteriormente.

Las cuentas de orden reconocidas por colaterales recibidos o colaterales recibidos que a su vez hayan sido vendidos o dados en garantía por la reportadora, se cancelan cuando la operación de reporto llega a su vencimiento o exista incumplimiento por parte de la reportada.

Estimación de perdidas crediticias esperadas -

La estimación para pérdidas crediticias esperadas se determina conforme a lo establecido en la NIF C-16 "Deterioro de instrumentos financieros", lo cual implica que se determina inicialmente una etapa de riesgo a cada posición, y posteriormente calcular la estimación de pérdidas crediticia esperada asociada a cada etapa.

El Grupo ha desarrollado el procedimiento para determinar las pérdidas crediticias esperadas para los instrumentos financieros, con el objeto de determinar el deterioro de los deudores por reporto para su posterior reconocimiento contable.

Préstamo de valores

Es aquella operación en la que se conviene la transferencia de valores, del prestamista al prestatario, con la obligación de devolver tales valores u otros substancialmente similares en una fecha determinada o a solicitud, recibiendo como contraprestación un interés. En esta operación se solicita un colateral o garantía por parte del prestamista al prestatario.

(Continúa)

Actuando como prestamista-

A la fecha de la contratación del préstamo de valores actuando como prestamista, el Grupo registra el valor objeto del préstamo transferido al prestatario como restringido, para lo cual se siguen las normas de valuación, presentación y revelación de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda. Asimismo, se registra en cuentas de orden el colateral recibido que garantiza los valores prestados.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Ingresos por intereses".

Actuando como prestatario-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 15 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Actuando como prestatario, a la fecha de la contratación del préstamo de valores, el Grupo registra el valor objeto del préstamo recibido en cuentas de orden, siguiendo para su valuación los lineamientos para los títulos reconocidos en el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

El valor objeto de la operación se presenta en cuentas de orden en el rubro de colaterales recibidos por el Grupo. Por lo que se refiere a colaterales recibidos provenientes de otras transacciones se deberán presentar en el rubro de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía.

En la fecha en que el Grupo venda el valor objeto de la operación, deberá reconocer la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir dicho valor al prestamista (medida inicialmente al precio pactado) que se valorará a valor razonable.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Gastos por intereses" y en el estado de situación financiera consolidado dentro del rubro de "Acreedores y otras cuentas por pagar".

Instrumentos financieros derivados y operaciones de cobertura (IFD)

El Grupo clasifica los instrumentos financieros derivados con base a su intencionalidad en las dos categorías que se muestran a continuación:

Con fines de negociación - Consiste en la posición que asume el Grupo con la intención de obtener ganancias basadas en los cambios en su valor razonable.

Con fines de cobertura - Consiste en la posición que asume el Grupo con el objeto de compensar o transformar el perfil de uno o varios de los riesgos generados por una partida cubierta.

El reconocimiento en los estados financieros consolidados de los activos y/o pasivos provenientes de operaciones con IFD, se realiza en la fecha en que se concreta la operación, independientemente de la fecha de liquidación o entrega del bien.

El Grupo reconoce todos los activos o pasivos financieros resultantes de los derechos y obligaciones establecidos en los contratos de IFD, inicialmente a su valor razonable, el cual, presumiblemente, corresponde al precio de transacción, es decir, el precio de contraprestación recibida o entregada. Los costos de transacción que sean directamente atribuibles a la adquisición de IFD se reconocen directamente en resultados dentro del "Resultado por intermediación".

(Continúa)

Posteriormente, todos los IFD se valúan a su valor razonable, sin deducir los costos de transacción en los que se pudiera incurrir en la venta u otro tipo de disposición, reconociendo dicho efecto de valuación en los resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Los derivados se presentan en el estado de situación financiera consolidado en un rubro específico del activo o del pasivo, dependiendo de si su valor razonable corresponde a un saldo deudor o un saldo acreedor, respectivamente. Dichos saldos deudores o acreedores se compensan siempre y cuando cumplan con las reglas de compensación de activos y pasivos financieros.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 16 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Para la determinación del valor razonable, se consideran los datos e insumos provistos por un proveedor de precios autorizado por la Comisión, siempre y cuando no sean instrumentos financieros derivados que coticen en bolsas nacionales o que no sean intercambiados en mercados reconocidos por el Banco Central.

Operaciones con fines de negociación-

Contratos adelantados ("forwards"):

El contrato adelantado o "forward" se opera en forma privada (fuera de los mercados organizados de futuros o de opciones). El saldo de dichos IFD representa la diferencia entre el valor razonable del contrato y el precio "forward" estipulado del mismo. Si la diferencia es positiva es plusvalía y se presenta en el activo; si es negativa es minusvalía y se presenta en el pasivo.

Títulos Opcionales ("Warrants"):

Los títulos opcionales son documentos que se emiten en serie y se colocan entre el gran público inversionista, representan un derecho temporal adquirido por los tenedores a cambio del pago de una prima por la emisión en Acciones o Índices, por lo tanto, dicho derecho expira al término del plazo de vigencia, por lo que la tenencia de estos implica el reconocimiento de que el valor intrínseco y el precio de mercado del título opcional en el mercado secundario puedan variar en función del precio de mercado de los activos de referencia.

Opciones:

En opciones compradas, su saldo deudor representa el valor razonable de los flujos futuros a recibir, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

En opciones vendidas, su saldo acreedor representa el valor razonable de los flujos futuros a entregar, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

Futuros:

El contrato a futuro opera con términos estandarizados (condiciones generales de contratación), tiene mercado secundario y requiere el establecimiento obligatorio de colaterales en cuentas de aportaciones o de margen de liquidación diaria.

Swaps:

Es un IFD mediante el cual se establece la obligación bilateral de intercambiar flujos de efectivo en fechas futuras preestablecidas, sobre un valor nominal o de referencia durante un período determinado.

Su saldo representa la diferencia entre el valor razonable de la parte activa y de la parte pasiva.

(Continúa)

Operaciones con fines de cobertura-

El Grupo utiliza instrumentos financieros derivados con el objetivo de manejar adecuadamente los riesgos de tasas de interés y de tipos de cambio inherentes a las

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

operaciones de crédito, depósitos, inversiones en valores y reportos, todas ellas propias de la banca comercial. Los instrumentos más utilizados son swaps de tasas de interés y de monedas, mediante los cuales se transforma instrumentos de tasa flotante a tasa fija y de tasa fija a tasa flotante, o en su caso, se transforma activos denominados en moneda extranjera a nacional o viceversa. Los derivados pueden ser utilizados para cubrir flujos de caja o valor económico de diferentes activos y pasivos del Grupo, existiendo políticas de control definidas para la designación y seguimiento continuo de la efectividad de tales coberturas.

Al inicio de las relaciones de cobertura designadas, el Grupo documenta el objetivo y estrategia de gestión de riesgos para llevar a cabo la cobertura. El Grupo también documenta la relación económica entre la partida cubierta y el instrumento de cobertura, fueron formalmente designados a exposiciones alojadas en el estado de situación financiera consolidado, incluyendo si se espera que los cambios en los flujos de efectivo de la partida cubierta y el instrumento de cobertura se compensen entre sí.

Los derivados con fines de cobertura, que cumplen con todas las condiciones, se valúan a valor razonable y el efecto se reconoce dependiendo del tipo de cobertura, de acuerdo con lo que se muestra a continuación:

Coberturas de valor razonable. Cubren la exposición a los cambios en el valor razonable de un activo o pasivo reconocido o de un compromiso en firme no reconocido, o un componente de alguna de las partidas anteriores, o una exposición agregada. La posición primaria cubierta y el instrumento derivado de cobertura se valúan a su valor razonable, registrándose el efecto neto en los resultados del período dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

Coberturas de flujos de efectivo. Cubren la exposición a la variabilidad de flujos de efectivo atribuible a un riesgo particular asociado con un activo o pasivo reconocido, un portafolio o un componente de los mismos, o una o varias transacciones pronosticadas altamente probables o porciones de éstas, o una exposición agregada. Se valúa a valor razonable el instrumento derivado de cobertura y la valuación correspondiente a la parte efectiva de la cobertura, se registra dentro de la cuenta "Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo" en los Otros Resultados Integrales. La parte inefectiva se registra en resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Una relación de cobertura debe discontinuarse prospectivamente cuando deja de cumplir con los criterios para reconocer una relación de cobertura, esto incluye cuando el instrumento de cobertura se vende, expira, se rescinde o se ejerce, así como después de que se ha considerado o llevado a cabo cualquier reequilibrio en la relación de cobertura y la relación de cobertura resulta ser no efectiva o no cumple con el objetivo de la administración de riesgo del Grupo.

Derivados implícitos-

El Grupo 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.

(Continúa)

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que, por medio de opciones implícitas, se puede ofrecer un rendimiento garantizado y/o se mejora la tasa de rendimiento del cliente (ver nota 16).

El valor razonable del componente derivado se registra dentro de los rubros de

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 18 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

"Instrumentos financieros 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 IFD fuera de mercados o bolsas reconocidos

La cuenta por cobrar que se genera por el otorgamiento de colaterales en efectivo en operaciones de IFD no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar", mientras que la cuenta por pagar que se genera por la recepción de colaterales en efectivo se presenta dentro del rubro "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en activos no realizables, como títulos, se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

Ajuste de valoración por riesgo crédito contraparte y riesgo de crédito propio

El Credit Valuation Adjustment (CVA) es un ajuste a la valuación de los instrumentos financieros derivados Over the Counter (OTC) por el riesgo asociado a la exposición crediticia asumida con cada contraparte.

Actualmente el Grupo tiene implementada una metodología de cálculo de CVA bilateral a nivel contraparte que incorpora mitigantes de riesgo de crédito tales como acuerdos de compensación y colaterales.

La determinación de la exposición se basa en insumos de mercado consistentes con los utilizados en los procesos de valuación de instrumentos y los parámetros de pérdida (severidad de la pérdida y probabilidad de incumplimiento) se revisan periódicamente y se someten a validaciones y pruebas de estrés (en su caso, para las contrapartes que tienen asociados Credit Default Swaps (CDS) a mercado, estos son utilizados para la obtención de la probabilidad de pérdida).

Los modelos de riesgo contraparte correspondientes a las metodologías implementadas para obtener las exposiciones de crédito para el portafolio de derivados.

El Debit Valuation Adjustment (DVA) es un ajuste de valoración similar al CVA, pero, en este caso, surge por el riesgo de crédito propio del Grupo asumido por sus contrapartes en derivados financieros OTC.

Todos los valores razonables de los instrumentos financieros se calculan diariamente.

(Continúa)

Compensación de cuentas liquidadoras

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reportos, préstamos de valores, activos virtuales y/o de operaciones con instrumentos financieros derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados, se registran en cuentas liquidadoras dentro de los rubros de

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 19/ 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

"Otras cuentas por cobrar, neto" y "Acreedores por liquidación de operaciones", respectivamente, así como 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.

Los activos y pasivos financieros se compensan de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado el saldo deudor o acreedor, según corresponda, siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y se tenga la intención de liquidar la cantidad neta, provengan de la misma naturaleza de la operación, se celebren con la misma contraparte y se liquiden en la misma fecha de vencimiento o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

## Cartera de crédito

La cartera de crédito se compone de financiamientos otorgados a clientes por el Grupo a través de contratos de crédito, operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito, los cuales se reconocen cuando son originados y, en caso de adquisiciones, en la fecha de concertación de la adquisición.

La cartera de crédito incluye:

Cartera de crédito valuada a costo amortizado. El modelo de negocio de esta cartera de crédito consiste en conservarla para cobrar los flujos de efectivo contractuales y los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden únicamente a pagos de principal e interés sobre el monto del principal pendiente de pago. Se reconoce inicialmente a su valor razonable que corresponde al precio de transacción, es decir al monto neto financiado que resulta de adicionar o restar al monto original de crédito, el seguro que se haya financiado, los costos de transacción, las comisiones, intereses y otras partidas cobradas por anticipado. Para su reconocimiento posterior, la cartera de crédito se valúa a su costo amortizado. El costo amortizado corresponde al valor presente de los flujos de efectivo contractuales por cobrar de la cartera de crédito, más los costos de transacción por amortizar, utilizando el método de interés efectivo y restando la estimación preventiva para riesgos crediticios.

Los costos de transacción a que se hacen referencia incluyen, entre otros, honorarios y comisiones pagados a agentes, asesores e intermediarios, avalúos, gastos de investigación, así como 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. Por otra parte, los costos de transacción no incluyen premios o descuentos, los cuales forman parte del valor razonable de la cartera de crédito al momento de la transacción.

(Continúa)

Tanto las comisiones cobradas como los costos de transacción que origina una línea de crédito se reconocen como un crédito o cargo diferido, respectivamente, presentándose netos y afectando la cartera de crédito, los cuales se amortizan en resultados conforme se devengan, excepto si se trata de los relacionados a tarjeta de crédito o líneas de crédito revolvente, los cuáles se reconocen directamente en resultados al momento del otorgamiento.

Clasificación de la cartera de crédito

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 20 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

La cartera de crédito se presenta en las categorías de comercial, vivienda y consumo, conforme a lo descrito a continuación:

Créditos comerciales:

los otorgados a personas morales o personas físicas con actividad empresarial y destinados a su giro comercial o financiero;  
créditos otorgados a entidades financieras distintos de los préstamos interbancarios con un plazo menor a 3 días hábiles;  
créditos por operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito;  
créditos otorgados a fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos y los esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados" en los que exista una afectación patrimonial que permita evaluar individualmente el riesgo asociado al esquema;  
los créditos concedidos al Gobierno Federal, entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados y los créditos a empresas productivas del estado, y aquellos con garantía expresa de la Federación registrados ante la SHCP y el Banco Central, así como los garantizados expresamente por las entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados, asentados en el Registro Público Único a que hace referencia la Ley de Disciplina Financiera de las entidades federativas y los municipios.

Créditos a la vivienda. Se clasifican como créditos a la vivienda los créditos directos otorgados a personas físicas y destinados a la adquisición o construcción de la vivienda sin propósito de especulación comercial, que cuentan con garantía hipotecaria sobre la vivienda del acreditado. Asimismo, se consideran créditos a la vivienda, los destinados a la construcción, remodelación o mejoramiento de la vivienda que están respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado, o bien cuentan con una garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo o por un fideicomiso público constituido por el Gobierno Federal para el fomento económico (remodelación o mejoramiento). Adicionalmente, se incluyen los créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades y aquellos créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado.

La cartera de crédito de vivienda incluye créditos originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT), adquiridos por el Grupo. Esta cartera de crédito incluye la denominada cartera en prórroga, que se integra por créditos que, en términos de la Ley del INFONAVIT, cuentan con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios. Lo anterior, siempre y cuando la entidad está contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos de los organismos de referencia. Al concluir la prórroga la cartera recibe el tratamiento que le corresponde conforme a si se trata de "Régimen Ordinario de Amortización" (ROA) o el "Régimen Especial de Amortización" (REA).

(Continúa)

ROA es una a modalidad de pago que es aplicable a los acreditados que tienen una relación laboral, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

REA es una modalidad de pago que es aplicable a acreditados que ya no cuentan con una relación laboral, a la que le son aplicables las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 21 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

créditos.

Las obligaciones y derechos que el INFONAVIT tienen sobre los créditos adquiridos son las siguientes:

El Grupo fue seleccionado mediante el proceso de subasta para adquirir los derechos de coparticipación en la originación de los créditos del producto "Segundo Crédito" que serán otorgados a los derechohabientes del INFONAVIT.

El INFONAVIT conserva la administración, cobranza y recuperación correspondiente a los créditos cedidos al Grupo y está obligado a realizar las gestiones de cobro necesarias para la recuperación de los créditos exigibles.

Créditos de consumo. Son créditos directos otorgados a personas físicas, derivados de operaciones de tarjeta de crédito, de créditos personales, de nómina, de créditos para la adquisición de bienes de consumo duradero (conocidos como ABCD), que contempla entre otros al crédito automotriz y las operaciones de arrendamiento financiero que son celebradas con personas físicas; incluyendo aquellos créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades, así como los de liquidez que no cuenten con garantía de inmuebles.

Líneas de crédito

En el caso de líneas de crédito y cartas de crédito que el Grupo ha otorgado, en las cuales no todo el monto autorizado esté ejercido, la parte no utilizada de las mismas se reconoce en cuentas de orden.

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.

Operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito

El descuento es una operación por la cual el Grupo, como "descontante", se obliga a anticipar a un cliente, como "descontatario", el importe de un crédito, contra tercero y de vencimiento futuro, a cambio de la enajenación a favor de del Grupo de dicho crédito, disminuido por un interés a favor del descontante.

Las cesiones de derechos de crédito son operaciones de financiamiento mediante las cuales se transmite al Grupo la titularidad de derechos de crédito, siendo distintas de las adquisiciones de cartera de crédito.

(Continúa)

Para cualquiera de las operaciones mencionadas anteriormente, el Grupo reconoce inicialmente como cartera de crédito el valor nominal de la cartera recibida contra la salida de efectivo, el aforo pactado reconocido en "Otras cuentas por pagar" por importe del valor nominal de los derechos de crédito transferidos que no financia el Grupo, y el ingreso financiero por devengar.

El ingreso financiero por devengar de estas operaciones corresponde a la diferencia entre el valor de la cartera recibida deducida del aforo y el monto financiado. Su devengamiento en el resultado integral se determina y reconoce conforme a la tasa de interés efectiva de las operaciones.

---

#### Pagos en especie

Los pagos en especie se reconocen de conformidad con lo establecido en la política contable de bienes adjudicados en la nota 3s.

#### Modelo de negocio de la cartera de crédito

La determinación del modelo de negocio para la cartera de crédito se basa en el historial de cómo el Grupo la administra. El Grupo considera lo siguiente:

La forma en cómo se determina e informa el desempeño de la cartera de crédito  
Los riesgos que afectan el desempeño del modelo de negocio y de la cartera de crédito y cómo son administrados esos riesgos.  
Los lineamientos sobre los que se basa la remuneración de la dirección de crédito, si con base en maximizar el valor de la cartera de crédito o en cobrar sus flujos contractuales.

El Grupo considera también la frecuencia, el valor y la oportunidad de las ventas de cartera de crédito en períodos anteriores, las razones de dichas ventas, así como las expectativas sobre la actividad de ventas futuras dentro del contexto y condiciones en que se presentaron, y la influencia que tienen en la forma en que se logra el objetivo de la entidad para administrar o gestionar la cartera de crédito y, específicamente sobre cómo se realizan los flujos de efectivo.

Trimestralmente el Grupo evalúa las características de sus modelos de negocio para clasificar la cartera de crédito con base en el objetivo del mismo, conforme a sus políticas establecidas.

#### Renegociaciones

Se consideran renegociaciones a las reestructuras y renovaciones de las operaciones de cartera de crédito, las cuales se describen a continuación:

Reestructuración. Es una renegociación de la que se deriva cualquier modificación a las condiciones originales del crédito, entre las cuales se encuentran:

cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;  
cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, Veces Salario Mínimo (VSM), Unidad de Medida y Actualización (UMA) o Unidades de Inversión (UDI);  
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 para la Atención de Emergencias por Amenazas Naturales "OTIS";

(Continúa)

prórroga del plazo del crédito;  
modificación al esquema de pagos pactado, o  
ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate.

Renovación. Es una renegociación en la que el saldo de un crédito es liquidado parcial o totalmente por el deudor, sus obligados solidarios u otra persona que por sus nexos patrimoniales constituya riesgos comunes con el deudor, a través del incremento al monto original del crédito, o bien con el producto proveniente de otro crédito contratado con la misma entidad o con un tercero que por sus nexos patrimoniales con esta última constituya riesgos comunes.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 23 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

No obstante lo anterior, el Grupo no considera renovado un crédito por las disposiciones que se efectúen durante la vigencia de una línea de crédito preestablecida, siempre y cuando el acreditado haya liquidado la totalidad de los pagos que le sean exigibles conforme a las condiciones originales del crédito.

Por las reestructuras, así como por las renovaciones con las que se liquida parcialmente el crédito original, el Grupo reconoce una utilidad o pérdida por la diferencia entre los flujos de efectivo del nuevo crédito descontados a la tasa de interés efectiva original y el valor en libros del crédito original a la fecha de la renegociación, sin considerar su estimación preventiva para riesgos crediticios.

Para efectos de lo anterior, se considera valor en libros al monto efectivamente al acreditado, ajustado por los intereses devengados, otros conceptos financiados, los cobros de principal e intereses, así como por las quitas y condonaciones, bonificaciones y descuentos que se hayan otorgado, y en su caso los ingresos o gastos financieros por devengar.

Para la determinación de la tasa de interés efectiva del nuevo crédito, consecuencia de la reestructura o la renovación parcial, se toma de base el resultado sumar al monto financiado se le adicionan los costos de transacción incurridos y en su caso las comisiones cobradas en por su originación y el resultado se toma de base para aplicar la tasa de interés efectiva original. Los costos de transacción y comisiones cobradas se reconocen como un cargo o crédito diferido, respectivamente, y se amortizan durante la vida remanente del crédito.

En el caso de renovaciones totales, el Grupo considera que existe un nuevo crédito, por lo que da de baja el crédito original.

Nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito

La cartera de crédito es evaluada periódicamente a efecto de determinar el riesgo de crédito, el cual representa la pérdida potencial por la falta de pago de un acreditado o contraparte en las operaciones que efectúa el Grupo, incluyendo las garantías reales o personales que les otorguen, así como cualquier otro mecanismo de mitigación utilizado por las entidades. El nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito se clasifica por etapas que son, en orden ascendente en su nivel de riesgo, Etapa 1, Etapa 2 y Etapa 3.

Etapa 1

Se refiere a cartera de crédito cuyo riesgo de crédito no se ha incrementado significativamente desde su reconocimiento inicial hasta la fecha de los estados financieros consolidados, es decir que no se encuentra en los supuestos para considerarse en las Etapas 2 y 3 que se mencionan posteriormente.

(Continúa)

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Grupo considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 1:

Sobre créditos de consumo no revolvente (para adquisición de bienes de consumo duradero o ABCD, Auto, Nómina, Personal y Otros), cuando presentan hasta un mes de atraso. Para tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presenta hasta un impago en los periodos consecutivos inmediatos anteriores.

Para la cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, cuando presentan atrasos de hasta un mes o atrasos de hasta tres meses para cartera que cuenta con prórroga; en el caso de cartera de crédito ROA cuando presenta de tres a seis meses de atraso, siempre que cada uno de los pagos realizados durante dicho período representa al menos el 5% de la amortización pactada.

En el caso de cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos menores o iguales a 30 días naturales o un mes calendario.

#### Etapa 2

Incluye créditos que han mostrado un incremento significativo de riesgo desde su reconocimiento inicial y hasta la fecha de los estados financieros consolidados conforme a los modelos de cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios (ver nota 3p).

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Grupo considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 2:

Para créditos de consumo no revolvente, cuando presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses.

En el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de uno y hasta tres impagos en periodos consecutivos inmediatos anteriores.

Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, si presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses, incluyendo los clasificados como REA.

Cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos mayores a 30 días naturales o un mes calendario y menores a 90 días naturales tres meses calendario.

Los créditos que estando en Etapa 2 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a

Etapa 1.

#### Etapa 3

Corresponde a la cartera de crédito con deterioro crediticio originado por la ocurrencia de uno o más de los eventos, los cuales tienen un impacto significativo sobre los flujos de efectivo futuros de dichos créditos. En específico, se consideran los créditos en esta etapa los que se muestran a continuación:

Aquéllos por los que el Grupo tiene conocimiento de que el acreditado ha sido declarado en concurso mercantil.

(Continúa)

Sin perjuicio de lo previsto previamente, los créditos que continúan recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles (LCM), 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, son traspasados a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 cuando incurrir en los supuestos previstos por el numeral 2 siguiente.

Tratándose de créditos de consumo no revolventes y créditos a la vivienda, que han sido pagados parcialmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 53  
**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

días naturales o más de vencidos en capital e interés.  
Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

Créditos distintos a los mencionados en el numeral anterior, cuyas amortizaciones no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.  
Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.  
Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de "Efectivo y equivalentes de efectivo", al momento en que no han sido cobrados.

Créditos adquiridos al INFONAVIT, conforme a la modalidad de pago REA o ROA, y créditos destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda, cuando sus amortizaciones o pagos, respectivamente, no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presentan 90 días naturales o más de vencidos.

El traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 de los créditos a que se refiere el numeral 5 del párrafo anterior se sujeta al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

los recursos del crédito son dispuestos para el fin con que fueron otorgados;  
el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón,  
o  
el Grupo 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 período representen, al menos, el 5% de la amortización pactada.

(Continúa)

Las excepciones mencionadas anteriormente no se consideran excluyentes entre sí.

Para créditos de consumo en los que las condiciones de pago establecidas en el contrato establecen pagos con periodicidad menor a un mes calendario, el Grupo considera las siguientes equivalencias:

Periodicidad de pago  
contractualEquivalencia  
30 días90 días

Quincenal2 quincenasMás de 6 quincenas  
Catorcenal2 catorcenasMás de 6 catorcenas  
Decenal3 decenasMás de 9 decenas  
Semanal4 semanasMás de 13 semanas

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Grupo considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 3:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 26 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Para créditos de consumo no revolvente cuando presenta atrasos mayores a tres meses. Sobre tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de tres impagos en periodos consecutivos inmediatos anteriores. Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda. Cuando presentan atrasos mayores a tres meses, en el caso de créditos ROA, si presentan tres a seis meses de atraso, si alguno de los pagos realizados durante dicho periodo no representa al menos el 5% de la amortización pactada, y para créditos ROA cuando presentan atrasos mayores a 6 meses. Cartera de crédito comercial, si presenta atrasos mayores o iguales a 90 días naturales o 3 meses calendario.

En el caso de adquisiciones de cartera de crédito, para la determinación de los días naturales de vencimiento, se consideran los incumplimientos que se hayan presentado desde su originación.

Los créditos que estando en Etapa 3 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, son reclasificados a Etapa 1, excepto los créditos reestructurados y/o renovados.

Efecto de renegociaciones en el nivel de riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito Etapa 2 o Etapa 3 que se reestructuren o se renueven no se reclasifican a una etapa con menor riesgo de crédito por efecto de su reestructura o renovación, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, que se reestructuren durante su plazo o se renueven en cualquier momento, son traspasados a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, y permanecen en dicha etapa hasta que existe evidencia de pago sostenido.

(Continúa)

Las líneas de crédito dispuestas, que se han reestructurado o renovado en cualquier momento, se traspasan a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, excepto cuando se cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del acreditado y se ha cumplido lo siguiente:

se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y  
se ha cubierto la totalidad de los pagos a que esté obligado en términos del contrato a la fecha de la reestructuración o renovación.

Tratándose de disposiciones de crédito hechas al amparo de una línea de crédito, cuando se reestructuran o renuevan en forma independiente de dicha línea, son evaluadas de conformidad con las reglas para reestructuraciones y renovaciones aplicables antes descritas, atendiendo a las características y condiciones de la disposición o disposiciones reestructuradas o renovadas.

Si posterior a la evaluación descrita en el párrafo anterior se concluye que una o más disposiciones otorgadas al amparo de una línea de crédito deben traspasarse a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito por efecto de dicha reestructura o renovación y tales disposiciones, de manera individual o en su conjunto, representan al menos 25% del total del saldo dispuesto de la línea de crédito al a fecha de la reestructura o renovación, el saldo total dispuesto, así como sus disposiciones posteriores, son traspasadas a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 27 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, distintos de créditos referentes a i) créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia que los intereses se paguen periódicamente, ii) líneas de crédito dispuestas, y iii) disposiciones de crédito hechas al amparo de líneas de crédito, que se han reestructurado o renovado de los que no ha transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se mantienen en la misma categoría únicamente si cumplen lo siguiente:

el acreditado ha cubierto la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación ó reestructuración, y  
el acreditado ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación ó reestructuración debió haber sido cubierto.

Sobre el mismo tipo de créditos mencionados en el párrafo anterior, con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, pero que han sido reestructurados o renovados durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, son traspasados a la categoría inmediata siguiente, con mayor riesgo de crédito, excepto si cumplen siguiente:

se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración;  
se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación ó reestructuración debió haber sido cubierto, y  
se ha cubierto el 60% del monto original del crédito.

Si no se cumplen todas las condiciones descritas en los dos párrafos anteriores, según corresponda, el crédito se traspasa a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito desde el momento en que se reestructura o renueva y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

(Continúa)

Se considera cumplido el requisito de los incisos a) de los dos párrafos anteriores, cuando habiéndose cubierto el interés devengado a la última fecha de corte, el plazo transcurrido entre dicha fecha y la reestructura o renovación no excede el menor entre la mitad del período de pago en curso y 90 días.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 o Etapa 2 que se reestructuren o renueven en más de una ocasión, son traspasados a cartera con riesgo de crédito en Etapa 3, excepto cuando el Grupo cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del deudor. En el caso de cartera comercial, tales elementos son debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

Cuando se consolidan diversos créditos otorgados por el Grupo a un mismo acreditado mediante una reestructura o renovación, se analiza cada uno de los créditos consolidados como si se reestructuraran o renovaran por separado y, si se concluye que uno o más de dichos créditos se habría traspasado a cartera con riesgo de crédito en Etapa 2 o Etapa 3 por la propia reestructura o renovación, el saldo total del crédito consolidado es traspasado a la categoría que correspondería al crédito objeto de consolidación con mayor riesgo de crédito.

Los créditos clasificados en el nivel de riesgo de crédito Etapa 2 por efecto de una reestructura son evaluados periódicamente a fin de determinar si existe un incremento en su riesgo que origine que deben ser traspasados a la Etapa de riesgo de crédito 3, conforme a lo descrito en el primer párrafo de la subsección "Etapa 3" de esta nota.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 28 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Los créditos no son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, por efecto de su reestructuración, si a la fecha de o la operación presentan cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las condiciones originales del crédito mencionados a continuación, no se reclasificarán al rubro de Etapa 3.

Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.

Tasa de interés: cuando se mejora al acreditado la tasa de interés pactada.

Moneda o unidad de cuenta: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda o unidad de cuenta.

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 permite la omisión de pago en período alguno.

Ampliación de la línea de crédito: sólo en el caso de créditos de consumo otorgados mediante líneas de crédito revolventes.

Pago sostenido del crédito.

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado cubre el monto total exigible de principal e intereses sin retraso, conforme a lo siguiente:

Cuando se trata de amortizaciones menores o iguales a 60 días, se cubre un mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito.

(Continúa)

Para créditos con períodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.

En el caso de créditos con amortizaciones que cubran períodos mayores a 90 días naturales, se realiza el pago de una amortización.

Cuando los períodos de amortización pactados en la reestructura o renovación no son homogéneos, se considera el número de períodos que representan el plazo más extenso, conforme a lo descrito previamente.

Para reestructuras en las que se modifica la periodicidad del pago a períodos menores, para la determinación de si existe pago sostenido, se considera el número de amortizaciones que correspondería al esquema original del crédito.

En los casos de los créditos adquiridos al INFONAVIT, el Grupo está obligado 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 los créditos bajo el esquema de REA.

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan el traspaso a cartera con riesgo Etapa 2 o Etapa 3, para determinar las amortizaciones requeridas para la existencia de pago sostenido, se considera el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalgan al plazo más extenso.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 29 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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:

El acreditado ha cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,  
Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo.

Los créditos que se reestructuran o renuevan en más de una ocasión, que se ha pactado con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, acreditarán pago sostenido del crédito cuando:

El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura ó renovación;  
Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al nuevo esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo, y  
La entidad cuenta con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor. En el caso de créditos comerciales, tales elementos están debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

(Continúa)

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados, distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido. Tal es el caso de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a los periodos requeridos conforme al primer párrafo de esta subsección.

Los créditos que por efecto de una reestructura o renovación son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, en todos los casos permanecen un mínimo de tres meses en dicha etapa hasta acreditar pago sostenido. Se deberá de acreditar el pago sostenido en cada etapa de riesgo de crédito y en consecuencia ser traspasados a la etapa inmediata siguiente con menor riesgo de crédito. Lo anterior con excepción de los créditos con pago de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, en los que se aplica lo descrito previamente para estos casos.

En todo caso, para que el Grupo demuestre que existe pago sostenido, además de asegurarse de que el acreditado cumpla con los lineamientos de pago sostenido indicados en los párrafos anteriores, deberá tener a disposición de la Comisión 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 es lo que se señala a continuación:

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

Reconocimiento de ingresos, costos y gastos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 30 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

El interés efectivo determinado mediante la aplicación de la tasa de interés efectiva se reconoce conforme se devenga. El interés efectivo incluye el devengamiento de los intereses de cartera y la amortización de comisiones por el otorgamiento de crédito, ambos presentados en el rubro de "Ingresos por intereses", así como la amortización de los costos de transacción por el otorgamiento de crédito presentada en el rubro de "Gastos por intereses".

Para determinar la tasa de interés efectiva, el Grupo realiza lo siguiente:

Determina el monto de los flujos de efectivo futuros estimados a recibir. Consiste en sumar el principal y los intereses que se recibirán conforme al esquema de pagos del crédito, durante el plazo contractual, o en un plazo menor si es que existe una probabilidad de pago antes de la fecha de vencimiento u otra circunstancia que justifique la utilización de un plazo menor, para lo cual el Grupo documenta la evidencia correspondiente.

Determinar el interés efectivo. Es el resultado de restar a los flujos de efectivo futuros estimados a recibir, el monto neto financiado determinado como se describe en el numeral 1 del segundo párrafo de esta nota.

Determinar la tasa de interés efectiva. Representa la relación entre el interés efectivo y el monto neto financiado.

(Continúa)

Cuando conforme a los términos del contrato, la tasa de interés se modifica periódicamente, la tasa de interés efectiva calculada al inicio del período, es la que se utiliza durante toda la vida del crédito, es decir, no se determina nuevamente para cada período.

Existe la presunción de que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito pueden ser confiablemente estimados, lo que sucede en la mayoría de las circunstancias; sin embargo, en aquellos casos en los que no sea posible estimar confiablemente los flujos de efectivo futuros o la vida estimada del o de los créditos, el Grupo utiliza los flujos de efectivo contractuales documentando las circunstancias y hechos que llevaron a dicha conclusión, previa autorización del Comité de Crédito.

Las comisiones y costos de transacción se amortizan contra los resultados del ejercicio por el período correspondiente al plazo de la línea de crédito asociada. Si la línea de crédito se cancela, el saldo pendiente por amortizar se reconoce totalmente en resultados.

Las comisiones reconocidas con posterioridad al otorgamiento de crédito que se generan como parte del mantenimiento de dichos créditos, así como las que se cobran con motivo de créditos no colocados, se reconocen contra los resultados del ejercicio conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito se reconocen inicialmente como un crédito diferido y se amortizan en un período de 12 meses contra los resultados del ejercicio, en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

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 Grupo aplica la NIIF 15 "Ingresos provenientes de contratos con clientes" el cual incorpora el reconocimiento de ingresos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 31 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

derivados de programas de fidelización con clientes. 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.

Criterios contables especiales derivado de las inundaciones y daños ocasionados por el Huracán OTIS

Mediante los oficios P-307/2023 de fecha 27 de octubre de 2023 y P-318/2023 de fecha 10 de noviembre de 2023, la Comisión emitió con carácter temporal, los criterios contables especiales (CCE) para las instituciones de crédito respecto de la cartera crediticia de consumo, vivienda y comercial, para los clientes que hayan sido afectados en las zonas indicadas por la autoridad competente en la Declaratoria de Emergencia, o bien, a las señaladas en la Declaratoria de Desastre Natural, y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 o Etapa 2 al 24 de octubre de 2023. El plazo para realizar los trámites de renovación o reestructuración finalizarán a más tardar el 30 de abril de 2024.

(Continúa)

El programa de apoyo consiste en otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 6 meses y será aplicable a los siguientes tipos de crédito y clientes:

Créditos a la vivienda con garantía hipotecaria.

Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).

Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial (PYME).

Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.

Microcréditos individuales o grupales.

Los siguientes créditos no se consideraron como reestructuras y/o renovaciones y permanecieron en la misma categoría de riesgo de crédito:

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",

Créditos con "pagos periódicos de principal e intereses" y,

Créditos que desde su inicio se estipule su carácter de revolventes.

Los créditos que sean reestructurados o renovados al amparo de los CCE fueron reportados a las Sociedades de Información Crediticias (SIC) como sigue:

Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 al 24 de octubre de 2023, y que no cuenten con días de atraso, no presentaron clave de observación alguna en las SIC.

Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 2 al 24 de octubre de 2023, y que cuenten con días de atraso, presentaron la clave de observación RA en las SIC.

Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 con posterioridad al 24 de octubre de 2023, presentaron la clave de observación RA en las SIC.

---

En el caso que las reestructuras o renovaciones incluyan quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, el Grupo podrá diferir la constitución de estimaciones preventivas para riesgos crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una estimación por la diferencia en un período que no exceda de 12 meses.

Partidas diferidas

Se integra por el monto neto entre costos de transacción y comisiones por otorgamiento de crédito.

(Continúa)

Estimación preventiva para riesgos crediticios

La determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios de cada categoría de la cartera de crédito se realiza con base en las metodologías generales establecidas en las Disposiciones, las cuales se basan en el enfoque de Pérdida Esperada, que se determina multiplicando la Probabilidad de Incumplimiento (PI) por el producto de la Severidad de la Pérdida en caso de Incumplimiento (SP) y la Exposición al Incumplimiento (EI).

Tratándose de líneas de crédito comprometidas no dispuestas, el Grupo reconoce la estimación correspondiente al saldo no dispuesto conforme a las Disposiciones, lo cual también es aplicable a las cartas de crédito que el Grupo ha emitido.

La PI es la probabilidad expresada como porcentaje de que ocurra cualquiera o ambas de las siguientes circunstancias con relación a un deudor específico y determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones:

El deudor se encuentra en situación de mora durante 90 días naturales o más respecto a cualquier obligación crediticia frente a la Institución, o bien dicha obligación crediticia cumple con los supuestos para ser clasificada con riesgo de crédito Etapa 3, descritos anteriormente (ver nota 31).

Se considera probable que el deudor no abone la totalidad de sus obligaciones crediticias frente al Grupo.

La SP en caso de Incumplimiento corresponde a la intensidad de la pérdida en caso de incumplimiento expresada como porcentaje de la EI, una vez tomados en cuenta el valor de las garantías y los costos asociados a los procesos de realización (judiciales, administrativos de cobranza y de escrituración, entre otros); es determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

La EI es la posición esperada, bruta de reservas, de la operación de crédito si se produce el incumplimiento del deudor. La EI no puede ser inferior a la cantidad dispuesta de la operación al momento del cálculo del requerimiento de reservas ni de capital; se determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

En su caso, el Grupo determina o reconoce las estimaciones adicionales, las cuales se constituyen para cubrir riesgos que no se encuentran previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia, y sobre las que previo a su constitución, el Grupo informa a la Comisión sobre lo siguiente:

---

origen de las estimaciones;  
metodología para su determinación;  
monto de estimaciones por constituir, y  
tiempo que se estima serán necesarias.

(Continúa)

Sobre los créditos con riesgo de crédito en Etapa 3, en los que en su reestructuración se acuerda la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, el Grupo reconoce una estimación por el 100% de dichos intereses, la cual cancela cuando existe evidencia de pago sostenido.

Cartera de crédito comercial

El cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito comercial se realiza conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos, así como su clasificación previa en cinco diferentes grupos, según a quienes se han otorgado:

I. Entidades federativas y municipios.

II. Proyectos con fuente de pago propia,

III. Fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, no incluidos en la fracción anterior, así como esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados".

IV. Entidades financieras.

V. Personas morales no incluidas en las fracciones anteriores y físicas con actividad empresarial que, a su vez, se divide en los siguientes subgrupos:

Con ingresos netos o ventas netas anuales menores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Con ingresos netos o ventas netas anuales iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Para el cálculo de la PI de los créditos comerciales se realiza de acuerdo con las Disposiciones, conforme a cada uno de los grupos descritos anteriormente, que consiste en evaluar factores cuantitativos y cualitativos del acreditado y asignarles un puntaje crediticio, el cual es totalizado y utilizado para calcular la PI.

Para el cálculo de la SP, si los créditos carecen de cobertura de garantías reales, personales o derivados de crédito, se determina conforme a los meses transcurridos de atraso, dependiendo del grupo al que pertenecen, y considerando si son o no créditos subordinados o sindicados en los que el Grupo es subordinado respecto de otros acreedores; asimismo, se considera la determinación de la SP mediante un cálculo diferenciado para los créditos de acreditados que han sido declaradas en concurso mercantil. En caso de que los créditos cuenten con garantías reales, garantías personales y seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación de la SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito. Para la cartera de crédito que cuenta con el beneficio de un esquema de cobertura de paso y

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 34 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

medida, el cálculo de la SP considera dicha cobertura.

(Continúa)

La EI, en el caso de líneas crédito no comprometidas que son cancelables incondicionalmente o que permiten la cancelación automática en cualquier momento y sin previo aviso del Grupo, corresponde al saldo insoluto del crédito. Para líneas de crédito distintas a las mencionadas anteriormente, la determinación de la EI se realiza conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Cartera hipotecaria y de vivienda

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito hipotecaria de vivienda se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

El cálculo se realiza utilizando las cifras correspondientes al último día de cada mes constituyendo la calificación de reserva en crédito por crédito.

Asimismo, se consideran principalmente, factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) atraso, vi) información proveniente de las sociedades de información crediticia, vii) ROA, viii) REA y ix) prórroga.

En caso de que los créditos cuenten con seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito.

El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la PI por la SP y la EI o las diferentes reglas en las Disposiciones.

Cartera de consumo

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito de consumo se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

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 principalmente, 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 Grupo, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia; así como, viii) antigüedad del acreditado en el Grupo y ix) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia. El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento o las diferentes reglas establecidas en las Disposiciones.

La EI, en el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, se determina conforme a lo establecido en las Disposiciones.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 35 / 53  
CONSOLIDADO  
Impresión Final

(Continúa)

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a la cartera crediticia de consumo no revolvente considera principalmente, lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) atraso, (iv) antigüedad del acreditado en el Grupo, (v) antigüedad del acreditado con otras instituciones, (vi) monto a pagar al Grupo, (vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, (viii) saldo reportado en las sociedades de información crediticia, (ix) endeudamiento (xi) importe original del crédito, (xii) saldo del crédito y xiii) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia.

Grado de riesgo de la estimación preventiva para riesgos crediticios

Las reservas preventivas constituidas por el Grupo son clasificadas conforme a su grado de riesgo, de acuerdo con la tabla a continuación:

Rangos de porcentaje de estimación preventiva para riesgos crediticios

Consumo

Grado de riesgo No revolvente Tarjeta de crédito y otros créditos revolventes Hipotecario y de vivienda Comercial  
De A De A De A De A

A-1-2.0%-3.0%-0.50%-0.90%  
A-22.01%3.0%3.01%5.0%0.501%0.75%0.911.5%  
B-13.01%4.0%5.01%6.5%0.7511.0%1.512.0%  
B-24.01%5.0%6.51%8.0%1.0011.5%2.012.5%  
B-35.01%6.0%8.01%10.0%1.5012.0%2.515.0%  
C-16.01%8.0%10.01%15.0%2.0015.0%5.0110.0%  
C-28.01%15.0%15.01%35.0%5.00110.0%10.0115.5%  
D15.01%35.0%35.01%75.0%10.00140.0%15.5145.0%  
E35.01% 100%75.01%100%40.001100%45.01100%

Castigos, eliminaciones y recuperaciones de cartera de crédito

El Grupo tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo a plazos establecidos de 6 y 60 meses, respectivamente que determinan la imposibilidad práctica de recuperación. El castigo se reconoce cancelando el saldo del crédito que determine la Administración, contra la estimación preventiva para riesgo crediticios. Cuando el crédito a castigar excede el monto de la estimación, antes de efectuar el castigo, el Grupo reconoce una estimación hasta por el monto de la diferencia.

En todo caso, el Grupo cuenta con evidencia de las gestiones formales de cobro que se han ejercido respecto de estos créditos, así como de los elementos que acreditan la imposibilidad práctica de recuperación del crédito de acuerdo con sus políticas internas establecidas en el manual de crédito.

El Grupo podrá optar por eliminar de su activo aquellos créditos con riesgo de crédito etapa 3 que se encuentren provisionados al 100% aun cuando no cumplan con las condiciones para ser castigados. Para tales efectos, el Grupo deberá cancelar el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios.

(Continúa)

Cualquier recuperación derivada de créditos previamente, castigados o eliminados es reconocida en los resultados consolidados del ejercicio dentro del rubro de "Estimación

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 36 / 53

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

preventiva para riesgos crediticios", salvo que las recuperaciones provengan de pagos en especie, cuyo tratamiento se realiza conforme a las políticas establecidas para Bienes Adjudicados en la nota 3(s).

Los costos y gastos incurridos por la recuperación de cartera de crédito deberán reconocerse como un gasto dentro del rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera

Las quitas sobre el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total que el Grupo realice a los acreditados se realizarán cancelando el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios asociada al crédito y, si esta es menor al monto perdonado, el Grupo previamente constituye estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

La cancelación de la estimación preventiva para riesgos crediticios sobre las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera, es aplicable a los montos perdonados derivado de incrementos en el riesgo crédito, en caso contrario deberán disminuirse de los ingresos que le dieron origen.

Otras cuentas por cobrar, neto

Las cuentas por cobrar reconocidas en este rubro no tienen interés ya sea explícito o implícito: por lo tanto, incluyen:

cuentas por cobrar de corto plazo; y  
otras cuentas por cobrar de corto plazo

No deberán incluirse las cuentas por cobrar derivadas de las operaciones a que se refieren:

los criterios B-3 "Reportos", B-4 "Préstamos de Valores" y B-6 "Cartera de Crédito" emitidos por la Comisión;  
las correspondientes a los derechos de cobro definidos en el criterio "B-6"; y  
las cuentas por cobrar en el rubro de otras cuentas por cobrar provenientes de operaciones de arrendamiento operativo.

Las otras cuentas por cobrar se integran de las cuentas por cobrar liquidadoras por operaciones de venta de divisas, inversiones en valores, reportos, préstamo de valores, derivados y por emisión de títulos, así como de los deudores de cuentas de margen, deudores por colaterales otorgados en efectivo por operaciones con valores, crédito y derivados realizadas en mercados OTC. Asimismo, incluye los deudores diversos por premios, comisiones y derechos por cobrar sobre operaciones vigentes no crediticias, partidas asociadas a operaciones crediticias, saldos a favor de impuestos acreditables, préstamos y otros adeudos del personal, amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas y otros deudores.

Las cuentas por cobrar se deben valuar en su reconocimiento inicial al precio de la transacción (la contraprestación a la que el Grupo considera tener derecho de cobro a cambio de transferir el control sobre los bienes o servicios a un cliente) en el momento de considerarse devengada la operación que le dio origen, lo cual ocurre cuando, se transfiera el control sobre los bienes o servicios acordados con el cliente a cambio de una contraprestación, en acuerdo con los términos del contrato celebrado.

(Continúa)

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 37 / 53

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Las cuentas por cobrar deben incluir los impuestos y derechos trasladables al cliente y cualquier otro cobro al cliente por cuenta de terceros. El Grupo debe reconocer un pasivo por el monto de cobro por cuenta de terceros incluidos en las cuentas por cobrar.

Las cuentas por cobrar denominadas en moneda extranjera se deben reconocer inicialmente en la moneda funcional, utilizando el tipo de cambio histórico; que es aquél con el cual el Grupo pudo haber realizado las cuentas por cobrar a la fecha de la transacción.

Las cuentas por cobrar deben valuarse en su reconocimiento posterior al precio de la transacción pendiente de cobro.

Estimación para pérdidas crediticias esperadas

La estimación de pérdidas crediticias esperadas se debe reconocer desde su inicio en las cuentas por cobrar, afectando resultados del ejercicio dentro del rubro "Otros ingresos (egresos) de la operación".

En su reconocimiento posterior, se deben reconocer los cambios requeridos en la estimación para pérdidas crediticias esperadas por las modificaciones en las expectativas de las pérdidas crediticias esperadas que surjan en cada período en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Otros ingresos (egresos) de la operación".

La estimación para pérdida crediticias esperadas se debe determinar a través del juicio profesional del Grupo, considerando la evaluación de las pérdidas esperadas por el deterioro de las cuentas por cobrar, utilizando factores como la experiencia histórica de las pérdidas crediticias, condiciones actuales y pronósticos razonables y sustentables de los diferentes eventos futuros cuantificables que pudieran afectar el flujo de efectivo futuro por recuperar de las cuentas por cobrar.

La estimación para incobrabilidad para cuentas por cobrar comerciales se reconoce desde el momento en que se devenga el ingreso, con base en las pérdidas crediticias esperadas.

Desde el reconocimiento inicial, deberá considerarse el valor del dinero en el tiempo, por lo que, si el efecto del valor presente de la cuenta por cobrar es importante en atención a su plazo, deberá ajustarse con base en dicho valor presente.

Por lo anterior la Administración del Grupo ha desarrollado el procedimiento para el cálculo de pérdida crediticia esperada para constituir dicha estimación basado en la siguiente ecuación:

$$PE = \sum_{i=1}^n EI_{ij} * TP_j$$

(Continúa)

En donde:

PE: Pérdida esperada;

EI<sub>ij</sub>: Exposición al incumplimiento de la operación i en el grupo de atraso j;

TP<sub>j</sub>: Tasa de pérdida del grupo de atraso j;

j: j-ésimo grupo de atraso;

n: El número de operaciones.

La tasa de pérdida se calcula con ayuda del análisis de la proporción de saldo que se ha pagado en cada bucket de atraso, de esta manera, se analiza la concentración del saldo por bucket de atraso y con ello, definir el umbral de deterioro y la asignación

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 38 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

del 100% de pérdida.

El Grupo puede determinar la pérdida esperada de manera individual para deudores que tienen características particulares, en caso de que sea impráctico, éstos se califican agrupándolos por características homogéneas o comunes.

En este sentido, el Grupo ha desarrollado una metodología en donde se determinó impráctico realizar una evaluación individual de las cuentas por cobrar, por lo cual se derivaron de modelos estadísticos desarrollados con datos históricos de las cuentas por cobrar en donde se calificaron y agruparon por características comunes y homogéneas en términos de riesgo en donde basados en elementos clave para la medición de la pérdida esperada crediticia se determinaron las siguientes variables: Tasa de pérdida (TP) y Exposición al incumplimiento (EI).

Para estimar los parámetros y aplicarlos de forma colectiva, los activos que integran las cuentas por cobrar fueron agrupados de acuerdo con los días de atraso que poseen al momento de la estimación del deterioro, asignándoles un grupo de morosidad para lo cual se identificó en el caso particular del Grupo, dicho período es de 120 días, conforme al proceso de cobro.

Cuando el Grupo considere nula la probabilidad de cobro de una cuenta por cobrar, debe dar de baja el valor neto en libros de la cuenta por cobrar, aplicando la cuenta por cobrar a la estimación para pérdidas crediticias esperadas. Si la estimación fuera insuficiente, debe ajustarse de inmediato afectando los resultados del ejercicio en el rubro "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Las cuentas por cobrar, en su caso, se presentan deducidas de la estimación para pérdidas crediticias esperadas dentro del estado de situación financiera consolidado en el rubro "Otras cuentas por cobrar (neto)".

Otras consideraciones de la estimación de pérdidas crediticias esperadas para otras cuentas por cobrar:

Los sobregiros de cuentas de cheques de clientes que no cuentan con líneas de crédito de sobregiro, se clasifican, al momento de su reconocimiento, como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

(Continúa)

El Grupo no constituye estimación de pérdidas crediticias esperadas por:

Saldos a favor de impuestos,  
Impuesto al valor agregado acreditable y  
Cobros a clientes por cuenta de terceros.

No es objeto de este inciso las cuentas por cobrar con riesgo operacional, que su eliminación se reconoce en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Arrendamientos

Actuando como arrendador

Clasificación de los arrendamientos

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 39 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

El Grupo clasifica cada uno de sus arrendamientos como un arrendamiento operativo o financiero. Se consideran como arrendamientos financieros todos los créditos que otorgue la entidad para operaciones de arrendamiento financiero, que son aquéllos en donde el Grupo transfiere al arrendatario sustancialmente todos los riesgos y beneficios inherentes a la propiedad del activo subyacente, en caso de contrario se consideran como operativos.

Actuando como arrendatario

Al inicio de un contrato, el Grupo evalúa si un contrato es, o contiene, un contrato de arrendamiento. Un contrato es, o contiene, un arrendamiento si el contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado por un período de tiempo a cambio de una contraprestación. El Grupo evalúa si un contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado de manera implícita o explícita en un contrato.

Al comienzo o en la modificación de un contrato que contiene un componente de arrendamiento, el Grupo asigna la contraprestación en el contrato a cada componente de arrendamiento o servicio sobre la base de sus precios independientes relativos.

El Grupo reconoce un activo por derecho de uso y un pasivo por arrendamiento en la fecha de inicio del arrendamiento. El activo por derecho de uso se mide inicialmente al costo, que comprende el monto inicial del pasivo por arrendamiento ajustado por cualquier pago de arrendamiento realizado en o antes de la fecha de inicio, más los costos directos iniciales incurridos y una estimación de los costos para desmantelar o para restaurar el activo subyacente o el sitio en el que se encuentra, menos los incentivos de arrendamiento recibidos.

El activo por derecho de uso se deprecia posteriormente utilizando el método de línea recta desde la fecha de inicio hasta el final del plazo del arrendamiento, a menos que el arrendamiento transfiera la propiedad del activo subyacente al Grupo al final del plazo del arrendamiento o el costo del activo por derecho de uso refleja que el Grupo ejercerá una opción de compra. En ese caso, el activo por derecho de uso se depreciará a lo largo de la vida útil del activo subyacente, que se determina sobre la misma base que los de propiedades y equipo. Además, el activo por derecho de uso se reduce periódicamente por pérdidas por deterioro, si corresponde, y se ajusta por ciertas nuevas valuaciones del pasivo por arrendamiento como cambios en el monto de la renta por ajuste de inflación.

(Continúa)

El pasivo por arrendamiento se mide inicialmente al valor presente de los pagos de arrendamiento que no se pagan en la fecha de inicio, descontados utilizando la tasa de interés implícita en el arrendamiento o, si esa tasa no puede determinarse fácilmente, la tasa incremental de financiamiento del Grupo o la tasa libre de riesgo determinada con referencia al plazo del arrendamiento. Generalmente, el Grupo usa su tasa de interés incremental como tasa de descuento.

El Grupo determina su tasa incremental de financiamiento obteniendo tasas de interés de varias fuentes de financiamiento externo y realiza ciertos ajustes para reflejar los términos del arrendamiento (como plazo del arrendamiento y moneda en que se encuentran denominados los pagos) y el tipo de activo arrendado.

Los pagos de arrendamiento incluidos en la valuación del pasivo por arrendamiento comprenden lo siguiente:

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 40 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

pagos fijos, incluidos los pagos en sustancia fijos;  
pagos de arrendamiento variables que dependen de un índice o una tasa, inicialmente valuados utilizando el índice o la tasa en la fecha de inicio;  
importes que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; y  
el precio de ejercicio bajo una opción de compra que el Grupo está razonablemente seguro de ejercer, los pagos de arrendamiento en un período de renovación opcional si el Grupo está razonablemente seguro de ejercer una opción de extensión y las sanciones por la terminación anticipada de un arrendamiento a menos que el Grupo esté razonablemente seguro de no terminar antes de tiempo.

El pasivo por arrendamiento se valúa al costo amortizado utilizando el método de interés efectivo. Se vuelve a valorar bajo las siguientes condiciones:

hay un cambio en los pagos de arrendamiento futuros que surgen de un cambio en un índice o tasa;  
hay un cambio en la estimación del Grupo, del monto que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; si el Grupo cambia su evaluación de si ejercerá una opción de compra, extensión o terminación o  
hay un pago en sustancia fijo de arrendamiento modificado.

Cuando el pasivo por arrendamiento se vuelve a valorar de esta manera, se realiza un ajuste correspondiente al importe en libros del activo por derecho de uso, o se registra en resultados si el importe en libros del activo por derecho de uso se ha reducido a cero.

El Grupo presenta activos de derecho de uso que no cumplen con la definición de propiedad de inversión en el rubro "Activos por derecho de uso de propiedades, mobiliario y equipo", y los pasivos por arrendamiento en el rubro "Pasivo por arrendamiento", ambos en el estado de situación financiera consolidado.

Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

El Grupo ha decidido no reconocer los activos por derecho de uso y los pasivos por arrendamientos para arrendamientos de activos de bajo valor y arrendamientos a corto plazo, incluidos equipos de TI. El Grupo reconoce los pagos de arrendamiento asociados con estos arrendamientos como un gasto en línea recta durante el plazo del arrendamiento.

(Continúa)

Bienes adjudicados

Los bienes adjudicados o recibidos mediante dación en pago que no son destinados para uso del Grupo, se reconocen en la fecha que causa ejecutoria el auto de aprobación del remate mediante el cual se decreta la adjudicación, o tratándose de bienes recibidos mediante dación en pago, en la fecha que se firma la escritura de dación, o se haya formalizado la transmisión de propiedad del bien.

El reconocimiento de bienes adjudicados se realiza como sigue:

al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación, es decir, sin deducir la estimación preventiva para riesgos crediticios que se haya reconocido hasta esa fecha, y el valor neto de realización de los activos recibidos,

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 41 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

cuando la intención de la entidad es vender dichos activos para recuperar el monto a cobrar; o

al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación o el valor razonable del activo recibido, cuando la intención de la entidad es utilizar el activo adjudicado para sus actividades.

En la fecha de registro del bien adjudicado o recibido mediante dación en pago, el valor del activo que dio origen a la adjudicación, así como su respectiva estimación preventiva para riesgos crediticios que se tuviera constituida, se dan de baja del estado de situación financiera consolidado por el total del activo neto de la estimación, deducido de los pagos parciales en especie en caso de cartera de crédito, o de los cobros o recuperaciones cuando se trata de derechos de cobro.

La diferencia entre el valor del activo que dio origen a la adjudicación, neto de estimaciones, y el valor del bien adjudicado determinado conforme a lo descrito en el segundo párrafo de esta nota, se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Valuación de bienes adjudicados

Los bienes adjudicados se valúan conforme al tipo de bien que se trate, registrando su valuación contra los resultados del ejercicio como "Otros ingresos (egresos) de la operación".

El Grupo reconoce una estimación de deterioro por las pérdidas de valor por el paso del tiempo conforme a las disposiciones, reconociéndolo en resultados como "Otros ingresos (egresos) de la operación". La determinación de las reservas por tenencia de bienes muebles o inmuebles, adjudicados o recibidos en dación en pago por el transcurso del tiempo, se determina, conforme a lo que se muestra en la siguiente tabla.

Porcentaje de reserva

Meses transcurridos a partir de la adjudicación o dación en pago Bienes inmuebles Bienes muebles, derechos de cobro e inversiones en valores

Hasta 6 meses 0%0%

Más de 6 y hasta 12 10%10%

Más de 12 y hasta 18 20%20%

Más de 18 y hasta 24 45%45%

Más de 24 y hasta 30 60%60%

Más de 30 y hasta 36 100%100%

Más de 36 y hasta 42 100%100%

Más de 42 y hasta 48 100%100%

Más de 48 y hasta 54 100%100%

Más de 54 y hasta 60 100%100%

Más de 60 100%100%

(Continúa)

Al momento de la venta de los bienes adjudicados, el diferencial entre el precio de venta y el valor en libros del bien adjudicado, neto de estimaciones, se reconoce directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Traspaso de bienes adjudicados para uso propio del Grupo

Cuando el Grupo opta por traspasar los bienes adjudicados para uso propio, el traspaso se realiza al rubro del estado de situación financiera consolidado que le corresponda según el activo de que se trate, cumpliendo con el hecho de que los bienes son

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 42 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

utilizados para la realización de su objeto y se efectúe de acuerdo con sus estrategias de inversión y fines que se encuentran previamente establecidos en sus manuales, no existiendo la posibilidad de que dichos bienes vuelvan a considerarse como adjudicados.

Propiedades, mobiliario y equipo, neto

Las propiedades, 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 Grupo de los activos correspondientes.

El monto a depreciar de las propiedades, 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 Grupo evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichas propiedades, mobiliario y equipo.

El Grupo evalúa periódicamente los valores netos en libros de las propiedades, 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 Grupo 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.

Inversiones permanentes

Las inversiones permanentes en las que el Grupo tiene influencia significativa o control se valúan utilizando el método de participación, a través del cual se reconoce la participación en los resultados y en el capital contable de estas entidades utilizando los estados financieros a la misma fecha y por el mismo período que el Grupo. Se considera que una empresa es subsidiaria del Grupo, cuando se tiene el poder de dirigir sus actividades relevantes, está expuesta o tiene derecho, a rendimientos variables procedentes de esa participación y tiene la capacidad presente de afectar esos rendimientos a través de su poder sobre ésta.

Las otras 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 (egresos) de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de períodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

(Continúa)

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:

El órgano del Grupo que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 43 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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.

Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.

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 la entidad celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del período 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 de la entidad y existen evidencias suficientes de que la entidad se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.

Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.

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.

## Deterioro de activos de larga duración

El Grupo evalúa periódicamente el valor neto en libros de los activos de larga duración para determinar la existencia de indicios de que dicho valor excede su valor de recuperación. El valor de recuperación representa el monto de los ingresos netos potenciales que se espera razonablemente obtener como consecuencia de la utilización o realización de dichos activos.

Si se determina que el valor neto en libros excede el valor de recuperación, el Grupo registra las estimaciones necesarias. Cuando se tiene la intención de vender los activos, éstos se presentan en los estados financieros consolidados a su valor neto en libros o de realización, el menor. Los activos y pasivos de un grupo clasificado como disponible para la venta se presentan por separado en el estado de situación financiera consolidado.

## Pagos anticipados y otros activos, neto

Los pagos anticipados representan aquellas erogaciones efectuadas por el Grupo en donde no han sido transferidos los beneficios y riesgos inherentes a los bienes que está por adquirir o a los servicios que está por recibir. Los pagos anticipados se reconocen como un activo por el monto pagado, siempre que sea probable que los beneficios económicos futuros que estén asociados con tales pagos fluyan hacia el Grupo. Una vez recibidos los bienes y/o servicios, relativos a los pagos anticipados, estos se reconocen como un activo o como un gasto en el estado consolidado de resultado integral, según sea la naturaleza respectiva.

(Continúa)

Los pagos anticipados y otros activos incluyen erogaciones realizadas principalmente por gastos de licencias y anticipo de PTU. Al 31 de diciembre de 2023 y 2022, el monto asciende a \$2,636 y \$3,003, respectivamente.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 44 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Impuestos a la utilidad y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU)-

El impuesto a la utilidad y la PTU causados en el año, se determinan conforme a las disposiciones fiscales y legales vigentes.

El impuesto a la utilidad diferidos y la PTU diferida se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad y PTU diferidos (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 en el caso de impuestos a la utilidad, por las pérdidas fiscales por amortizar y otros créditos fiscales por recuperar.

Los activos y pasivos por impuesto a la utilidad y PTU diferidos 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 y PTU diferidos se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por PTU diferida se reconoce en el rubro de "Pagos anticipados y otros activos, neto", en tanto que la PTU causada se reconoce en el rubro de "Pasivo por Beneficios a los empleados" en el estado de situación financiera consolidado.

El activo por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se evalúan periódicamente creando, en su caso, una 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 ORI. La PTU causada y diferida se incorporará dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción" en el estado consolidado de resultado integral.

## Activos intangibles

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 Grupo.

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.

(Continúa)

## Captación tradicional

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del público en general y los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos en moneda nacional, extranjera o UDIS, mismos que se integran como se describe a continuación:

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 45 / 53

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Depósitos de exigibilidad inmediata. Incluyen a las cuentas de cheques, cuentas de ahorro, a los depósitos en cuenta corriente, entre otros.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes del Grupo, que no cuentan con una línea de crédito para tales efectos, se clasifican como adeudos vencidos en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y el Grupo constituye simultáneamente a dicha clasificación una pérdida crediticia esperada por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

Depósitos a plazo. Incluyen, entre otros, a los certificados de depósito retirables en días preestablecidos, aceptaciones bancarias y pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento captados del público en general y a través de operaciones en el mercado de dinero, estos últimos referidos a depósitos a plazo realizados con otros intermediarios financieros, así como con tesorerías de empresas y de entidades gubernamentales.

Títulos de crédito. Se integran de, entre otros, los bonos bancarios y los certificados bursátiles.

Cuenta global de captación sin movimientos. Incluye el principal y los intereses de los instrumentos de captación que no tengan fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven en forma automática, así como las transferencias o las inversiones vencidas y no reclamadas.

Si en el transcurso de tres años contados a partir de que los recursos se depositen en la cuenta global de captación sin movimientos, 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 Grupo 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 anteriormente descrito.

Los títulos colocados a descuento que no devenguen intereses (cupón cero), se registran al momento de la emisión tomando como base el monto de efectivo recibido.

El Grupo deberá determinar la tasa de interés efectiva con base en lo establecido en la NIF C-19 "Instrumentos Financieros por Pagar (IFP)" y evaluar si la tasa determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso. Sólo en caso de que la tasa de interés de mercado sea sustancialmente distinta a la tasa efectiva, debe utilizarse la tasa de mercado como la tasa de interés efectiva en la valuación del instrumento, reconociendo en la utilidad o pérdida neta los efectos que se produzcan en el valor del IFP por el cambio de tasa de interés.

Los intereses de captación tradicional se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

(Continúa)

Los gastos de emisión, así como el descuento o premio en la colocación se reconocen como parte del pasivo que le dio origen, según se trate, el cual es amortizado en resultados conforme se devengue como gastos o ingresos por intereses, según corresponda, tomando en consideración el plazo del título que le dio origen en proporción al vencimiento de los títulos.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 46 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

## Obligaciones subordinadas en circulación-

Por las obligaciones subordinadas en circulación que reúnen las características establecidas por la NIF C-12 "Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital", el instrumento es clasificado como pasivo dentro del estado de situación financiera consolidado. Los intereses se reconocen conforme al método de interés efectivo en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos que se incurran para emitir un instrumento financiero que califica como un pasivo deben deducirse del monto del pasivo y deben considerarse para determinar la tasa de interés efectiva.

## Préstamos interbancarios y de otros organismos-

En este rubro se registran los préstamos directos 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, 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".

Los préstamos deberán reconocerse inicialmente al precio de la transacción, deben sumarse o restarse los costos de transacción, así como otras partidas pagadas por anticipado, tales como comisiones e intereses, el Grupo deberá determinar el valor futuro de los flujos de efectivo estimados que se pagarán por principal e intereses contractuales, durante el plazo remanente del préstamo o en un plazo menor, si es que existe una probabilidad de prepago u otra circunstancia que requiera utilizar un plazo menor.

El Grupo deberá determinar la tasa de interés efectiva, para el cálculo el Grupo debe estimar los flujos de efectivo esperados considerando todos los términos contractuales del IFP (tales como prepago, extensión, reembolso anticipado y otras opciones similares), adicionalmente, debe evaluar si la tasa de interés efectiva determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso la entidad.

Si el Grupo recibe un préstamo con una tasa de interés contractual que esté sustancialmente fuera de mercado, pero se paga una comisión por adelantado al inicio del crédito al determinar la tasa de interés efectiva con base en los anteriores párrafos, y debe tomarse en cuenta dicha comisión.

## Acreedores diversos y otras cuentas por pagar-

Los acreedores diversos y otras cuentas por pagar incluyen el pasivo por beneficios a los empleados de corto y largo plazo, provisiones y otras cuentas por pagar por la prestación de servicios bancarios comisiones por pagar, acreedores por adquisición de activos, dividendos por pagar, IVA trasladado y otros impuestos y derechos por pagar.

(Continúa)

Los pasivos del Grupo se valúan y reconocen en el estado de situación financiera consolidado, para tal efecto deberán cumplir con la característica de ser una obligación presente, donde la transferencia de activos o presentación de servicios sea virtualmente ineludible, surja como consecuencia de un evento pasado y su cuantía y

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 47 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

vencimiento se encuentran claramente establecidos.

El Grupo reconoce una provisión cuando su cuantía o vencimientos son inciertos y se cumplen las siguientes condiciones: a) existe una obligación presente resultante de un evento pasado a cargo de la entidad, b) es probable que se presente la salida de recursos económicos como medio para liquidar dicha obligación y c) la obligación puede ser estimada razonablemente.

De no cumplirse las condiciones antes mencionadas, no se reconoce una provisión.

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 devengan los servicios prestados. Se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Grupo 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.

Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Grupo en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida- ver inciso (y) de esa nota y que se espera que el Grupo pague después de los doce meses de la fecha del estado de situación financiera consolidado más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que los empleados han obtenido a cambio de su servicio en el ejercicio actual y en los anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las remediones se reconocen en resultados en el período en que se devengan.

Beneficios por terminación

Se reconoce un pasivo y un costo o gasto por beneficios por terminación cuando el Grupo no tiene alternativa realista diferente que la de afrontar los pagos o no pueda retirar la oferta de esos beneficios, o cuando cumple con las condiciones para reconocer los costos de una reestructuración, lo que ocurra primero. Si no se espera que se liquiden dentro de los 12 meses posteriores al cierre del ejercicio anual, entonces se descuentan.

Beneficios post-empleo

Planes de contribución definida

La obligación neta del Grupo correspondiente a los planes de beneficios definidos por planes de pensiones y prima de antigüedad, se calcula de forma separada para cada plan, estimando el monto de los beneficios futuros que los empleados han ganado en el ejercicio actual y en ejercicios anteriores, descontando dicho monto y deduciendo al mismo, el valor razonable de los activos del plan. El Grupo mantiene 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". Las contribuciones pagadas por anticipado se reconocen como un activo en la medida en que el pago por anticipado de lugar a una reducción en los pagos a efectuar en el futuro o a un reembolso en efectivo (nota 21).

(Continúa)

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 48 / 53  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

## Planes de beneficios definidos

El Grupo 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 Grupo, 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 Grupo 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 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.

(Continúa)

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 remediones (antes ganancias y pérdidas actuariales), 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.

## 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 devengados sobre cartera en Etapa 3 se reconocen en resultados hasta que se cobran.

Los intereses y comisiones cobradas por anticipado se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a resultados conforme se devengan.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 49 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial de un crédito se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses durante la vida del crédito. Las comisiones por anualidad y renovación de productos de cartera comercial, consumo y vivienda se difieren, según corresponda, asimismo, los costos o gastos vinculados con el otorgamiento de créditos, se reconocen como un cargo diferido y se difieren durante el mismo plazo en el que se reconozcan los ingresos derivados por las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial del crédito; el seguro que en su caso sea financiado forma parte de la cartera de crédito.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento de crédito se presentan de manera neta de los costos y gastos asociados, presentándose en el rubro de otros activos, o bien de créditos diferidos y cobros anticipados según corresponda su naturaleza deudora o acreedora.

Las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos se adicionan a las comisiones originadas por el otorgamiento del crédito y se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito. Las demás comisiones se reconocen en el momento en que se generan en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Los intereses por inversiones en títulos de renta fija se reconocen en resultados conforme se devengan conforme al método de interés efectivo. Los intereses cobrados por operaciones de reporto se reconocen en resultados de acuerdo con el método de interés efectivo, a lo largo del plazo de la operación.

Las comisiones ganadas por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devengan.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes se reconocen en los resultados conforme se devengan.

(Continúa)

Concentración de negocio y crédito

Los productos del Grupo se comercializan con un gran número de clientes, sin que exista concentración importante en algún cliente específico.

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 pretende un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regula los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo. De acuerdo con dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400,000 UDIS por persona física o moral. El Grupo reconoce en resultados del ejercicio las aportaciones obligatorias al IPAB.

Las aportaciones obligatorias al IPAB se deberán cubrir mensualmente y serán por un monto equivalente a la duodécima parte del cuatro al millar, sobre el promedio mensual de los saldos diarios de sus operaciones pasivas del mes de que se trate.

Cuentas de orden

En las cuentas de orden se registran activos o compromisos que no forman parte del

---

---

estado de situación financiera consolidado del Grupo ya que no se adquieren los derechos de estos o dichos compromisos no se reconocen como pasivo de las entidades en tanto dichas eventualidades no se materialicen, respectivamente.

Compromisos crediticios:

El saldo representa el importe de cartas de crédito otorgadas por el Grupo que son consideradas como créditos comerciales irrevocables no dispuestos por los acreditados y líneas de crédito autorizadas no ejercidas.

Las partidas registradas en esta cuenta están sujetas a calificación.

Bienes en fideicomiso o mandato:

El Grupo registra en cuentas de orden las operaciones de Bienes o Fideicomisos acorde a lo siguiente:

Las que se limita al reconocimiento del patrimonio fideicomitado (activos del contrato), es decir, el valor de los bienes recibidos en fideicomiso netos de los pasivos, llevándose en registros independientes los datos relacionados con la Administración de cada fideicomiso.

Las que por sus activos y pasivos resultan de las operaciones y cuyo reconocimiento y valuación se efectúa conforme a lo dispuesto en los criterios contables específicos aplicables al Grupo.

Las pérdidas a cargo del Grupo por las responsabilidades en que haya incurrido como fiduciario, se reconocen en resultados en el período en el que éstas se conozcan, independientemente del momento en el que se realice cualquier promoción jurídica al efecto.

(Continúa)

La unidad fiduciaria mantiene contabilidades especiales por cada contrato en el sistema fiduciario, y registra en las mismas y en su propia contabilidad el dinero y demás bienes, valores o derechos que se les confíen, así como los incrementos o disminuciones, por los productos o gastos respectivos, invariablemente los saldos de las contabilidades especiales de cada contrato de fideicomiso coinciden con los saldos de las cuentas de orden en que el Grupo reconoce el patrimonio fideicomitado.

En ningún caso estos bienes estarán afectos a otras responsabilidades que las derivadas del fideicomiso mismo, o las que contra ellos corresponda a terceros de acuerdo con la Ley.

Cuando por la naturaleza de los fideicomisos establecidos en el Grupo existan activos o pasivos a cargo o a favor de este, éstos se reconocen en el estado de situación financiera consolidado, según corresponda.

En el mandato se registra el valor declarado de los bienes objeto de los contratos de mandato celebrados por el Grupo.

El reconocimiento de los ingresos por manejo de los fideicomisos se reconoce con base en lo devengado. Se suspende la acumulación de dichos ingresos, en el momento en que el adeudo por éstos presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, pudiendo volver a acumularse cuando el adeudo pendiente de pago sea liquidado en su totalidad.

En tanto los ingresos devengados por manejo de los fideicomisos se encuentren

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 51 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

suspendidos de acumulación y no sean cobrados, el control de estos se lleva en cuentas de orden. En caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

Bienes en custodia o en administración:

El efectivo y los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración se reflejan en las cuentas de orden respectivas y son valuados con base en el precio proporcionado por el proveedor de precios. Con excepción del efectivo o los activos virtuales recibidos para el pago de servicios por cuenta de terceros, debiéndose presentar en el rubro de efectivo y equivalentes de efectivo o en el de activos virtuales, según corresponda y, el pasivo que se genere, en el rubro de otras cuentas por pagar.

Los valores en custodia y administración están depositados en la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S. A. de C. V.

Los ingresos derivados de los servicios de custodia o administración reconocidos en los resultados del ejercicio se presentarán en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Colaterales recibidos por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos en operaciones de reporto y préstamo de valores actuando el Grupo como reportadora o prestataria.

Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía, cuando el Grupo actúe como reportadora o prestataria.

(Continúa)

Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito en Etapa 3:

Se registran los intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3.

Otras cuentas de registro:

Se registran principalmente garantías recibidas por el Grupo, entre otros.

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 o activos contingentes se deben reconocer en los estados financieros consolidados cuando la incorporación de beneficios económicos se convierta en probable, esto es, hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

Cuando se determine que los activos y pasivos contingentes no se tiene certeza razonable de la incorporación de beneficios económicos o de la existencia de una obligación presente, respectivamente, estos no se deben reconocer en los estados financieros consolidados, debido a que su existencia es posible mas no probable. En

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 52 / 53

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

este caso, se busca revelar estimaciones de los posibles efectos financieros en las notas a los estados financieros consolidados.

Mientras los activos y pasivos mantengan el carácter de contingentes, su control se debe llevar en cuentas de orden.

## Reclasificaciones

Al 31 de diciembre de 2022, el Grupo agrupaba en el rubro de "Pagos anticipados y otros activos, neto" dentro del activo, los gastos de emisión y el descuento por colocación de depósitos a plazo de mercado de dinero y de títulos de crédito emitidos para efectos de presentación del estado de situación financiera consolidado. La Administración del Grupo decidió reclasificarlas debido a su importancia y naturaleza al rubro de "Captación tradicional". Los efectos de estas reclasificaciones se aplicaron retrospectivamente en el estado de situación financiera consolidado al 31 de diciembre de 2022, de acuerdo con la NIF B-1, Cambios contables y correcciones de errores. Los efectos de las reclasificaciones antes mencionadas, en los rubros del estado de situación financiera consolidado, son como sigue:

Concepto Originalmente reportadas Reclasificadas retrospectivamente Cifras después de reclasificaciones

Activo

Pagos anticipados y otros activos, neto \$ 3,146 (143) 3,003

Pasivo

Depósitos a plazo

Mercado de dinero 31,238 (63) 31,175

Títulos de crédito emitidos 11,845 (80) 11,765

## Pronunciamientos normativos emitidos recientemente

### Mejoras a las NIF 2024

Durante diciembre de 2023, el CINIF ha promulgado las siguientes Mejoras a las NIF 2024, que contiene modificaciones puntuales a algunas NIF ya existentes.

NIF A-1 Marco Conceptual de las Normas de Información Financiera - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1º. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada a partir de 2024 si se adoptan anticipadamente las revelaciones de las NIF particulares aplicables al tipo de entidad que corresponda. Incluye la definición de entidades de interés público y requiere que se revele si la entidad se considera una entidad de interés público o una entidad que no es de interés público. Divide los requerimientos de revelación de las NIF en: i) revelaciones aplicables a todas las entidades en general (entidades de interés público y entidades que no lo son), y ii) revelaciones adicionales obligatorias solo para las entidades de interés público. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF C-6, Propiedades, planta y equipo/NIF D-6, Capitalización del resultado integral de financiamiento - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 53 / 53

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NIF B-2, Estado de flujos de efectivo/NIF B-6, Estado de situación financiera/ NIF B-17, Determinación del valor razonable/ NIF C-2, Inversión en instrumentos financieros/ NIF C-16, Deterioro de instrumentos financieros por cobrar/ NIF C-20, Instrumentos financieros para cobrar principal e interés/ INIF 24, Reconocimiento del efecto de la aplicación de las nuevas tasas de interés de referencia - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1º. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Cambia el término instrumentos financieros para cobrar o vender por instrumentos financieros para cobrar y vender. Cualquier cambio contable que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF C-10, Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1º. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Incluye el tratamiento contable de una cobertura de instrumentos financieros de capital cuya valuación a valor razonable se reconoce en el ORI. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF D-4, Impuestos a la utilidad - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1º. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Esta Mejora aclara cuál es la tasa aplicable que debe utilizarse para reconocer los activos y pasivos por impuestos a la utilidad causados y diferidos cuando hubo beneficios en tasas de impuestos del período para incentivar la capitalización de utilidades (utilidades no distribuidas). En estas circunstancias, los activos y pasivos por impuestos causados y diferidos deben determinarse con la tasa que será aplicable a las utilidades no distribuidas en el período, cuando se paguen como dividendos en períodos futuros. Cualquier cambio contable que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

La Administración se encuentra en proceso de evaluación para determinar los efectos de adopción de las mejoras a las NIF en los estados financieros consolidados.

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

## 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 con 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 Riesgos 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.

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 la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura", en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 3 / 24

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 o Bonos 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)  
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)

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

Subyacente\* Futuros Opciones Swaps  
MRMEMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, 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 nominales, 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 (Swaps) en especie y por diferenciales.

1). Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (Currency Swaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (Forward Starting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.

2). (MR) Mercados reconocidos

---

---

**3).(ME) Mercados extrabursátiles**

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.

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 Algortihmics 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:

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 5 / 24

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

- 
- 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 2023 y en promedio para el cuarto trimestre de 2023 es de:

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 79,21473,018

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 121,786117,275

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/Peak & Wall Street).

Instrumentos valuados a valor razonable

Product Name Underlying Product Currency Valuation Model Valuation Input Daily Pricing Source

Cross Currency Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

FX Rate VALMER

Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

Interest Rate Cap/Floor (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest Rate Curve VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

OTC Binary Interest rate Option (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's

Interest Rate Curve VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

IRS Futures TIIE Fondeo MXN Price Price VALMER

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 6 / 24

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Listed Interest Rate Swap (CME)TIIE FondeoMXN SwapInterest Rate CurveVALMER  
OTC European Index Call Spread OptionOTC European Index Call Spread Option  
MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY Call Spread OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Basket OptionEquity Index, Common StockMXN,CAD,USD,

EUR,JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-FactorCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETF and Bond Index with  
Target Volatility (Vol Under 15%)MXN,CAD,USD,

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC Index Binary Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETFMXN,CAD,USD,

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

Product NameUnderlyingProduct CurrencyValuation ModelValuation InputDaily Pricing  
Source

OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,

EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

Bond Futures(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER

Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER

Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVALMER

Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER

Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER

Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVALMER

FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,

MXN,PEN,AUD,EUR,

JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVALMER

OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 7 / 24

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER  
FX Rate  
Surface  
OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,  
EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER  
FX Rate  
Surface  
Precious Metals European OptionGold/Silver BullionGold/Silver Black 76CurveVALMER  
Price  
SurfaceBloomberg/Reuters  
Precious Metals ForwardGold/Silver BullionGold/Silver Forward OTC ModelCurveVALMER  
Price  
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,  
BRL,CLP,COP,PEN,  
AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

Instrumentos valuados a costo

Product NameUnderlyingProduct CurrencyValuation ModelValuation InputDaily Pricing  
Source  
Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY PricePriceVALMER

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.

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.

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 con base en un análisis de regresión.

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 del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

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

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 el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de diciembre 2023 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el cuarto trimestre de 2023 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 actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

Cobertura de Flujos de efectivo:

La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de "Otro Resultado Integral" (ORI) y cualquier ganancia o pérdida remanente debe tratarse como ineffectividad de cobertura y reconocerse de inmediato en la utilidad o pérdida neta.

El componente que forma parte de "Otro Resultado 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 valuar 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 valuar 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 en los 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 cubiertos 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 2023 y promedio del cuarto trimestre 2023 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 121,786,117,275

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:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

---

ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

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)NormalEscenario PosibleEscenario ProbableEscenario de Estrés  
 Gap 30d Gap Acum79,21476,08476,08276,080

Cambios en el Gap respecto al escenario normal(3,130)(3,132)(3,134)

d. 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 Black & Scholes.

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  $\gamma_1$  y  $\gamma_5$ .

$\gamma_1$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que  $\gamma_5$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio 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 portafolio 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 portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

#### Rho

Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio 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 portafolio 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 portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.

#### Theta

Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio 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, 2023:

Scotiabank

0 - 3 Años 3 - 5 Años 5 - 10 Años 10 - 30 Años Total

Swaps (54,553.88) 4,533.34 (4,476.53) (1,289.01) (55,786.08)

CCS 13,447.78 71.44 (131.67) 0.05 13,387.60

Caps&Floors (0.03) --- (0.03)

Binary Caps&Floors -----

TIIE Futures -----

Mbonds Futures -----

Total DERIVADOS (41,106.13) 4,604.78 (4,608.20) (1,288.96) (42,398.51)

1). Cifras expresadas en pesos

### Análisis de sensibilidad

#### Supuestos de Cálculo.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, 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:

- a) Bajo el escenario probable una pérdida de (34.36) Millones de pesos.
- b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (68.72) Millones de pesos.
- c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (169.69) Millones de pesos.

Los escenarios de stress 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.

Tipo Sensibilidad Instrumento Sensibilidad MTM Probable  
Shock (+/-) P&L Stress 1

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2023

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 16 / 24

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Shock(+/-)P&LStress 2  
 Shock(+/-)P&L  
 - 1pb a la tasaFuturos de TIIE  
 y Bono M - - 50.00 - 100.00 - 200.00 -  
 - 1pb a la tasaIRS & CCS & Delta Caps(0.04) (49.43)50.00 (2.12)100.00 (4.24)200.00  
 (8.48)  
 Volatilidad al 1%Caps & Floors(0.03) (0.59)0.10 - 0.40(0.01)1.00 (0.03)  
 a FX %Forwards17.93322.360.10(32.24)0.20(64.47)0.50(161.18)  
 a FX %Opciones Divisa - - 0.10 - 0.20 - 0.50 -  
 Total(34.36) (68.72) (169.69)

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 2023 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

OpcionesDeltaVegaGamma  
 Options AAPL.OQ---  
 Options AMZN.OQ---  
 Options BNPUI5.INDX457,120.0011,582.00117,965.00  
 Options EEM.P---  
 Options ENHFO5.INDX---  
 Options ENHGE5.INDX---  
 Options FXI.P---  
 Options GOOG.OQ---  
 Options ICLN.OQ---  
 Options IDBTV1.INDX1,635.0064.00364.00  
 Options META.OQ---  
 Options MEXIPC.INDX---  
 Options MSFDV1.INDX---  
 Options QQQ.OQ---  
 Options SHELL.AS---  
 Options SOXX.OQ---  
 Options SPX.INDX---  
 Options SPXFP.INDX---  
 Options SPXSR5.INDX---  
 Options VLO.N---  
 TOTAL458,755.0011,646.00118,329.00  
 1).Cifras expresadas en pesos

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 AAPL.OQ---  
 Options AMZN.OQ---  
 Options BNPUI5.INDX(45,712.00) (137,136.00) (228,560.00)  
 Options EEM.P---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 17 / 24

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX(163.5) (490.5) (817.5)  
Options META.OQ---  
Options MEXIPC.INDX---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SHELL.AS---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPX.INDX---  
Options SPXFP.INDX---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
TOTAL(45,875.50) (137,626.50) (229,377.50)

1).Cifras expresadas en pesos

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

Escenarios al alza(0.1) (0.3) (0.5)  
Options AAPL.OQ---  
Options AMZN.OQ---  
Options BNPUI5.INDX22,856.0068,568.0091,424.00  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX81.75245.25327.00  
Options META.OQ---  
Options MEXIPC.INDX---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SHELL.AS---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPX.INDX---  
Options SPXFP.INDX---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
TOTAL22,937.7568,813.2591,751.00

1). Cifras expresadas en pesos

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:

ScotiabankMonto  
Probable(45,875.50)

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 18 / 24

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Poco Probable(137,626.50)  
Muy poco Probable(229,377.50)  
1).Cifras expresadas en pesos

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 2023 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte Moneda Colateral Recibido Colateral Enviado

CLIENTE 1USD-(1,070,000)  
CLIENTE 2MXN375,000,000(639,000,000)  
CLIENTE 3USD595,000-  
CLIENTE 4USD5,830,000-  
CLIENTE 5MXN43,905,000(126,340,000)  
CLIENTE 6MXN10,700,000(23,300,000)  
CLIENTE 7USD10,625,000(16,500,000)  
CLIENTE 8MXN145,503,132(2,254,357,869)  
CLIENTE 9USD29,940,000(41,210,000)  
CLIENTE 10USD35,760,000(24,570,000)  
CLIENTE 11USD130,900,000(830,000,000)  
CLIENTE 12USD280,000-  
CLIENTE 13USD17,790,000(3,840,000)  
CLIENTE 14USD23,650,000(35,560,000)  
CLIENTE 15USD-(250,000)  
CLIENTE 16MXN74,000,000(222,400,000)  
CLIENTE 17MXN121,400,000(350,000,000)  
CLIENTE 18USD91,100,000(52,940,000)  
CLIENTE 19MXN214,900,000(419,500,000)  
CLIENTE 20MXN565,567,142(366,930,007)  
CLIENTE 21MXN1,200,000-  
CLIENTE 22USD5,110,000(11,420,000)  
CLIENTE 23MXN18,000,000-  
CLIENTE 24USD8,280,000(12,230,000)  
CLIENTE 25USD-(2,180,000)  
CLIENTE 26MXN-(35,566,000)  
CLIENTE 27USD1,990,000(510,000)  
CLIENTE 28USD21,990,000(9,010,000)  
TOTAL 1,954,015,274(5,478,683,876)

1).Cifras expresadas en pesos

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 19 / 24

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 20 / 24

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 21 / 24

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 22 / 24

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 23 / 24

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2023**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 24 / 24

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Liquidados anticipadamente

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

Producto	Fecha de evento	Contraparte	/Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
P1917102	10/2023	Cliente	1USD	65,136	No envió los fondos	
COLATERAL03	10/2023	Cliente	2USD	1,460,000	No envió los fondos	
202310120313516	10/2023	Cliente	3MXN	99,226	Cobro parcial	
SJS58318	10/2023	Cliente	4USD	2,670	Discrepancia en liquidación	
SX653930	10/2023	Cliente	5MXN	(1,282,047)	Se retiene hasta instrucción de SAM	
SAK05530	10/2023	Cliente	6MXN	(862,564)	Se retiene hasta instrucción de SAM	
202311030379810	11/2023	Cliente	7USD	1,100,000	Problemática Sistema reconocimiento	
P1801517	11/2023	Cliente	8MXN	24,656	No envió los fondos	
COLATERAL24	11/2023	Cliente	9USD	1,520,000	No envió los fondos	
SAK05528	11/2023	Cliente	10MXN	(776,784)	Se retiene hasta instrucción de SAM	
SX653929	11/2023	Cliente	11MXN	(1,234,177)	Se retiene hasta instrucción de SAM	
210274314	12/2023	Cliente	12MXN	672,000	Pago el 15-12-23 672000	
211135415	12/2023	Cliente	13MXN	109,575	Pago el 18-12-23 109,575.00	
E8795618	12/2023	Cliente	14MXN	337,150	Pago el 21-12-23 337,150	
SHH60618	12/2023	Cliente	15USD	104,897	Pago el 19-12-23 104,896.56	
P1801518	12/2023	Cliente	16MXN	24,557	Pago el 19-12-23 24,556.67	
SIM80527	12/2023	Cliente	17USD	119	Discrepancia en liquidación	
202311170375428	12/2023	Cliente	18MXN	5,222,700	Pago el 29-12-23 104,896.56	
SAK05528	12/2023	Cliente	19MXN	(796,942)	Se retiene hasta instrucción de SAM	
SX653928	12/2023	Cliente	20MXN	(1,223,883)	Se retiene hasta instrucción de SAM	

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF