



# Scotiabank Inverlat

Cifras Auditadas

**Scotiabank**

Scotiabank-Indicadores Financieros	T1 2022	T2 2022	T3 2022	T4 2022
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	20.0%	15.7%	15.1%	10.1%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	2.1%	1.7%	1.6%	1.0%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	4.7%	3.6%	3.5%	2.8%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.7%	2.3%	2.3%	2.4%
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)	3.7%	3.6%	3.8%	3.7%
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.)	96.4%	95.2%	85.8%	90.6%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	19.87%	20.70%	20.99%	19.78%*
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	16.41%	16.50%	16.41%	15.50%*
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	42.0%	42.5%	40.6%	45.5%

\* Sujeto a aprobación del Banco Central.

	3 meses			12 meses
	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%	31 dic 2022
Ingresos por intereses	15,146	16,950	12%	57,270
Gastos por intereses	(8,471)	(10,211)	-21%	(31,711)
<b>Margen Financiero</b>	<b>6,675</b>	<b>6,739</b>	<b>1%</b>	<b>25,559</b>
Comisiones	1,170	1,197	2%	4,392
Resultado por Intermediación	372	333	-10%	1,548
OI OE	89	274	> +100%	676
<b>Ingresos no Financieros</b>	<b>1,631</b>	<b>1,804</b>	<b>11%</b>	<b>6,616</b>
<b>Total Ingresos</b>	<b>8,306</b>	<b>8,543</b>	<b>3%</b>	<b>32,175</b>
Gastos de Administración y Promoción	(4,050)	(4,310)	-6%	(16,704)
<b>PTPP</b>	<b>4,256</b>	<b>4,233</b>	<b>-1%</b>	<b>15,471</b>
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(772)	(2,006)	> -100%	(1,739)
Resultado de la Operación	3,484	2,227	-36%	13,732
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	1	-	-100%	59
<b>Resultado antes de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>3,485</b>	<b>2,227</b>	<b>-36%</b>	<b>13,791</b>
Impuestos a la Utilidad	(614)	(307)	50%	(2,689)
<b>Resultado Neto</b>	<b>2,871</b>	<b>1,920</b>	<b>-33%</b>	<b>11,102</b>
Otros Resultados Integrales				
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	(326)	238	> +100%	(245)
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	52	(137)	> -100%	473
Remediación de beneficios definidos a los empleados	1	(366)	> -100%	(355)
Participación en ORI de otras entidades	-	(2)	0%	(2)
<b>Resultado Integral</b>	<b>2,598</b>	<b>1,653</b>	<b>-36%</b>	<b>10,973</b>

\* PTPP: "Pre-Tax, Pre-Provision", resultado antes de impuestos y reservas.

La utilidad neta acumulada al cierre de diciembre de 2022 se ubicó en \$11,102 millones; la cual se integra principalmente por ingresos provenientes de margen financiero, comisiones y tarifas netas; compensados parcialmente por gastos de administración y promoción, así como reservas crediticias.

La utilidad neta del cuarto trimestre de 2022 se ubicó en \$1,920 millones, una disminución de \$951 millones o 33% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores requerimientos de reservas crediticias; compensados parcialmente por menores impuestos a la utilidad.

## Ingresos no Financieros

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	3 meses			12 meses
	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%	31 dic 2022
Aceptaciones por Cuenta de Terceros	1	-	-100%	1
Actividades Fiduciarias	58	54	-7%	230
Apertura de Cuenta	5	6	20%	19
Cartas de Crédito sin Refinanciamiento	59	82	39%	248
Cheques Certificados	1	1	0%	3
Cheques de caja	-	1	0%	2
Compraventa de instrumentos financieros	-	-	0%	1
Manejo de Cuenta	97	86	-11%	355
Operaciones de Crédito	476	487	2%	1,745
Otras Comisiones y Tarifas	399	401	1%	1,491
Servicios de Banca Electrónica	47	50	6%	186
Transferencia de Fondos	27	29	7%	111
<b>Total de Comisiones y Tarifas (netas)</b>	<b>1,170</b>	<b>1,197</b>	<b>2%</b>	<b>4,392</b>

Scotiabank -Otros Ingresos/Egresos de la Operación

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	3 meses			12 meses
	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%	31 dic 2022
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	(51)	20	> +100%	(62)
Aportaciones al IPAB	(505)	(521)	-3%	(2,020)
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	60	25	-58%	217
Donativos	(9)	(11)	-22%	(20)
Estimación por Pérdida de Valor de Bienes Adjudicados	(7)	(8)	-14%	(23)
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito	-	52	0%	53
Ingresos por Arrendamiento	3	3	0%	17
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados	39	45	15%	145
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	603	639	6%	2,823
Quebrantos	(81)	(34)	58%	(591)
Recuperaciones	2	11	> +100%	19
Resultado en Venta de Bienes Adjudicados	24	22	-8%	76
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo	11	1	-91%	12
Utilidad por venta de cartera de crédito	-	30	0%	30
<b>Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación</b>	<b>89</b>	<b>274</b>	<b>&gt; +100%</b>	<b>676</b>

## Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	3 meses			12 meses
	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%	31 dic 2022
<b>Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios</b>	<b>(772)</b>	<b>(2,006)</b>	<b>&gt; -100%</b>	<b>(1,739)</b>

La Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios acumulada al cierre de diciembre 2022 se mostró en \$1,739 millones, integrado por mayores requerimientos de reservas en la cartera hipotecaria, tarjeta de crédito, automotriz, cartera comercial y consumo.

En el cuarto trimestre de 2022, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en \$2,006 millones, un incremento de \$1,234 millones o 160% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores requerimientos de reservas en el trimestre.

## Gastos de Administración y Promoción

Gastos de Administración y Promoción

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	3 meses			12 meses
	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%	31 dic 2022
Gastos de Personal	(1,696)	(1,555)	8%	(7,426)
Gastos de Operación	(2,354)	(2,755)	-17%	(9,278)
<b>Total de Gastos de Administración y Promoción</b>	<b>(4,050)</b>	<b>(4,310)</b>	<b>-6%</b>	<b>(16,704)</b>

## Impuestos a la Utilidad

Scotiabank - Impuestos  
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	3 meses			12 meses
	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%	31 dic 2022
Impuesto a la Utilidad Causado	(813)	(682)	16%	(2,924)
Impuesto a la Utilidad Diferido	199	375	88%	235
<b>Total de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>(614)</b>	<b>(307)</b>	<b>50%</b>	<b>(2,689)</b>

Los impuestos netos acumulados al cierre de diciembre 2022 se ubicaron en \$2,689 millones, con una tasa efectiva del periodo de 19.5%. Generada principalmente por la inflación deducida en el periodo.

En el cuarto trimestre de 2022, el total de impuestos netos se ubicaron en \$307, una disminución de \$307 millones o 50%. Generada principalmente por una menor utilidad en el periodo.

## Balance General

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General  
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	219,145	231,456	6%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	452,361	476,776	5%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	18,102	18,541	2%
Partidas diferidas	-	2,746	0%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,530)	(16,805)	-8%
Otros Activos	41,850	37,366	-11%
<b>Total Activo</b>	<b>715,928</b>	<b>750,080</b>	<b>5%</b>
Depósitos	446,817	485,466	9%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	44,084	49,518	12%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,099	9,057	0%
Otros Pasivos	138,439	130,759	-6%
<b>Capital</b>	<b>77,489</b>	<b>75,280</b>	<b>-3%</b>
<b>Total Pasivo y Capital</b>	<b>715,928</b>	<b>750,080</b>	<b>5%</b>

Al 31 de diciembre de 2022, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$750,080 millones, un incremento de \$34,152 millones o 5% respecto al trimestre anterior. Debido principalmente a mayores volúmenes de efectivo y equivalentes de efectivo en depósitos en Banxico, otras entidades financieras y préstamos interbancarios - call money, así como mayores volúmenes de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1, 2 y 3 de comercial, vivienda, entidades gubernamentales y financieras; compensados parcialmente por menores volúmenes en inversiones en instrumentos financieros de valores gubernamentales (negociables y para cobrar o vender).

El total del pasivo se ubicó en \$674,800 millones al 31 de diciembre de 2022, un incremento de \$36,361 millones o 6% respecto al trimestre anterior. Debido principalmente a mayores volúmenes en depósitos y préstamos bancarios y de otros organismos; compensados parcialmente por menores volúmenes en acreedores por liquidación de operaciones e instrumentos financieros derivados con fines de negociación (en Otros Pasivos).

## 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)

	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	33,608	33,259	-1%
Créditos a la Vivienda	182,640	189,071	4%
<b>Total Préstamos de Menudeo</b>	<b>216,248</b>	<b>222,330</b>	<b>3%</b>
Actividad Empresarial o Comercial	207,847	221,292	6%
Entidades Financieras	15,446	17,426	13%
Entidades Gubernamentales	12,820	15,728	23%
<b>Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales</b>	<b>236,113</b>	<b>254,446</b>	<b>8%</b>
<b>Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2</b>	<b>452,361</b>	<b>476,776</b>	<b>5%</b>

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de diciembre de 2022 se ubicaron en \$254,446 millones, un incremento de \$18,333 millones u 8% respecto al trimestre anterior, debido a mayores créditos de actividad empresarial o comercial; entidades gubernamentales y financieras.

El total de préstamos de menudeo al 31 de diciembre de 2022 se ubicó en \$222,330 millones, un incremento de \$6,082 millones o 3% respecto al trimestre anterior, principalmente por créditos a la vivienda

## 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)

	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	18,102	18,541	2%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,530)	(16,805)	-8%
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta</b>	<b>2,572</b>	<b>1,736</b>	<b>-33%</b>
<b>Índice de morosidad</b>	<b>3.8%</b>	<b>3.7%</b>	<b>-11 pb</b>

Al 31 de diciembre de 2022 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 se ubicó en \$18,541 millones, un incremento de \$439 millones o 2% respecto al trimestre anterior.

Al 31 de diciembre de 2022 la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$16,805 millones, un incremento de \$1,275 millones u 8% respecto al trimestre anterior. La estimación preventiva para riesgos crediticios representa el 3.4% de la cartera total al 31 de diciembre de 2022, un incremento de 9pb respecto al trimestre anterior.

Al 31 de diciembre de 2022, el índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 90.6%, mayor al 85.8% respecto al cierre del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 31 de diciembre de 2022 fue de 3.7%, una disminución de 11pb respecto al trimestre anterior.

## Depósitos

Scotiabank – Depósitos  
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	30 sep 2022	31 dic 2022	T/T Δ%
<b>Total Depósitos Vista y Ahorro</b>	<b>230,036</b>	<b>231,775</b>	<b>1%</b>
Público en General	191,459	209,629	9%
Mercado de Dinero	2,306	31,238	> +100%
<b>Total Depósitos a Plazo</b>	<b>193,765</b>	<b>240,867</b>	<b>24%</b>
Títulos de Crédito Emitidos	22,033	11,845	-46%
Cuenta global de captación sin movimientos	983	979	0%
<b>Total de Depósitos</b>	<b>446,817</b>	<b>485,466</b>	<b>9%</b>

Al 31 de diciembre de 2022, el total de depósitos se ubica en \$485,466 millones, un incremento de \$38,649 millones o 9% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores depósitos a plazo por \$47,102 millones o 24%; compensados parcialmente por menores títulos de crédito emitidos por \$10,188 o 46%.

Scotiabank  
Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I-BANSAN-23025	14,960,262,178	10.39%	14	14,904

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022 valor razonable)

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
<b>Instrumentos financieros negociables</b>	<b>56,913</b>	<b>1,548</b>	<b>17</b>	<b>104</b>	<b>58,582</b>
Sin restricción:	-	-	13	-	13
Restringidos:	56,913	1,548	4	104	58,569
<i>En operaciones de reporto</i>	51,397	1,548	-	104	53,049
<i>Préstamos de valores</i>	2,184	-	-	-	2,184
<i>Otros</i>	3,332	-	4	-	3,336
<b>Instrumentos financieros para cobrar o vender</b>	<b>43,894</b>	<b>18,850</b>	<b>-</b>	<b>1,228</b>	<b>63,972</b>
Sin restricción:	35,117	18,850	-	1,228	55,195
Restringidos:	8,777	-	-	-	8,777
<i>En operaciones de reporto</i>	7,221	-	-	-	7,221
<i>En operaciones de préstamo de valores</i>	-	-	-	-	-
<i>Otros</i>	1,556	-	-	-	1,556
<b>Instrumentos financieros para cobrar principal e interés</b>	<b>4,717</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4,717</b>
Sin restricción	4,717	-	-	-	4,717
<b>Total</b>	<b>105,524</b>	<b>20,398</b>	<b>17</b>	<b>1,332</b>	<b>127,271</b>

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022; 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	1,976	1,750	-	-	1,597	1,400	322	298	26,749	26,773	-	-	30,644	30,221
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	5,608	3,487	-	-	5,608	3,487

Scotiabank-Montos nomenclales en operaciones derivadas  
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de diciembre de 2022)

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	3,171	3,182	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	5	5	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	1	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	12	12	355	355	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	86	86	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	283	283	849	357	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	-	4,275	4,277	-	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	37,433	36,696	323,184	325,359	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	658	657	1,424	1,778	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	23	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
<b>Con fines de cobertura</b>												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	45,182	200	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	499	230	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	174,521	46,611	-	221,132
Créditos a entidades financieras	17,417	9	-	17,426
Créditos a entidades gubernamentales	11,820	3,908	-	15,728
Créditos al consumo	32,612	-	-	32,612
Créditos a la vivienda	186,462	18	59	186,539
<b>Total</b>	<b>422,832</b>	<b>50,546</b>	<b>59</b>	<b>473,437</b>

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	160	-	-	160
Créditos al consumo	647	-	-	647
Créditos a la vivienda	2,526	2	4	2,532
<b>Total</b>	<b>3,333</b>	<b>2</b>	<b>4</b>	<b>3,339</b>

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	7,846	1,714	-	9,560
Créditos a entidades financieras	91	-	-	91
Créditos al consumo	832	-	-	832
Créditos a la vivienda	8,013	37	8	8,058
<b>Total</b>	<b>16,782</b>	<b>1,751</b>	<b>8</b>	<b>18,541</b>

<b>Saldo al 30 de septiembre de 2022</b>	<b>18,102</b>
Reestructuras	59
Recuperaciones	(1,145)
Castigos y quitas	(738)
Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	2,316
Fluctuación Tipo Cambio	(53)
<b>Saldo al 31 de diciembre de 2022</b>	<b>18,541</b>

<b>Saldo al 30 de septiembre de 2022</b>	<b>15,530</b>
Más: Creación de reservas	724
Calificación	1,352
Menos: Adjudicaciones y otros	160
Castigos y quitas	590
Comercial	20
Hipotecario	94
Consumo	476
Desliz cambiario	51
<b>Saldo al 30 de diciembre de 2022</b>	<b>16,805</b>

	<b>30 sep 2022</b>	<b>31 dic 2022</b>
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2</b>		
Metropolitano	60.0%	62.2%
Noroeste – Centro	11.0%	10.7%
Norte	14.6%	13.7%
Bajío	8.6%	7.9%
Sur	5.8%	5.5%
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3</b>		
Metropolitano	44.9%	41.5%
Noroeste – Centro	17.0%	19.6%
Norte	7.3%	7.3%
Bajío	15.1%	15.7%
Sur	15.7%	15.9%

<b>No. Acreditados / Grupos</b>	<b>Monto</b>	<b>% Capital Básico</b>
1	10,192	14.45%
2	9,036	12.81%
3	8,275	11.73%
<b>Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos</b>		<b>27,503</b>

	<b>Importe Cartera Crediticia</b>	<b>Cartera Comercial</b>	<b>Reservas Preventivas Necesarias</b>			<b>Total Reservas Preventivas</b>
			<b>No Revolventes</b>	<b>Consumo Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes</b>	<b>Cartera de Vivienda</b>	
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	427,474	989	102	578	304	1,973
Riesgo A2	53,259	522	29	184	15	750
Riesgo B1	13,542	170	37	61	15	283
Riesgo B2	9,687	73	46	39	59	217
Riesgo B3	5,666	84	19	42	53	198
Riesgo C1	3,080	41	29	84	47	201
Riesgo C2	3,106	6	26	170	196	398
Riesgo D	7,546	772	47	334	1,149	2,302
Riesgo E	11,905	6,116	619	419	1,662	8,816
<b>Total</b>	<b>535,265</b>	<b>8,773</b>	<b>954</b>	<b>1,911</b>	<b>3,500</b>	<b>15,138</b>
<b>Exceso</b>						<b>1,667</b>
<b>Reservas Constituidas</b>						<b>16,805</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 2022.
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	\$	-
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		28
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos		7
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		<u>1,632</u>
<b>Total</b>	<b>\$</b>	<b>1,667</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 2022 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 especiales  
(millones de pesos)

	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	1,619	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
<b>Total</b>	<b>15,209,692</b>	<b>1,619</b>	

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

	Pesos	Tasa Promedio Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	3.56%	0.69%	-
Depósitos a plazo	6.95%	0.00%	-



Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Vencimiento	Préstamos			Financiamiento		Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	1,237	7,511	3,556	-	12,304
Largo	-	-	14,500	4,980	-	19,480
<b>Total</b>	-	<b>1,237</b>	<b>22,011</b>	<b>8,536</b>	-	<b>31,784</b>
Tasa Promedio	0.00%	6.47%	11.62%	9.87%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	14,768	-	25	786	1,986	17,565
Largo	-	-	-	169	-	169
<b>Total</b>	<b>14,768</b>	-	<b>25</b>	<b>955</b>	<b>1,986</b>	<b>17,734</b>
Tasa Promedio	4.52%	0.00%	5.68%	4.75%	3.66%	
<b>Total Préstamos Interbancarios</b>	<b>14,768</b>	<b>1,237</b>	<b>22,036</b>	<b>9,491</b>	<b>1,986</b>	<b>49,518</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 2022.

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

	30 sep 2022	31 dic 2022
<b>Depósitos a la Vista</b>	<b>54.4%</b>	<b>49.1%</b>
Metropolitano	24.3%	22.3%
Noroeste – Centro	11.2%	9.1%
Norte	7.3%	7.0%
Bajío	5.9%	5.2%
Sur	5.7%	5.5%
<b>Depósitos Ventanilla</b>	<b>45.1%</b>	<b>44.3%</b>
Metropolitano	18.1%	21.4%
Noroeste - Centro	6.1%	4.8%
Norte	8.3%	8.6%
Bajío	6.6%	5.1%
Sur	6.0%	4.4%
<b>Total de Captación del Público</b>	<b>99.5%</b>	<b>93.4%</b>
<b>Fondeo Profesional</b>	<b>0.5%</b>	<b>6.6%</b>

Scotiabank-ISR Diferido  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Provisión por perdidas de crédito	5,042
Compensación diferida	(1,188)
Ingresos diferidos	536
Instalaciones y equipos / depreciación	695
Beneficios a los empleados	968
Provisiones	904
Otros	(465)
<b>Efecto Neto en Diferido</b>	<b>6,492</b>

Scotiabank-PTU Diferido  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Valuación de instrumentos financieros:	
Instrumentos financieros negociables	5
Operaciones financieras derivados	11
Instrumentos financieros para cobrar o vender	46
Swaps de cobertura de flujos de efectivo	(110)
Pagos anticipados	(315)
Arrendamiento	2
Provisiones y otros	368
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	(62)
Comisiones cobradas por anticipado	134
Plan de pensiones	255
Remediones por beneficios definidos a los empleados	63
Bienes adjudicados	93
Futuros castigos de crédito	1,326
Efectos de fusión Crédito Familiar	15
<b>Efecto Neto en Diferido</b>	<b>1,831</b>

Al 31 de diciembre de 2022, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank-Resultados por Intermediación  
(millones de pesos)

	<b>31 dic 2022</b>
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(538)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(12)
Resultado por valuación de divisas	(458)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	828
Resultado por compraventa de divisas	1,733
Costos de transacción	(5)
<b>Total</b>	<b>1,548</b>

### Emisión de Certificados Bursátiles

Al cierre de diciembre de 2022, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

	Quinta*	Tercera***
Clave de Pizarra	SCOTIAB 13-2	SCOTIAB 19-2
Monto de la Emisión	\$1,150 millones	\$6,000 millones
Fecha de Emisión y Colocación	28 junio 2013	6 diciembre 2019
Plazo de Vigencia de la Emisión	3,640 días, 20 periodos 182 días, aprox. 10 años	1,207 días, aprox. 3.3 años
Garantía	Quirografaria	Quirografaria
Tasa de interés	7.30% Fijo	TIIE 28 + 0.15%
Pago de Intereses	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) / "mxAAA"	AAA(mex) / "mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento

\* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

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

### Emisión de Obligaciones Subordinadas

Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo (días)	Importe (\$)	Tasa (%)
18-diciembre-14	05-diciembre-24	MX0QSC1N0016	3,640	2,093,000,000	7.4
28-junio-18	09-junio-33	MX0QSC1N0024	5,460	3,360,000,000	12.3
11-septiembre-18	Perpetua	MX0QSC1N0032	-	3,455,000,000	11.3
<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 05-20	1,930,500	19-feb-20	17-feb-23	1,094	MSFDVTIG IDEX	193,050,000
99-SCOTIAB 06-20	6,460,410	27-mar-20	27-mar-23	1,095	MSFDVTIG IDEX	646,041,000
99-SCOTIAB 07-20	7,299,300	14-may-20	12-may-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	729,930,000
99-SCOTIAB 08-20	405,850	11-jun-20	09-jun-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	40,585,000
99-SCOTIAB 04-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99-SCOTIAB 05-21	4,866,500	29-abr-21	26-abr-24	1,093	Index (IDBTVER)	486,650,000
99-SCOTIAB 06-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1,093	Index (IDBTVER)	57,230,000
99-SCOTIAB 08-21	809,300	12-ago-21	10-ago-23	728	Index (IDBTVER)	80,930,000
99-SCOTIAB 09-21	3,940,200	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	394,020,000
99-SCOTIAB 10-21	3,843,100	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	384,310,000
99-SCOTIAB 11-21	1,105,530	07-dic-21	01-jun-23	541	MSCI ETF (EZU)	110,553,000
99-SCOTIAB 01-22	543,200	28-feb-22	25-feb-25	1,093	MSFDVTHY Index	54,320,000
99-SCOTIAB 02-22	545,100	28-feb-22	27-feb-24	729	Invesco QQQ Series 1	54,510,000
99-SCOTIAB 03-22	369,750	08-mar-22	05-sep-23	546	iShares MSCI China ETF	36,975,000
99_SCOTIAB_04-22	571,500	12-may-22	10-nov-23	547	SPDR Gold Shares (GLD)	57,150,000
99_SCOTIAB_05-22	1,255,860	15-jun-22	13-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	125,586,000
99_SCOTIAB_06-22	1,829,000	15-jun-22	13-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	182,900,000
99_SCOTIAB_07-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_08-22	1,030,150	16-jun-22	13-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	103,015,000
99_SCOTIAB_09-22	495,000	23-jun-22	22-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	49,500,000
99_SCOTIAB_10-22	720,100	30-jun-22	29-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	72,010,000
99_SCOTIAB_11-22	5,791,750	17-nov-22	14-nov-25	1,093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	579,175,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-22	14-nov-25	1,092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	813,800	19-dic-22	17-dic-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	81,380,000
<b>Total Bonos Bancarios al 31 de diciembre de 2022</b>						<b>4,665,579,000</b>

## 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 2022)

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	Resultado de ejercicios anteriores	42,696
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	19,117
4	Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1 (solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones)	No aplica
5	Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital común de nivel 1)	No aplica
6	Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	75,281
7	Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios	
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
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)	1,833
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)	8
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	8,805
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	8,160
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	645
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones	-
28	Ajustes regulatorios totales al capital común	10,646
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	64,635

Capital adicional de nivel 1: instrumentos

30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,582
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,582
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 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
36	Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	3,582
Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios		
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
40 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
41	Ajustes regulatorios nacionales	-
42	Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones	No aplica
43	Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1	-
44	Capital adicional de nivel 1 (AT1)	3,582
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	68,217
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas		
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	3,792
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 nivel2)	No aplica
49	de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
50 conservador	Reservas	1,619
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	5,411
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios		
52 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53 conservador	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
55 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de 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)	5,411
59	Capital total (TC = T1 + T2)	73,628
60	Activos ponderados por riesgo totales	475,012
Razones de capital y suplementos		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	13.61%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	14.36%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.50%
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)	16.71%
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)	6.61%
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)		
69	Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
70	Razón mínima nacional de T1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
71	Razón mínima nacional de TC (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica

Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)		
72	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
73	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
74	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica
75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2		
76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	1,619
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,368
78	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite)	-
79	Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas	-
Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)		
80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
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 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. 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 conservador	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como aquéllas constituidas con cargo a cuentas contables que no formen parte de las partidas de resultados o del capital contable y no sólo la diferencia positiva entre las Pérdidas Esperadas Totales menos las Reservas Admisibles Totales, en el caso de que las Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital.
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
14	No aplica.
15	Inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos que corresponden a los recursos a los que la Institución no tiene acceso irrestricto e ilimitado. Estas inversiones se considerarán netas de los pasivos del plan y de los

	impuestos a la utilidad diferidos a cargo que correspondan que no hayan sido aplicados en algún otro ajuste regulatorio.
16 conservador	<p>El monto de la inversión en cualquier acción propia que la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de los fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.</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 conservador	<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 fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.</p>
18 conservador	<p>Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.</p>
19 conservador	<p>Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.</p>
20 conservador	<p>Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.</p>
21	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.
22	No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.
23	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
24	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
25	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.
26	Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.
A	A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.
B	B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
C	C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
D	D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
E	E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en fondos de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
F	F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

G	G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de fondos de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable del citado fondo de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
H	H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del Grupo Financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
I	I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
J	J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
K	K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.
L	L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
M	M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso s) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
N	N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.
O	O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
P	P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.
27	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
28	Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.
29	Renglón 6 menos el renglón 28.
30	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.
31	Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.
32	No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.
33	Obligaciones subordinadas computables como capital básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).
34	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
35	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
36	Suma de los renglones 30, 33 y 34.
37 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
38 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
39 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
40 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
41	Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
42	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
43	Suma de los renglones 37 a 42.
44	Renglón 36, menos el renglón 43.
45	Renglón 29, más el renglón 44.
46	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el capital Fundamental ni en el capital básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
47	Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
48	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
50	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.
51	Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.



52 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
54 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
55 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
56	Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
57	Suma de los renglones 52 a 56.
58	Renglón 51, menos renglón 57.
59	Renglón 45, más renglón 58.
60	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.
61	Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
62	Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
63	Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
64	Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61,65, 66 y 67.
65	Reportar 2.5%
66	Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
67	La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
68	Renglón 61 menos 7%.
69	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
70	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
71	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
72	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
73	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
74	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
75	El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.
76	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
77	1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
78	Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
79	0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
80	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
81	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
82	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
83	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.
84	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
85	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Efectivo y equivalentes de Efectivo	66,324
BG2	Cuentas de Margen	764
BG3	Inversiones en Instrumentos Financieros	127,271
BG4	Deudores por reporto	3,224
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos Financieros Derivados	36,252
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(1,380)

BG8	Total de cartera de crédito (neto)	481,258
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	15,177
BG11	Bienes adjudicados (neto)	292
BG12	Propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,437
BG13	Inversiones permanentes	3,713
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	14
BG15	Activo por impuestos a la utilidad diferidos	6,472
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (neto)	3,111
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,970
	Activos Intangibles (neto)	4,588
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	485,702
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	49,518
	Valores asignados por liquidar	5,237
BG19	Acreedores por reporto	60,291
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	3,965
BG22	Instrumentos Financieros Derivados	33,708
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	2
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	18,007
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por impuesto a la utilidad	1,959
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,057
	Pasivos por arrendamiento	2,094
	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	9,057
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	5,611
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	13,468
BG30	Capital ganado	61,811
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	264,565
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	447,011
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	67,950
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	11,013
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	3,965
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	1,333
BG41	Otras cuentas de registro	1,662,101

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 2022)

Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
	<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	1,833	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,833
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	18	-	

	donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido			
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	8	BG 15 Impuestos y PTU diferidos (neto) \$8
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	1,619	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$1,619
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	8,160	BG 16 Activos Intangibles \$4,588 más Gastos de Instalación \$3,572
21	Participación de los trabajadores en la utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	645	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 645
	<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	3,582	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,582
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	3,792	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,792
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	42,696	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$42,696
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	852	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$852
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	18,265	BG 30 Reservas de Capital \$8,001 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles

				para la Venta (\$356) más Remedición por beneficios definidos a los empleados (\$482) más Resultado Neto \$11,102
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
	CUENTAS DE ORDEN			
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
	CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL	Identificador		
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	Estado de Resultados
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

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

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

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

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

<b>Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo</b>	<b>Importe de posiciones equivalentes</b>	<b>Requerimiento de capital</b>
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	59,445	4,756
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,051	84
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's	3,590	287
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC	82	7
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	1,992	159
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	1,995	160
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	66	5
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	14	1
<b>Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo</b>	<b>Activos ponderados por riesgo</b>	<b>Requerimiento de capital</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%)	23	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%)	995	80
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	5,900	472
Grupo III (ponderados al 25%)	1	-
Grupo III (ponderados al 50%)	360	29
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%)	2,551	204
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	218	17
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	19	2
Grupo VI (ponderados al 20%)	2,382	191
Grupo VI (ponderados al 25%)	1,662	133
Grupo VI (ponderados al 30%)	6,518	521
Grupo VI (ponderados al 40%)	7,076	566
Grupo VI (ponderados al 50%)	38,136	3,051
Grupo VI (ponderados al 70%)	29	2
Grupo VI (ponderados al 75%)	21,016	1,681
Grupo VI (ponderados al 85%)	11,448	916
Grupo VI (ponderados al 100%)	60,315	4,825
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	160	13
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	17,046	1,364
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	18	1
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	12,361	989
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	141,670	11,334
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	25	2
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,663	133
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%)	1,176	94
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%)	7,188	575
Grupo VIII (ponderados al 150%)	2,924	234
Grupo IX (ponderados al 100%)	25,948	2,076
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-

Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)	36	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, 6 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	3,324	266
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	16	1
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	10	1

Método empleado	Activos ponderados sujetos a riesgo operacional Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Estándar Alternativo	34,563	2,765
<b>Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses</b>		
	31,904	

## Categoría Capitalización

Al 31 de diciembre del 2022, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 12.73% (Índice regulatorio más suplemento de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistemica 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.
Rendimientos / dividendos		
17	Tipo de rendimiento / dividendo	Fijo o Variable
18	Tasa de Interés /Dividendo	La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19	Cláusula de cancelación anticipada	Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.



20	Discrecionalidad en el pago	Parcialmente discrecional.
21	Cláusula de aumento de intereses	No
22	Rendimientos / dividendos	No Acumulable
23	Convertibilidad del instrumento	N.A.
24	Condiciones de convertibilidad	N.A.
25	Grado de convertibilidad	N.A.
26	Tasa de conversión	N.A.
27	Tipo de convertibilidad del instrumento	N.A.
28	Tipo de instrumento financiero de la convertibilidad	N.A.
29	Emisor del instrumento	Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.
30	Cláusula de disminución de valor (Write-Down)	No
31	Condiciones para disminución de valor	N.A.
32	Grado de baja de valor	N.A.
33	Temporalidad de la baja de valor	N.A.
34	Mecanismos de disminución de valor temporal	N.A.
35	Posición de subordinación en caso de liquidación	Los títulos de las acciones están sujetos a las disposiciones que en su caso emite la Secretaría de Hacienda y Crédito Público y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, así como lo que al efecto dispongan los Estatutos Sociales.
36	Características de incumplimiento	No
37	Descripción de características de incumplimiento	No

Scotiabank- Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio

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



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

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

### Suplemento de capital contracíclico de la Institución

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

## 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 2022 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 25 de mayo de 2022 como Institución de Banca Múltiple de Importancia Sistemática Local a Scotiabank Inverlat, S.A., mediante oficio Núm. 141-5/1899/2022 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 al nuevo requerimiento de capacidad total de absorción de pérdidas la institución deberá al menos tener el 6.5% de los activos ponderados sujetos a riesgos totales el cual deberá de constituirse durante los próximos cuatro años, por lo que el capital mínimo regulatorio que debe mantener Scotiabank, es de 12.73% al 31 de diciembre de 2022.

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

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Referencia	Rubro	Dic-22*
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	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	475,012
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	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	807,899
5	"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	0.94%
5a	"	
6a	No aplica	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 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
6c	"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?	0%

\*El Banco al considerarse una institución de Importancia Sistemática 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 2022)

Referencia	Rubro	Dic-22
	<b>Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes</b>	
1	Capital Fundamental	64,635
2	Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto	3,582
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>	3,582
6	Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto	5,411
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>	5,411
11	<b>Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio</b>	73,628
	<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>Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes</b>	
18	Suplemento al Capital Neto antes de deducciones	73,628
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	73,628
	<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 4	475,012
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	807,899
	<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)	15.50%
26	Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)	9.11%
27	Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto	13.61%
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)	2.23%
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	1.63%

Scotiabank-Composición del Suplemento al Capital Neto  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Referencia	Rubro
	<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	<b>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.</b>
11	<b>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
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
	<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. 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.
	<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.

## **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 la Dirección Corporativa de Riesgos, la cual a su vez está organizada en 8 áreas encaminadas a monitorear y mitigar los riesgos a los que está expuesto el Banco; lo anterior para garantizar una gestión adecuada de riesgos tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

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

### Riesgo de mercado

La administración del riesgo de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en las tasas de interés, tipos de cambio, precios del mercado accionario, índices y otros factores de riesgo en los mercados de dinero, cambios, capitales y productos derivados a los que están expuestas las posiciones de negociación del Banco.

Las posiciones de riesgo del Banco incluyen instrumentos de mercado de dinero de tasa fija y flotante, acciones, posiciones cambiarias y derivados tales como futuros de tasas de interés, contratos adelantados, opciones de divisas, swaps de tasas de interés, opciones de tasas de interés y swaps de moneda extranjera. Se tienen límites establecidos y aprobados para cada uno de los portafolios.

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre del 31 de diciembre de 2022 fue de \$9.75 millones y su promedio durante el cuarto trimestre de 2022 fue de \$10.12 millones mismo que corresponde a un 0.013% del capital neto (\$75,058 millones a noviembre 2022, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del cuarto trimestre de 2022 se muestran a continuación:

<b>Nocional (millones de pesos)</b>	<b>Cierre diciembre 2022</b>	<b>Promedio</b>
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	883,315	889,397
Mercado de Dinero	50,863	55,585
Tipo de cambio		
Cash	5,202	4,924
Derivados	151,412	180,677
Capitales		
Derivados	19,754	19,336
<b>VaR 1 día (millones de pesos)</b>	<b>Cierre diciembre 2022</b>	<b>(Promedio)</b>
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	10.75	9.71
Tipo de cambio	0.90	1.42
Capitales	0.00	0.00
<b>VaR Global</b>	<b>9.75</b>	<b>10.12</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 2022 muestra una pérdida máxima de \$11.243 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 2022, 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 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.

---

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de diciembre 2022 así como el promedio del cuarto de 2022 se muestran a continuación:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) <sup>2</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	60,080	56,798
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	88,816	85,281

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 2022 de 129% y 111% 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 2022 y en promedio para el cuarto trimestre de 2022 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Valor Económico (+100 pbs)	(1,066)	(1,147)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(277)	(282)

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 <sup>1</sup>	63,972	66,507
Derivados de Cobertura	58,820	51,112

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

<sup>2</sup> Cifras previas al cierre de diciembre 2022.



## 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 2022 y el promedio del cuarto trimestre del 2022 fueron \$3,435 millones y \$3,259 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.

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

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

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

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

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

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

Se utilizan las siguientes Agencias Calificadoras en el método estándar: S&P, MOODY'S, FITCH, HR RATINGS, 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 \$51; 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 2022, el Banco mantiene \$915 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

Adicionalmente, durante el cuarto trimestre de 2022, el Banco informó a la Comisión sobre la decisión de constituir reservas adicionales por \$704 millones para reservar al 100% al acreditado Unifin.

### **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 2022)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.3%	3.1%
Consumo	4.7%	12.0%
Cartera Comercial	0.6%	3.9%
<b>Total</b>	<b>0.8%</b>	<b>4.2%</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.

Parámetros de Riesgo <sup>1</sup> (Cifras en millones de pesos al 31 de diciembre 2022)	EI <sup>2</sup>	PI	SP
Hipotecas	189,071	1.61%	18.20%
Consumo	50,572	5.83%	72.25%
Cartera Comercial	304,881	1.68%	44.70%

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 2022.

### 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 2022 y en promedio durante el cuarto trimestre de 2022, 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 0.64% y 0.69% respectivamente.

## **Riesgo de crédito en operaciones de derivados**

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

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

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

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

## **Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional**

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

## **Valor promedio de la exposición**

Durante el periodo de octubre - diciembre 2022, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$53.8 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de diciembre 2022 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$251.8 millones, donde \$8.1 millones corresponden a riesgo operacional y \$243.7 millones a 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 2022 - diciembre 2022 (T4 2022)

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez<sup>3</sup>

(Cifras en millones de pesos)		Calculo Individual T4 2022		Calculo Consolidado T4 2022	
		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	93,424.80	No aplica	93,424.80
<b>SALIDAS DE EFECTIVO</b>					
2	Financiamiento minorista no garantizado	175,084.86	14,110.35	175,084.86	14,110.35
3	Financiamiento estable	99,354.07	6,537.27	99,354.07	6,537.27
4	Financiamiento menos estable	75,730.79	7,573.08	75,730.79	7,573.08
5	Financiamiento mayorista no garantizado	226,138.51	83,637.43	226,138.51	83,637.43
6	Depósitos operacionales	101,259.56	24,615.01	101,259.56	24,615.01
7	Depósitos no operacionales	122,610.44	56,753.92	122,610.44	56,753.92
8	Deuda no garantizada	2268.501418	2268.501418	2268.501418	2268.501418
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	36.06932692	No aplica	36.06932692
10	Requerimientos adicionales:	254,735.84	19,772.14	254,735.84	19,772.14
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	8,289.89	6,143.07	8,289.89	6,143.07
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	0	0	0	0
13	Líneas de crédito y liquidez	246,445.95	13,629.06	246,445.95	13,629.06
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	257.1055604	257.1055604	257.1055604	257.1055604
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,407.61	2,407.61	2,407.61	2,407.61
16	<b>TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	120,220.71	No aplica	120,220.71

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

ENTRADAS DE EFECTIVO					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	1,851.79	334.2847143	1,851.79	334.2847143
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	44,842.29	31,201.31	44,842.29	31,201.31
19	Otras entradas de efectivo	16,763.16	16,763.16	16,763.16	16,763.16
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	63,457.24	48,298.75	63,457.24	48,298.75
Importe ajustado					
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	93,424.80	No aplica	93,424.80
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	71,921.95	No aplica	71,921.95
23	<b>COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ<sup>(1)</sup></b>	No aplica	<b>129.07</b>	No aplica	<b>129.07</b>

- (a) *Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando.*  
92 días naturales
- (b) *Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL) y la evolución de sus principales componentes.*

**- Durante diciembre 2022, 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 \$50,131 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$41,833 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 \$1,699 millones y \$3,435 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$15,185 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$18,129 millones y por operaciones de call money de \$18,227 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$15,274 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$88,816 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$42,605 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$36,943 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 \$7,946 millones y \$1,323 millones en títulos de nivel 2.

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

**Promedio de tercer trimestre 2022: 140% – promedio del cuarto trimestre 2022: 129%** El coeficiente de cobertura de liquidez disminuyó 1,100 pb respecto del tercer trimestre del 2022, esto debido principalmente a:

- o En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$23,010 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN \$8,202 millones.
- o Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de \$5,811 millones.
- o Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en \$19,949 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en \$21,860 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.

Evolución de Activos Líquidos T4-2022	Octubre	Noviembre	Diciembre
Efectivo	9%	9%	9%
Reservas en el Banco Central	17%	42%	42%
Nivel 1	73%	47%	48%
Nivel 2ª	1%	2%	1%
Nivel 2B	-%	-%	-%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

(e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento	Octubre	Noviembre	Diciembre
<b>CAPTACION TRADICIONAL</b>			
Depósitos de exigibilidad inmediata	45%	45%	43%
Depósitos a plazo			
Del público en general	42%	42%	40%
Mercado de dinero	1%	1%	5%
Títulos de crédito emitidos	3%	2%	2%
Cuenta global de captación sin movimientos	-%	-%	-%

Concentración de fuentes de Financiamiento	Julio	Agosto	Septiembre
<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>			
De exigibilidad inmediata	-%	-%	-%
De corto plazo	5%	6%	6%
De largo plazo	4%	4%	4%
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:

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

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

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

*(Cifras en millones de pesos)*

Exposición Potencial Futura (diciembre 2022)	
Con contrato de compensación	3,249
Sin contrato de compensación	5,017
Posibles llamadas de margen (diciembre 2022)	
Colateral en Tránsito	582
Downgrade (diciembre 2022)	
Baja calificación 3 niveles	3,435



La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de diciembre 2022 es la siguiente:

Scotiabank-Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	883,315
Tipo de cambio	151,411
Capitales	19,753
<b>Total</b>	<b>1,054,479</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 2022, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -5.60% al cierre de diciembre del 2022 y en promedio durante cuarto trimestre del 2022 fue de -5.24%

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>	
Concepto	Límite MM
Concentración de Depósitos (MXN)	9,000 MXN
Concentración de Depósitos (USD)	150 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 cubiertas 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 2022.

Descripción	Promedio T4 2022	Diciembre 2022
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	6,066	9,465
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	38,352	51,899
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	42	40
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	35	38
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	42	40
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	35	39

*(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 2022 y el promedio del cuarto trimestre de 2022 son:

Scotiabank	Posición (Cierre) <sup>7</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	60,080	56,798
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	88,816	85,281

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

<sup>7</sup> Cifras previas al cierre de septiembre 2022.

## 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:

- o Medición, supervisión y pronóstico de compromisos que involucren flujos de efectivo para las principales monedas manejadas por el Banco (MXP+UDIs y USD).
- o 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.
- o Mantener fuentes diversificadas de fondeo.
- o Establecer programas de corresponsalías y préstamos interbancarios para ayudar a mantener el acceso a mercado.
- o Instrumentar y mantener disponibles programas para la emisión de pasivos, y descuento de cartera con fondos especializados.
- o 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.
- o 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:

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

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

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

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

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

- o Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
- o Apegarse a los sistemas de alertas tempranos, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.
- o Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.

- o Plantear acciones que aseguren que el riesgo de liquidez global del Grupo este dentro de los límites de tolerancia aprobados por el Consejo de Administración.
- o Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.
- o Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital de manera oportuna.

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el cuarto trimestre de 2022, 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 2022, 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 2022

### Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto<sup>8</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	>1año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1año	
<b>ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE</b>										
1 Capital:	79,422.50	0.00	0.00	0.00	79,422.50	79,422.50	0.00	0.00	0.00	79,422.50
2 Capital fundamental y capital básico no fundamental.	79,422.50	0.00	0.00	0.00	79,422.50	79,422.50	0.00	0.00	0.00	79,422.50
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	210,328.98	915.96	71.11	194,954.53	0.00	210,328.98	915.96	71.11	194,954.53
5 Depósitos estables.	0.00	94,677.93	581.44	35.91	90,532.31	0.00	94,677.93	581.44	35.91	90,532.31
6 Depósitos menos estables.	0.00	115,651.05	334.52	35.20	104,422.21	0.00	115,651.05	334.52	35.20	104,422.21
7 Financiamiento mayorista.	0.00	325,399.01	21,707.49	22,038.81	149,233.35	0.00	325,399.01	21,707.49	22,038.81	149,233.35
8 Depósitos operacionales.	0.00	13,071.34	0.00	0.00	6,535.67	0.00	13,071.34	0.00	0.00	6,535.67
9 Otro financiamiento mayorista.	0.00	312,327.66	21,707.49	22,038.81	142,697.68	0.00	312,327.66	21,707.49	22,038.81	142,697.68
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	2,418.00	0.00	12,167.56	12,167.56	0.00	2,418.00	0.00	12,167.56	12,167.56
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	2,418.00	0.00	12,167.56	12,167.56	0.00	2,418.00	0.00	12,167.56	12,167.56
14 Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	79,422.50	538,145.99	22,623.45	34,277.47	435,777.94	79,422.50	538,145.99	22,623.45	34,277.47	435,777.94
<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	5,597.99	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	5,597.99
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	116,579.15	40,832.20	299,171.87	331,390.20	0.00	116,579.15	40,832.20	299,171.87	331,390.20
18 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	2,350.75	0.00	0.00	235.08	0.00	2,350.75	0.00	0.00	235.08
19 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	9,336.14	4,702.06	2,166.77	5,918.22	0.00	9,336.14	4,702.06	2,166.77	5,918.22
20 Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	86,898.38	33,227.71	135,296.32	168,516.27	0.00	86,898.38	33,227.71	135,296.32	168,516.27
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	3,147.18	3,338.33	184,154.21	147,655.25	0.00	3,147.18	3,338.33	184,154.21	147,655.25
23 Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	411.03	435.90	24,135.44	16,111.50	0.00	411.03	435.90	24,135.44	16,111.50
24 Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	15,257.73	0.00	1,690.01	9,065.38	0.00	15,257.73	0.00	1,690.01	9,065.38
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	52,125.42	860.61	3,331.51	43,592.18	0.00	52,125.42	860.61	3,331.51	43,592.18
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	1,726.12	0.00	0.00	1,467.20	No Aplica	1,726.12	0.00	0.00	1,467.20
29 Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,072.02	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,072.02
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	3,385.72	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,385.72
31 Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		50,399.30	860.61	3,331.51	35,667.23	0.00	50,399.30	860.61	3,331.51	35,667.23
32 Operaciones fuera de balance.	No Aplica	251,387.23	0.00	0.00	12,569.36	No Aplica	251,387.23	0.00	0.00	12,569.36
33 Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	393,149.73	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	393,149.73
34 Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	110.84	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	110.84

<sup>8</sup> Anexo 10 de las disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple. Cifras Previas.

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

**Durante diciembre 2022, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:**

o Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$166,274 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$140,540 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$82,671 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$24,827 millones y \$7,975 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$8,385 millones.

o Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$337,606 y por operaciones mercado de dinero de \$14,757 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$15,825 millones, deducciones de capital por \$10,479 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$6,442 millones.

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

**Promedio del tercer trimestre del 2022: 111.70% % – Promedio del cuarto trimestre del 2022: 110.84% (decremento: 86pb).** El coeficiente de financiamiento neto disminuyó 86pb respecto al tercer trimestre del 2022, esto debido principalmente a:

- El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 17,254 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 5,160 millones.
- El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas crecieron \$16,476 millones.

(c) La evolución de la composición del Monto de Financiamiento Estable Disponible y del Monto de Financiamiento Estable Requerido.

Monto Computable (MXN MM)	Septiembre	Diciembre
Financiamiento Estable Disponible	415,063	433,648
Financiamiento Estable Requerido	383,918	396,282
<b>Coeficiente de Fondeo Estable Neto</b>	<b>108.11%</b>	<b>109.43%</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 2022 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$16.63 millones de pesos, con una minusvalía de \$(0.20) millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1-AMX-L	250,000	4.42	4.47	(0.05)
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	2,741	0.48	0.51	(0.03)
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	65,000	4.45	4.65	(0.20)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	3,400	7.28	7.21	0.07
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	-	-	(0.01)	0.01
<b>Total</b>			<b>321,141</b>	<b>16.63</b>	<b>16.83</b>	<b>(0.20)</b>

Al cierre del cuarto trimestre del año 2022, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$2.39 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	35,000	-	(0.04)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	224,461	0.06	(0.02)	0.04
Scotiabank	Pública	1-CEMEX-CPO	1,367,791	0.24	(0.10)	0.14
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	180,509	0.18	(0.06)	0.12
Scotiabank	Pública	1-FEMSA-UBD	7,374	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-BACHOCO-B	75,443	0.13	(0.01)	0.12
Scotiabank	Pública	1-VOLAR-A	178,033	0.13	-	0.13
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	35,466	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1-LASITE-B-1	696,220	0.15	(0.06)	0.09
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	100	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-EWG-*	8,528	0.03	(0.12)	(0.09)
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	4,500	0.20	-	0.20
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	1,300	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1I-MCHI-*	7,871	0.06	(0.60)	(0.54)
Scotiabank	Pública	1I-XLC-*	9,100	0.15	(0.10)	0.05
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	260,000	0.45	-	0.45
Scotiabank	Pública	1-CEMEX-CPO	251,214	0.25	-	0.25
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	35,000	0.18	-	0.18
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	107,700	0.21	-	0.21
Scotiabank	Pública	1A-PBR-N	5,000	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1A-BABA-N	400	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1I-EWG-*	8,500	0.41	-	0.41
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	1,000	-	(0.04)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1I-MCHI-*	4,928	0.12	(0.04)	0.08
Scotiabank	Pública	1I-XLC-*	4,800	0.13	-	0.13
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	120,000	0.07	-	0.07
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	40,176	0.05	(0.01)	0.04
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	73,138	0.08	-	0.08
Scotiabank	Pública	1B-NAFTRAC-ISHRS	128,335	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	5,500	0.18	-	0.18
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	2,122	0.02	(0.05)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	160	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-MEGA-CPO	257	-	-	-
<b>Total</b>			<b>3,879,926</b>	<b>3.66</b>	<b>(1.27)</b>	<b>2.39</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	BLADEX COM	8,095	-	-	-
<b>Total</b>			<b>9,317</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

Al 31 de diciembre de 2022, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de \$5.30 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$3.90 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.40 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	POSICIONES			Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición		
Por Riesgo General de Mercado	17.54	-	17.54	22.23%	3.90
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	16.63	-	16.63	8.00%	1.32
Índices accionarios	0.92	-	0.92	4.00%	0.04
Requerimiento por riesgos específico	0.92	-	0.92	4.00%	0.04
	<b>Total Requerimiento de capital</b>				<b>5.30</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-22	dic-22
	Exposiciones dentro del balance		
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	677,236	712,010
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,414)	(10,616)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	666,822	701,395
	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)	8,682	7,019
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	3,997	3,819
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)	(1,942)	(1,941)
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)	10,737	8,897
	Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	795	3,224
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(294)	(1,223)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	-	-
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-	-
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	501	2,001
	Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	256,309	264,565
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(167,625)	(168,959)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	88,684	95,606
	Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	70,556	68,247
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	766,745	807,899
	Coeficiente de apalancamiento		
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	9.20%	8.45%

Cifras en millones de pesos



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

REFERENCIA	DESCRIPCION	sep-22	dic-22
1	Activos totales	717,947	751,487
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	(808)	(612)
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	(29,178)	(27,355)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(294)	(1,223)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	88,684	95,606
7	Otros ajustes	(9,606)	(10,003)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	766,745	807,898.7

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	sep-22	dic-22
1	Activos totales	717,947	751,487
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(39,915)	(36,252)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(795)	(3,224)
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	677,237	712,010

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

CONCEPTO/PERIODO	sep-22	dic-22	Variación
Capital Básico <sup>1/</sup>	70,556	68,247	-3.3%
Activos Ajustados <sup>2/</sup>	766,745	807,899	5.4%
Razón de Apalancamiento <sup>3/</sup>	9.20%	8.45%	-75pb

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 2022.

El indicador se ubicó en 8.45%, 75pb inferior respecto al trimestre anterior, debido principalmente al incremento en las exposiciones totales por \$41,154 millones (-45 pb) y por la disminución en el capital de nivel 1 por \$2,308 millones (-30 pb).

La variación de -45pb se debe principalmente al incremento en las exposiciones dentro del balance (netas) por \$34,572 millones (-39pb) y en las exposiciones fuera del balance por \$6,922 millones (-7pb).

El Capital de Nivel 1 mostró una disminución trimestral de \$2,308 millones (-30pb), debido principalmente por decretos de dividendos en oct-22 y dic-22 por \$2,400 y \$2,000 millones respectivamente.

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 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>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.</p> <p>b) La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.</p> <p>c) El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.</p> <p>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.</p> <p>e) El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.</p>
	En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.
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 <i>entregados</i> en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
10	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11	Suma de las líneas 4 a 10
12	Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente) de operaciones de reporto y préstamo de valores. El importe no deberá considerar ninguna compensación conforme a los Criterios Contables.
13	<p>Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:</p> <p>a) Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.</p> <p>b) Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <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.
16	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	<p>Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%.</p> <p>El monto se debe registrar con signo negativo.</p>
19	Suma de las líneas 17 y 18
20	Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
21	Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19

22 Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

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

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

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

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

## Agencias Calificadoras

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

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

## Dividendos

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

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

**Fecha de pago**  
23 de abril de 2013

**Importe**  
\$ 165 millones

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

Mediante Asamblea General ordinaria de Accionistas de fecha 24 de mayo del 2013, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo por la cantidad de \$299'944,566.00 (Doscientos noventa y nueve millones novecientos cuarenta y cuatro mil quinientos sesenta y seis pesos 00/100) M.N. a razón de \$0.0483781558065 pesos por acción, para distribuirlo entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6'200,000,000 (Seis mil 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, 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 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, 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 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 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 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, 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 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 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 cuatrocientas 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".

### **Fuentes internas y externas de liquidez**

Al 31 de diciembre del 2022, 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\$60,974 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$66,325 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 2022, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



# Instrumentos Financieros Derivados

**Scotiabank**

## 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. Durante el cuarto trimestre de 2022, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apegan 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)

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



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

Subyacente*	Futuros		Opciones		Swaps	
	MR	ME	MR	ME	MR	ME
Acciones, un grupo o canasta de acciones, 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 ( <i>Swaps</i> ) en especie y por diferenciales.	✓	✓				

\*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.

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa 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 2022 y en promedio para el cuarto trimestre de 2022 es de:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) <sup>9</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	60,080	56,798
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	88,816	85,281

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

### Inventario de modelos de derivados

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

Clase de activo	Derivado	Tipo	Breve descripción
Tasas de interés			<p>Caps, Floors:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets.</li> </ul> $\text{Cap} = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$
	Europea		<ul style="list-style-type: none"> <li>• Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet.</li> </ul> $\text{Floor} = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$
	Opciones		<p>La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap).</li> <li>• Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).</li> </ul>
		Binaria	

<sup>9</sup> Cifras previas al cierre de junio 2022.

Tipo de cambio	IRS	El intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).
	CCIRS	Intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.
	Europea	En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black–Scholes–Merton.
	Americana	El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)
Opciones	Binaria	Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción. A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.
	Barrera	Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento $S_T$ , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t < T}$ , son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente $S_T$ alcance un umbral preestablecido $H$ llamado barrera de la opción.
Forward	Forward	Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.
	OTC	

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

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

## Políticas 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 TIIE.

## Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios 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 2022 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 2022 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha de actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos 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 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 2022 y promedio del cuarto trimestre 2022 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) <sup>10</sup>	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	88,816	85,281

<sup>10</sup> Cifras previas al cierre de diciembre 2022.

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

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

En donde:

Parámetro	Descripción
<b>SD</b>	Salida de efectivo por derivados.
<b>T<sub>ii</sub></b>	Umbral con la Contraparte i en el estado i
<b>T<sub>ij</sub></b>	Umbral con la Contraparte i en el estado j
<b>MTM</b>	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	60,080	56,645	56,645	56,645
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(3,435)	(3,435)	(3,435)

#### 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, 2022:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(17,639.15)	(5,530.18)	(246,330.40)	130,512.45	38,481.49	(60,128.23)	(160,634.02)
CCS	24,720.66	(2,255.17)	(1,493.87)	344.74	258.56	(28.73)	21,546.19
Caps&Floors	158.01	(57.46)	158.01	57.45	-	-	316.01
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total DERIVATIVES</b>	<b>7,239.52</b>	<b>(7,842.81)</b>	<b>(247,666.26)</b>	<b>130,914.64</b>	<b>38,740.05</b>	<b>(60,156.96)</b>	<b>(138,771.82)</b>

## 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 las sensibilidades es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (173.82) Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (347.65) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (862.18) 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	(0.14)	91.92	50.00	(6.94)	100.00	(13.88)	200.00	(27.75)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	-	(0.13)	0.10	-	0.40	-	1.00	-
a FX %	Forwards	85.54	1,668.85	0.10	(166.88)	0.20	(333.77)	0.50	(834.43)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
<b>Total</b>					<b>(173.82)</b>		<b>(347.65)</b>		<b>(862.18)</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 2022 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

	Delta	Vega	Gamma
Options AMD.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	56,450.00	2,076.00	12,747.00
Options DIS.N	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options EZU.P	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options MCHI.OQ	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options MSFDVG.INDX	14,727.00	238.00	3,444.00
Options NVDA.OQ	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>71,177.00</b>	<b>2,314.00</b>	<b>16,191.00</b>

### 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 AMD.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	(5,645.00)	(16,935.00)	(28,225.00)
Options DIS.N	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options EZU.P	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	-	-	-
Options MXSXA.E.INDX	-	-	-
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	(1,472.70)	(4,418.10)	(7,363.50)
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>(7,117.70)</b>	<b>(21,353.10)</b>	<b>(35,588.50)</b>

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

	Escenarios a la Alza		
	0.05	0.15	0.2
Options AMD.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	2,822.50	8,467.50	11,290.00
Options DIS.N	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options EZU.P	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	-	-	-

Options MXSXA.E.INDX	-	-	-
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	736.35	2,209.05	2,945.40
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>3,558.85</b>	<b>10,676.55</b>	<b>14,235.40</b>

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del Escenario	Monto
Probable	(7,117.70)
Poco Probable	(21,353.10)
Muy poco Probable	(35,588.50)

### 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 2022 se tienen los siguientes saldos:

Cifras expresadas en pesos

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	MXN	16,500,000	(30,200,000)
CLIENTE 2	MXN	407,000,000	(512,000,000)
CLIENTE 3	MXN	308,600,000	(50,500,000)
CLIENTE 4	MXN	43,400,000	(46,000,000)
CLIENTE 5	MXN	373,000,213	(1,252,945,689)
CLIENTE 6	USD	49,090,000	(45,260,000)
CLIENTE 7	USD	23,030,000	(7,640,000)
CLIENTE 8	USD	96,400,000	(316,000,000)
CLIENTE 9	USD	960,000	-
CLIENTE 10	USD	5,740,000	(4,690,000)
CLIENTE 11	USD	17,290,000	(13,400,000)
CLIENTE 12	USD	5,500,000	(2,740,000)
CLIENTE 13	MXN	240,700,000	(541,300,000)
CLIENTE 14	MXN	102,700,000	(219,600,000)
CLIENTE 15	MXN	221,700,000	(137,800,000)
CLIENTE 16	MXN	552,700,000	(5,848,700,000)
CLIENTE 17	MXN	48,878,224	(4,495,200,000)
CLIENTE 18	MXN	5,300,000	(1,100,000)
CLIENTE 19	USD	4,990,000	(9,500,000)
CLIENTE 20	USD	3,840,000	(1,070,000)
CLIENTE 21	MXN	6,600,000	-
CLIENTE 22	USD	4,140,000	(3,250,000)
<b>TOTAL</b>		<b>2,538,058,437</b>	<b>(13,538,895,689)</b>

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

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
P16916	Cap	oct-22	Sell	A	usd					27,761,269
P16917	Cap	oct-22	Buy	A	usd					27,761,269
P16897	Cap	oct-22	Buy	A	usd					6,975,054
P16904	Cap	oct-22	Sell	A	usd					6,975,054
P17090	Floor	oct-22	Buy	A	mxn					300,000,000
P17091	Cap	oct-22	Sell	A	mxn					300,000,000
P17092	Cap	oct-22	Buy	A	mxn					300,000,000
P17093	Cap	oct-22	Buy	A	mxn					300,000,000
P17094	Cap	oct-22	Sell	A	mxn					300,000,000
P17095	Floor	oct-22	Sell	A	mxn					300,000,000
SDW299	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDW318	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDW317	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	29,598,063	mxn	29,598,063	mxn	
SDW326	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	29,598,063	mxn	29,598,063	mxn	
SGK328	SC Swap	oct-22	Buy	A	usd	4,000,000	usd	4,000,000	usd	
SGK352	SC Swap	oct-22	Buy	A	usd	4,000,000	usd	4,000,000	usd	
SGY702	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,800,000,000	mxn	1,800,000,000	mxn	
SGQ659	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	18,469,809	mxn	18,469,809	mxn	
SGQ670	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	18,469,809	mxn	18,469,809	mxn	
SGL801	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	885,000,000	mxn	885,000,000	mxn	
SGV102	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SGV151	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDS103	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	5,023,762	mxn	5,023,762	mxn	
SDS129	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	5,023,762	mxn	5,023,762	mxn	
SEV633	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SGP653	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	15,572,034	mxn	15,572,034	mxn	
SGP655	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	15,572,034	mxn	15,572,034	mxn	
SGQ286	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	31,144,068	mxn	31,144,068	mxn	
SGQ319	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	31,144,068	mxn	31,144,068	mxn	
SGZ426	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	3,540,000,000	mxn	3,540,000,000	mxn	
SDT822	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	350,000,000	mxn	350,000,000	mxn	
SGM422	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SEW033	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	630,000,000	mxn	630,000,000	mxn	
SEW874	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SEW875	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SGZ876	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	mxn	
SHH223	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SHH245	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDW348	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SEW251	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SEW269	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SEW270	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SEW359	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SEY776	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	450,000,000	mxn	450,000,000	mxn	
SFX770	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	905,000,000	mxn	905,000,000	mxn	
SGW060	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,480,000	mxn	1,480,000	mxn	
SGW078	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,480,000	mxn	1,480,000	mxn	
SGW176	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	2,000,000	mxn	2,000,000	mxn	
SGW212	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	2,000,000	mxn	2,000,000	mxn	
SDV166	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDV218	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SGL493	SC Swap	oct-22	Buy	A	usd	1,500,000	usd	1,500,000	usd	
SGL560	SC Swap	oct-22	Buy	A	usd	1,500,000	usd	1,500,000	usd	
SGN588	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SEW963	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	625,000,000	mxn	625,000,000	mxn	
SGN714	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SGW441	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	2,000,000	mxn	2,000,000	mxn	
SGW443	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	2,000,000	mxn	2,000,000	mxn	
SEX099	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SEX112	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SGN918	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	mxn	
SGO260	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SGO446	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	665,000,000	mxn	665,000,000	mxn	
SDR906	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	565,000,000	mxn	565,000,000	mxn	
SDS867	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SGO676	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	660,000,000	mxn	660,000,000	mxn	
SFZ018	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	mxn	
SGO871	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SHB150	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
SDS210	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	150,000,000	mxn	150,000,000	mxn	
SDS665	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	350,000,000	mxn	350,000,000	mxn	
SDV278	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDV317	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDW354	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	230,000,000	mxn	230,000,000	mxn	
SEY080	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SFZ365	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SDR918	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	12,700,000	mxn	12,700,000	mxn	
SDR919	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDR926	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDS631	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	185,000,000	mxn	185,000,000	mxn	
SDS634	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	185,000,000	mxn	185,000,000	mxn	
SDW373	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	360,000,000	mxn	360,000,000	mxn	
SGP585	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	900,000,000	mxn	900,000,000	mxn	
MNF429	Term Deposit	oct-22	Buy	A	mxn			140,000,000	mxn	
SDT154	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	140,000,000	mxn	140,000,000	mxn	
SDT158	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	140,000,000	mxn	140,000,000	mxn	
SDT160	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	140,000,000	mxn	140,000,000	mxn	
C73442	CC Swap	oct-22	Buy	A	usd	324,477,839	mxn	15,960,543	usd	
C73443	CC Swap	oct-22	Buy	A	usd	15,960,543	usd	324,477,839	mxn	
MNF359	Term Deposit	oct-22	Buy	A	mxn			65,000,000	mxn	
SDS504	SC Swap	oct-22	Buy	A	usd	1,345,481	usd	1,345,481	usd	
SDS523	SC Swap	oct-22	Buy	A	usd	1,345,481	usd	1,345,481	usd	
SDS609	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	17,576,119	mxn	17,576,119	mxn	
SDS614	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	17,576,119	mxn	17,576,119	mxn	
SDT819	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	508,447	mxn	508,447	mxn	
SDT842	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	508,447	mxn	508,447	mxn	
SDW397	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	31,827,000	mxn	31,827,000	mxn	
SDW402	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	31,827,000	mxn	31,827,000	mxn	
SDW431	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	65,000,000	mxn	65,000,000	mxn	
SDW437	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	65,000,000	mxn	65,000,000	mxn	
SDW454	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	65,000,000	mxn	65,000,000	mxn	
SDW664	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	35,000,000	mxn	35,000,000	mxn	
SDW668	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	35,000,000	mxn	35,000,000	mxn	
SFA420	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,050,000,000	mxn	1,050,000,000	mxn	
SFA581	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,050,000,000	mxn	1,050,000,000	mxn	
SFZ754	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	900,000,000	mxn	900,000,000	mxn	
SFZ761	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	600,000,000	mxn	600,000,000	mxn	
SGW022	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SGW025	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SHC175	SC Swap	oct-22	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
P17098	Cap	nov-22	Sell	A	mxn					110,000,000
P17099	Cap	nov-22	Buy	A	mxn					110,000,000
SDS410	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	165,000,000	mxn	165,000,000	mxn	
SGY007	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	1,400,000	mxn	1,400,000	mxn	
SGY019	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	1,400,000	mxn	1,400,000	mxn	
SDS436	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	165,000,000	mxn	165,000,000	mxn	
SEY775	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	430,000,000	mxn	430,000,000	mxn	
SFZ897	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	510,000,000	mxn	510,000,000	mxn	
SHC469	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	1,320,000,000	mxn	1,320,000,000	mxn	
SDS651	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,300,000,000	mxn	2,300,000,000	mxn	
SDS659	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,300,000,000	mxn	2,300,000,000	mxn	
SEZ335	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	550,000,000	mxn	550,000,000	mxn	
SEZ336	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	550,000,000	mxn	550,000,000	mxn	
SEZ399	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SGQ865	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SGY396	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,000,000	mxn	2,000,000	mxn	
SGY399	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,000,000	mxn	2,000,000	mxn	
SGY405	SC Swap	nov-22	Buy	A	usd	500,000	usd	500,000	usd	
SGY409	SC Swap	nov-22	Buy	A	usd	500,000	usd	500,000	usd	
SHC242	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SHC264	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDS203	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	4,139,297	mxn	4,139,297	mxn	
SDS280	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	4,139,297	mxn	4,139,297	mxn	
C82972	CC Swap	nov-22	Buy	A	usd	399,200,000	mxn	20,000,000	usd	
C82973	CC Swap	nov-22	Buy	A	usd	20,000,000	usd	399,200,000	mxn	
SDS722	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SHD070	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	1,725,000,000	mxn	1,725,000,000	mxn	
MNF355	Term Deposit	nov-22	Buy	A	mxn			113,010,008	mxn	

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
SDW407	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	4,101,627	mxn	4,101,627	mxn	
SDW413	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	4,101,627	mxn	4,101,627	mxn	
SDW421	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	113,010,008	mxn	113,010,008	mxn	
SDW445	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	113,010,008	mxn	113,010,008	mxn	
SDW450	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	113,010,008	mxn	113,010,008	mxn	
SEZ981	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	625,000,000	mxn	625,000,000	mxn	
SGY731	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,320,000	mxn	2,320,000	mxn	
SGY738	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,320,000	mxn	2,320,000	mxn	
SDT470	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	29,982,029	mxn	29,982,029	mxn	
SDT507	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	29,982,029	mxn	29,982,029	mxn	
SDT689	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	15,256,482	mxn	15,256,482	mxn	
SDT694	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	15,256,482	mxn	15,256,482	mxn	
SDU931	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	12,952,431	mxn	12,952,431	mxn	
SDU959	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	12,952,431	mxn	12,952,431	mxn	
SDS936	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,500,000,000	mxn	2,500,000,000	mxn	
SDS939	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,500,000,000	mxn	2,500,000,000	mxn	
SGY993	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,000,000	mxn	2,000,000	mxn	
SGZ007	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	2,000,000	mxn	2,000,000	mxn	
SDS794	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	87,500,000	mxn	87,500,000	mxn	
MNF356	Term Deposit	nov-22	Buy	A	mxn			133,492,215	mxn	
SDW468	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	133,492,215	mxn	133,492,215	mxn	
SDW474	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	133,492,215	mxn	133,492,215	mxn	
SDW478	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	133,492,215	mxn	133,492,215	mxn	
SDW492	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	66,507,785	mxn	66,507,785	mxn	
SDW510	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	66,507,785	mxn	66,507,785	mxn	
SGW230	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	9,730,747	mxn	9,730,747	mxn	
SGW308	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	9,730,747	mxn	9,730,747	mxn	
SHD175	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	4,200,000	mxn	4,200,000	mxn	
SHD205	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	4,200,000	mxn	4,200,000	mxn	
SDW486	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	16,896,378	mxn	16,896,378	mxn	
SDW502	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	16,896,378	mxn	16,896,378	mxn	
SHD982	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SHD593	SC Swap	nov-22	Buy	A	usd	2,500,000	usd	2,500,000	usd	
SHD636	SC Swap	nov-22	Buy	A	usd	2,500,000	usd	2,500,000	usd	
SDV452	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SHE115	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SHE125	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SFB414	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	425,000,000	mxn	425,000,000	mxn	
SDR950	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	60,000,000	mxn	60,000,000	mxn	
SDS019	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	60,000,000	mxn	60,000,000	mxn	
SDV836	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SGU087	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	700,000,000	mxn	700,000,000	mxn	
SDV522	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDW127	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	55,000,000	mxn	55,000,000	mxn	
SDW516	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	40,000,000	mxn	40,000,000	mxn	
SDW522	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	40,000,000	mxn	40,000,000	mxn	
SDT425	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	400,000,000	mxn	400,000,000	mxn	
SDT429	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	400,000,000	mxn	400,000,000	mxn	
SGU680	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SDS509	SC Swap	nov-22	Buy	A	usd	4,700,000	usd	4,700,000	usd	
SDT083	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SDT086	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SDU149	SC Swap	nov-22	Buy	A	usd	4,700,000	usd	4,700,000	usd	
SDW582	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDW596	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDW605	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDW611	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDX304	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SGR570	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	800,000,000	mxn	800,000,000	mxn	
SGR572	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	800,000,000	mxn	800,000,000	mxn	
SDT103	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDT132	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	40,000,000	mxn	40,000,000	mxn	
SFC467	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SDW546	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SDW549	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	6,000,000	mxn	6,000,000	mxn	
SDW558	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	6,000,000	mxn	6,000,000	mxn	
SDW561	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SFC571	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	225,000,000	mxn	225,000,000	mxn	
SGV355	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	1,800,000,000	mxn	1,800,000,000	mxn	

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
C73993	CC Swap	nov-22	Buy	A	usd	563,098,849	mxn	25,883,652	usd	
C73994	CC Swap	nov-22	Buy	A	usd	25,883,652	usd	563,098,849	mxn	
C7421	CC Swap	nov-22	Buy	A	usd	546,921,727	mxn	25,920,461	usd	
C74212	CC Swap	nov-22	Buy	A	usd	25,920,461	usd	546,921,727	mxn	
C80335	CC Swap	nov-22	Buy	A	usd	230,859,000	mxn	11,350,000	usd	
C80337	CC Swap	nov-22	Buy	A	usd	11,350,000	usd	230,859,000	mxn	
P17932	Cap	nov-22	Sell	A	mxn					70,000,000
P17933	Cap	nov-22	Buy	A	mxn					70,000,000
SDS308	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SDS310	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SDT798	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	4,536,131	mxn	4,536,131	mxn	
SDT847	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	4,536,131	mxn	4,536,131	mxn	
SDV944	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	11,398,000	mxn	11,398,000	mxn	
SDV956	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	42,129,000	mxn	42,129,000	mxn	
SDV980	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	12,215,220	mxn	12,215,220	mxn	
SDW120	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	1,028,700	mxn	1,028,700	mxn	
SDW125	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	1,028,700	mxn	1,028,700	mxn	
SDW586	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	8,100,000	mxn	8,100,000	mxn	
SDW593	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	8,100,000	mxn	8,100,000	mxn	
SDW968	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	26,606,796	mxn	26,606,796	mxn	
SDW969	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	26,606,796	mxn	26,606,796	mxn	
SGV530	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	3,400,000,000	mxn	3,400,000,000	mxn	
SGV531	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	3,400,000,000	mxn	3,400,000,000	mxn	
SHF974	SC Swap	nov-22	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SHI993	SC Swap	nov-22	Buy	A	usd	89,000,000	usd	89,000,000	usd	
SDV114	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SDW616	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDW620	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SFC913	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	660,000,000	mxn	660,000,000	mxn	
SFC916	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	660,000,000	mxn	660,000,000	mxn	
SGW020	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	mxn	
SGW021	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	mxn	
SGU651	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SGU682	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SDS070	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	70,000,000	mxn	70,000,000	mxn	
SDS080	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	70,000,000	mxn	70,000,000	mxn	
SGU652	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SGU681	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SDW635	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	900,000,000	mxn	900,000,000	mxn	
SFE770	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	325,000,000	mxn	325,000,000	mxn	
SGU650	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SGU684	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SGW542	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	445,000,000	mxn	445,000,000	mxn	
SDS858	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	11,028,219	mxn	11,028,219	mxn	
SDS878	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	11,028,219	mxn	11,028,219	mxn	
SDS888	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	21,841,223	mxn	21,841,223	mxn	
SDS898	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	21,841,223	mxn	21,841,223	mxn	
SDT546	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SDU422	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDU445	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDX171	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	600,000,000	mxn	600,000,000	mxn	
SGY537	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SGY548	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SDS088	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDT474	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	54,254,620	mxn	54,254,620	mxn	
SGN345	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	mxn	
SGN351	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	mxn	
SDT106	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	16,312,483	mxn	16,312,483	mxn	
SDT119	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	16,312,483	mxn	16,312,483	mxn	
P17195	Cap	dic-22	Buy	A	mxn					1,000,000,000
SGY997	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SGZ013	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
P17142	Cap	dic-22	Sell	A	mxn					1,000,000,000
SDW432	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDX217	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	140,000,000	mxn	140,000,000	mxn	
SDX343	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDX344	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	140,000,000	mxn	140,000,000	mxn	
SER458	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	3,212,963	mxn	3,212,963	mxn	
SER556	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	3,212,963	mxn	3,212,963	mxn	



TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
SGW064	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	mxn	
SGW222	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	mxn	
SHG894	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	6,200,000	mxn	6,200,000	mxn	
SHH002	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	6,200,000	mxn	6,200,000	mxn	
SDS176	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDT017	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	19,633,327	mxn	19,633,327	mxn	
SDT018	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	19,633,327	mxn	19,633,327	mxn	
SDT029	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	10,026,364	mxn	10,026,364	mxn	
SDT095	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	10,026,364	mxn	10,026,364	mxn	
SDX273	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDX284	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SGU617	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	6,000,000,000	mxn	6,000,000,000	mxn	
SGU620	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	6,000,000,000	mxn	6,000,000,000	mxn	
SGV825	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SGV874	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SGW439	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SGW442	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SHD401	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	1,300,000	mxn	1,300,000	mxn	
SHD449	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	1,300,000	mxn	1,300,000	mxn	
P17112	Floor	dic-22	Buy	A	mxn					130,000,000
P17113	Floor	dic-22	Sell	A	mxn					130,000,000
P17114	Cap	dic-22	Buy	A	mxn					130,000,000
P17115	Cap	dic-22	Sell	A	mxn					130,000,000
SGZ580	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SGZ582	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SHI110	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SDV662	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SGW721	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SGW811	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	7,500,000	mxn	7,500,000	mxn	
SHE295	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	1,300,000	mxn	1,300,000	mxn	
SHE296	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	1,300,000	mxn	1,300,000	mxn	
SDW004	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	5,390,000,000	mxn	5,390,000,000	mxn	
SHE495	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	2,100,000	mxn	2,100,000	mxn	
SHE556	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	2,100,000	mxn	2,100,000	mxn	
SDV695	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SFR712	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SGV820	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SGV870	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SGY459	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
P17111	Cap	dic-22	Buy	A	mxn					6,700,000
P18089	Cap	dic-22	Sell	A	mxn					6,700,000
SDT574	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	3,537,000	mxn	3,537,000	mxn	
SDV571	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	3,537,000	mxn	3,537,000	mxn	
SDW392	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
P17117	Cap	dic-22	Buy	A	mxn					15,000,000
P18158	Cap	dic-22	Sell	A	mxn					15,000,000
SDS305	SC Swap	dic-22	Buy	A	usd	13,300,000	usd	13,300,000	usd	
SDU150	SC Swap	dic-22	Buy	A	usd	13,300,000	usd	13,300,000	usd	
P16932	Cap	dic-22	Sell	A	mxn					20,000,000
P16933	Cap	dic-22	Buy	A	mxn					20,000,000
SGK892	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SGK893	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SDV065	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	6,994,275	mxn	6,994,275	mxn	
SDV067	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	20,358,580	mxn	20,358,580	mxn	
SDW676	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	6,994,275	mxn	6,994,275	mxn	
SDW684	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	20,358,580	mxn	20,358,580	mxn	
SDS150	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	57,166,667	mxn	57,166,667	mxn	
SDS174	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	57,166,667	mxn	57,166,667	mxn	
SDT125	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SDV759	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDS318	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	2,454,093	mxn	2,454,093	mxn	
SDS329	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	2,454,093	mxn	2,454,093	mxn	
SDT824	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	573,254	mxn	573,254	mxn	
SDT849	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	573,254	mxn	573,254	mxn	
SFX204	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	2,343,360	mxn	2,343,360	mxn	
SFX227	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	2,343,360	mxn	2,343,360	mxn	
SGX872	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	3,060,144,576	mxn	3,060,144,576	mxn	
SGX873	SC Swap	dic-22	Buy	A	mxn	3,060,144,576	mxn	3,060,144,576	mxn	

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022091403122	BO	USDMXN	oct-22	587,750	20.05	(11,787,298)
2022091403139	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.07	11,793,321
2022091303116	BO	USDMXN	oct-22	60,000	19.87	(1,192,196)
2022091303302	BO	USDMXN	oct-22	587,750	20.12	(11,822,675)
2022091303080	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	19.95	1,196,760
2022091303343	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.12	11,828,234
2022091203287	BO	USDMXN	oct-22	587,750	19.87	(11,675,882)
2022091203570	B	USDMXN	oct-22	587,750	19.91	(11,703,625)
2022091203110	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	19.83	11,655,670
2022091203293	SO	USDMXN	oct-22	(587,750)	19.87	11,680,650
2022091203300	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	19.87	11,680,650
2022090903347	BO	USDMXN	oct-22	557,000	19.96	(11,118,776)
2022090903515	B	USDMXN	oct-22	618,500	19.99	(12,360,738)
2022090903340	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	19.97	11,739,072
2022090903391	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	19.97	11,738,719
2022090903452	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	19.97	11,738,719
2022090803382	B	USDMXN	oct-22	587,750	20.03	(11,775,054)
2022090803344	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.10	11,815,479
2022090703067	BO	USDMXN	oct-22	587,750	20.18	(11,860,923)
2022090703063	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.19	11,866,085
2022090703064	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.19	11,866,085
2022090603246	BO	USDMXN	oct-22	587,750	20.22	(11,886,990)
2022090603276	SO	USDMXN	oct-22	(358,000)	20.22	7,238,175
2022090603232	BO	USDMXN	oct-22	105,000	20.06	(2,105,985)
2022090603233	BO	USDMXN	oct-22	129,000	20.06	(2,587,353)
2022090603236	BO	USDMXN	oct-22	124,000	20.06	(2,487,068)
2022090603180	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.24	11,894,885
2022090503079	BO	USDMXN	oct-22	587,750	20.07	(11,795,622)
2022090503097	BO	USDMXN	oct-22	587,750	20.06	(11,789,672)
2022090503031	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.08	11,802,079
2022090503082	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.07	11,795,672
2022090203172	B	USDMXN	oct-22	587,750	20.04	(11,776,539)
2022090203200	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.04	11,780,508
2022083003234	BON	USDMXN	oct-22	30,000,000	20.24	(607,305,000)
2022082503256	BO	USDMXN	oct-22	2,000,000	20.08	(40,151,742)
2022082503255	SO	USDMXN	oct-22	(2,000,000)	20.08	40,157,000
2022082503258	SO	USDMXN	oct-22	(2,000,000)	20.08	40,157,000
2022081003274	BO	USDMXN	oct-22	1,500,000	20.18	(30,274,677)
2022081003280	SO	USDMXN	oct-22	(1,500,000)	20.19	30,290,250
2022080903466	B	USDMXN	oct-22	1,650,000	20.46	(33,765,188)
2022080903039	SO	USDMXN	oct-22	(1,650,000)	20.42	33,686,070
2022080903047	SO	USDMXN	oct-22	(1,650,000)	20.42	33,686,070
2022041803540	B	USDMXN	oct-22	200,000	20.47	(4,094,230)
2022041803546	SO	USDMXN	oct-22	(200,000)	20.41	4,082,300
2021112403187	S	USDMXN	oct-22	(500,000)	22.63	11,312,700
2021110503463	B	USDMXN	oct-22	250,000	21.52	(5,381,014)
2021110503473	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	21.62	5,404,500
2021110303635	BO	USDMXN	oct-22	250,000	21.90	(5,475,550)
2021110303645	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	21.93	5,483,250
2022092303358	S	USDMXN	oct-22	(353,000)	20.23	7,140,604
2022092303198	BO	USDMXN	oct-22	117,000	20.03	(2,343,276)
2022092303199	BO	USDMXN	oct-22	126,000	20.03	(2,523,528)
2022092303200	BO	USDMXN	oct-22	110,000	20.03	(2,203,080)
2022091503489	S	USDMXN	oct-22	(350,000)	20.11	7,039,926
2022091503376	BO	USDMXN	oct-22	350,000	20.10	(7,033,600)
2022091303117	BO	USDMXN	oct-22	40,000	19.87	(794,943)
2022091303079	SO	USDMXN	oct-22	(40,000)	19.95	798,000
2022091303304	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.12	11,828,234
2022090603275	SO	USDMXN	oct-22	(125,000)	20.22	2,527,766
2022090603235	BO	USDMXN	oct-22	125,000	20.06	(2,507,563)
2022082403548	BO	USDMXN	oct-22	350,000	20.10	(7,033,766)
2022082403556	SO	USDMXN	oct-22	(350,000)	20.10	7,033,600

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022081503330	BO	USDMXN	oct-22	30,000	20.05	(601,420)
2022081503110	SO	USDMXN	oct-22	(30,000)	20.16	604,860
2022081203259	B	USDMXN	oct-22	30,000	20.06	(601,885)
2022081203466	BO	USDMXN	oct-22	400,000	20.04	(8,016,894)
2022081203221	SO	USDMXN	oct-22	(30,000)	20.16	604,845
2022081203694	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.06	2,006,350
2022081203704	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.06	2,006,350
2022081203711	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.06	2,006,350
2022081203717	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.06	2,006,350
2022080103065	S	USDMXN	oct-22	(10,000,000)	20.58	205,837,950
2022060103503	BO	USDMXN	oct-22	3,000,000	20.21	(60,619,322)
2022060103506	BO	USDMXN	oct-22	3,000,000	20.20	(60,598,065)
2022060103522	BO	USDMXN	oct-22	800,000	20.21	(16,164,228)
2022060103528	BO	USDMXN	oct-22	1,100,000	20.21	(22,225,649)
2022060103504	SO	USDMXN	oct-22	(3,000,000)	20.22	60,649,500
2022060103505	SO	USDMXN	oct-22	(3,000,000)	20.22	60,649,500
2022060103513	SO	USDMXN	oct-22	(3,000,000)	20.22	60,649,500
2022060103517	SO	USDMXN	oct-22	(3,000,000)	20.22	60,649,500
2022060103523	SO	USDMXN	oct-22	(800,000)	20.23	16,180,000
2022060103525	SO	USDMXN	oct-22	(800,000)	20.23	16,180,000
2022060103531	SO	USDMXN	oct-22	(1,100,000)	20.23	22,247,500
2022060103533	SO	USDMXN	oct-22	(1,100,000)	20.23	22,247,500
2022092803470	B	USDMXN	oct-22	98,672	20.15	(1,987,971)
2022092803451	SO	USDMXN	oct-22	(49,020)	20.17	988,537
2022092803453	SO	USDMXN	oct-22	(49,652)	20.17	1,001,282
2022092303360	S	USDMXN	oct-22	(388,000)	20.23	7,850,947
2022092303217	BO	USDMXN	oct-22	142,000	20.06	(2,848,804)
2022092303218	BO	USDMXN	oct-22	135,000	20.06	(2,708,370)
2022092303219	BO	USDMXN	oct-22	111,000	20.06	(2,226,882)
2022092203408	BO	USDMXN	oct-22	96,000	19.99	(1,919,463)
2022092203412	BO	USDMXN	oct-22	800	19.98	(15,985)
2022092203390	SO	USDMXN	oct-22	(48,400)	20.01	968,387
2022092203391	SO	USDMXN	oct-22	(48,400)	20.01	968,387
2022092103467	BO	USDMXN	oct-22	51,228	19.93	(1,021,022)
2022092103463	SO	USDMXN	oct-22	(51,228)	19.95	1,022,152
2022091903328	BO	USDMXN	oct-22	44,328	20.02	(887,392)
2022091903233	SO	USDMXN	oct-22	(44,328)	20.03	887,983
2022091303330	BO	USDMXN	oct-22	14,800	20.11	(297,620)
2022091303562	BO	USDMXN	oct-22	45,000	20.16	(907,410)
2022091303298	SO	USDMXN	oct-22	(15,200)	20.13	305,920
2022091303373	SO	USDMXN	oct-22	(44,600)	20.12	897,499
2022091203304	BO	USDMXN	oct-22	50,000	19.87	(993,630)
2022091203272	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	19.98	998,915
2022090903509	BO	USDMXN	oct-22	220,000	19.98	(4,395,783)
2022090903519	B	USDMXN	oct-22	176,000	19.99	(3,518,700)
2022090903334	SO	USDMXN	oct-22	(44,000)	19.98	879,076
2022090903335	SO	USDMXN	oct-22	(44,000)	19.98	879,076
2022090903336	SO	USDMXN	oct-22	(44,000)	19.98	879,076
2022090903337	SO	USDMXN	oct-22	(44,000)	19.98	879,076
2022090903352	SO	USDMXN	oct-22	(44,000)	19.99	879,604
2022090903353	SO	USDMXN	oct-22	(44,000)	19.99	879,604
2022090903354	SO	USDMXN	oct-22	(44,000)	19.99	879,604
2022090903355	SO	USDMXN	oct-22	(44,000)	19.99	879,604
2022090903356	SO	USDMXN	oct-22	(44,000)	19.99	879,604
2022090803372	BO	USDMXN	oct-22	110,300	20.08	(2,214,764)
2022090803184	SO	USDMXN	oct-22	(51,900)	20.11	1,043,787
2022090803312	SO	USDMXN	oct-22	(58,400)	20.06	1,171,300
2022090603567	BO	USDMXN	oct-22	10,300	20.25	(208,529)
2022090603277	SO	USDMXN	oct-22	(105,000)	20.23	2,123,718
2022090603234	BO	USDMXN	oct-22	105,000	20.06	(2,106,773)
2022090603583	SO	USDMXN	oct-22	(10,300)	20.30	209,069
2022090503176	BO	USDMXN	oct-22	22,300	20.11	(448,514)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022090503177	SO	USDMXN	oct-22	(22,300)	20.17	449,680
2022090203513	BO	USDMXN	oct-22	400,000	20.07	(8,028,125)
2022090203539	SO	USDMXN	oct-22	(400,000)	20.12	8,047,360
2022082603488	BO	USDMXN	oct-22	32,400	20.09	(650,879)
2022082603492	BO	USDMXN	oct-22	63,600	20.09	(1,277,652)
2022082603515	B	USDMXN	oct-22	80,600	20.14	(1,623,180)
2022082603450	SO	USDMXN	oct-22	(63,600)	20.10	1,278,487
2022082603505	SO	USDMXN	oct-22	(113,000)	20.13	2,274,973
2022082403324	B	USDMXN	oct-22	18,000	20.07	(361,349)
2022082403239	SO	USDMXN	oct-22	(18,000)	20.09	361,552
2022080903257	BO	USDMXN	oct-22	50,000	20.48	(1,023,823)
2022080903285	BO	USDMXN	oct-22	3,200	20.47	(65,493)
2022080903118	SO	USDMXN	oct-22	(53,200)	20.50	1,090,387
2022060203387	BO	USDMXN	oct-22	55,000	20.03	(1,101,718)
2022060203368	SO	USDMXN	oct-22	(55,000)	20.15	1,108,195
2022053003158	BO	USDMXN	oct-22	125,000	19.98	(2,498,097)
2022053003070	SO	USDMXN	oct-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003128	SO	USDMXN	oct-22	(10,000)	19.84	198,401
2022033003098	B	USDMXN	oct-22	1,100,000	20.55	(22,599,632)
2022033003139	SO	USDMXN	oct-22	(987,000)	20.48	20,212,872
2022033003158	SO	USDMXN	oct-22	(103,000)	20.48	2,109,347
2022033003227	SO	USDMXN	oct-22	(10,000)	20.48	204,791
2021100403404	BO	USDMXN	oct-22	51,473	21.72	(1,118,216)
2021083003126	S	MXNUSD	oct-22	(43,094,278)	21.33	2,020,545
2021083003129	S	MXNUSD	oct-22	(90,553,609)	21.32	4,246,599
2021083003131	S	MXNUSD	oct-22	(40,124,758)	21.32	1,881,831
2021083003453	BO	USDMXN	oct-22	47,153	21.31	(1,004,934)
2021083003309	SO	USDMXN	oct-22	(8,196,127)	21.20	173,772,646
2021092903483	SO	USDMXN	oct-22	(8,247,601)	21.07	173,772,646
2022092903524	B	USDMXN	oct-22	100,000	20.18	(2,018,275)
2022092903212	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	21.08	2,108,000
2022092003493	BO	USDMXN	oct-22	50,000	20.03	(1,001,707)
2022092003495	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.13	1,006,300
2022091903115	BO	USDMXN	oct-22	800,000	20.04	(16,033,081)
2022091903124	SO	USDMXN	oct-22	(800,000)	20.04	16,031,200
2022091403500	BO	USDMXN	oct-22	50,000	20.00	(1,000,148)
2022091403452	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.09	1,004,450
2022091203503	BO	USDMXN	oct-22	16,261	19.96	(324,591)
2022091203576	SO	USDMXN	oct-22	(16,261)	20.00	325,275
2022090903737	BO	USDMXN	oct-22	100,000	19.97	(1,996,930)
2022090903702	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.05	2,005,000
2022082403326	B	USDMXN	oct-22	12,500	20.08	(250,987)
2022082403114	SO	USDMXN	oct-22	(12,500)	20.05	250,610
2022080903280	BO	USDMXN	oct-22	300,000	20.43	(6,129,334)
2022080903113	SO	USDMXN	oct-22	(300,000)	20.43	6,130,350
2022080303053	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	20.97	5,243,523
2022080303045	BO	USDMXN	oct-22	250,000	20.85	(5,213,250)
2022071203147	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	21.15	2,114,940
2022071203079	BO	USDMXN	oct-22	100,000	21.08	(2,108,000)
2022032203496	B	USDMXN	oct-22	1,388,498	21.05	(29,234,690)
2022032203530	SO	USDMXN	oct-22	(1,388,498)	21.00	29,157,487
2021110103243	SO	USDMXN	oct-22	(500,000)	22.09	11,042,516
2021101803163	BO	USDMXN	oct-22	500,000	21.66	(10,829,883)
2021101803176	SO	USDMXN	oct-22	(500,000)	21.68	10,838,650
2022100303298	S	EURMXN	oct-22	(31,137)	19.66	612,161
2022100303299	S	EURMXN	oct-22	(41,179)	19.66	809,574
2022093003615	BO	USDMXN	oct-22	20,000	20.11	(402,237)
2022093003192	SO	USDMXN	oct-22	(20,000)	20.20	403,960
2022092303364	S	USDMXN	oct-22	(220,000)	20.25	4,454,234
2022092303242	BO	USDMXN	oct-22	112,000	20.07	(2,247,728)
2022092303243	BO	USDMXN	oct-22	108,000	20.07	(2,167,452)
2022092103526	BO	USDMXN	oct-22	100,000	19.98	(1,997,957)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022092103504	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.06	2,005,800
2022091303073	B	USDMXN	oct-22	1,000,000	20.14	(20,140,716)
2022091303051	SO	USDMXN	oct-22	(1,000,000)	20.78	20,775,000
2022090903308	B	USDMXN	oct-22	1,500,000	19.98	(29,966,349)
2022090903048	BO	USDMXN	oct-22	1,000,000	20.78	(20,775,000)
2022090903046	SO	USDMXN	oct-22	(2,500,000)	20.78	51,937,500
2022090203175	BO	USDMXN	oct-22	125,000	20.05	(2,506,248)
2022090203207	SO	USDMXN	oct-22	(125,000)	20.06	2,507,625
2022083103037	B	USDMXN	oct-22	2,500,000	20.32	(50,789,551)
2022083103045	BO	USDMXN	oct-22	2,500,000	20.78	(51,937,500)
2022083103040	SO	USDMXN	oct-22	(5,000,000)	20.78	103,875,000
2022082403497	B	USDMXN	oct-22	1,250,000	20.08	(25,103,740)
2022082403466	SO	USDMXN	oct-22	(1,250,000)	20.19	25,231,250
2022081203687	BO	USDMXN	oct-22	100,000	20.04	(2,004,082)
2022081203555	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.05	2,005,000
2022081003058	BO	USDMXN	oct-22	1,500,000	20.22	(30,335,930)
2022081003057	SO	USDMXN	oct-22	(1,500,000)	20.23	30,338,250
2022081003060	SO	USDMXN	oct-22	(1,500,000)	20.23	30,338,250
2022061303094	S	USDMXN	oct-22	(5,000,000)	20.83	104,167,115
2022061303099	BO	USDMXN	oct-22	5,000,000	20.78	(103,875,000)
2022053003336	B	USDMXN	oct-22	250,000	20.03	(5,006,281)
2022053003215	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	20.15	5,038,000
2022052303090	B	USDMXN	oct-22	750,000	20.33	(15,245,345)
2022052303103	SO	USDMXN	oct-22	(750,000)	20.21	15,157,200
2022052303130	SO	USDMXN	oct-22	(750,000)	20.21	15,157,200
2022040403474	BO	USDMXN	oct-22	1,435,448	20.49	(29,410,340)
2022040403498	SO	USDMXN	oct-22	(1,435,448)	20.50	29,426,684
2022033003759	B	USDMXN	oct-22	100,000	20.60	(2,060,365)
2022033003453	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.62	2,061,960
2021113003523	B	USDMXN	oct-22	200,000	22.65	(4,530,618)
2021113003538	SO	USDMXN	oct-22	(200,000)	22.78	4,556,400
2021092103413	S	USDMXN	oct-22	(131,250)	21.27	2,791,984
2021092103595	BO	USDMXN	oct-22	131,250	21.28	(2,792,567)
2022092303366	S	USDMXN	oct-22	(369,000)	20.26	7,475,518
2022092303250	BO	USDMXN	oct-22	36,000	20.07	(722,628)
2022092303251	BO	USDMXN	oct-22	109,000	20.07	(2,187,957)
2022092303260	BO	USDMXN	oct-22	111,000	20.07	(2,228,103)
2022092303266	BO	USDMXN	oct-22	113,000	20.07	(2,268,249)
2022090903305	B	USDMXN	oct-22	2,500,000	19.99	(49,985,070)
2022090903633	S	USDMXN	oct-22	(2,500,000)	19.99	49,970,870
2022090903301	S	USDMXN	oct-22	(2,500,000)	20.00	49,990,000
2022090903363	S	USDMXN	oct-22	(2,500,000)	20.00	49,990,000
2022081503332	BO	USDMXN	oct-22	30,000	20.08	(602,267)
2022081503109	SO	USDMXN	oct-22	(30,000)	20.19	605,700
2022081203261	B	USDMXN	oct-22	30,000	20.09	(602,732)
2022081203722	BO	USDMXN	oct-22	400,000	20.07	(8,026,512)
2022081203220	SO	USDMXN	oct-22	(30,000)	20.19	605,685
2022081203239	SO	USDMXN	oct-22	(30,000)	20.19	605,685
2022081203693	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.09	2,008,900
2022081203703	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.09	2,008,900
2022081203710	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.09	2,008,900
2022081203716	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.09	2,008,900
2022081003684	BO	USDMXN	oct-22	350,000	20.43	(7,149,708)
2022081003655	SO	USDMXN	oct-22	(350,000)	20.47	7,163,940
2022052403365	B	USDMXN	oct-22	100,000	20.38	(2,038,495)
2022052403091	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.40	2,040,140
2022100303169	BO	USDMXN	oct-22	244,000	20.04	(4,889,335)
2022100303434	BO	USDMXN	oct-22	48,944	20.07	(982,378)
2022100303181	SO	USDMXN	oct-22	(48,980)	20.05	982,220
2022100303182	SO	USDMXN	oct-22	(48,980)	20.05	982,220
2022100303183	SO	USDMXN	oct-22	(48,704)	20.05	976,686
2022100303184	SO	USDMXN	oct-22	(48,704)	20.05	976,686



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022100303185	SO	USDMXN	oct-22	(49,020)	20.05	983,023
2022100303333	SO	USDMXN	oct-22	(48,556)	20.08	974,932
2022092803474	B	USDMXN	oct-22	136,820	20.18	(2,760,425)
2022092803454	SO	USDMXN	oct-22	(47,200)	20.19	953,086
2022092803455	SO	USDMXN	oct-22	(42,420)	20.19	856,566
2022092803456	SO	USDMXN	oct-22	(47,200)	20.19	953,086
2022092303370	S	USDMXN	oct-22	(122,000)	20.26	2,471,896
2022092303268	BO	USDMXN	oct-22	122,000	20.08	(2,449,394)
2022092203410	BO	USDMXN	oct-22	92,000	20.02	(1,841,860)
2022092203640	BO	USDMXN	oct-22	50,000	20.00	(1,000,047)
2022092203389	SO	USDMXN	oct-22	(92,000)	20.03	1,843,128
2022092203598	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.00	1,000,000
2022092003203	BO	USDMXN	oct-22	234,000	20.06	(4,694,799)
2022092003489	BO	USDMXN	oct-22	48,800	20.06	(978,852)
2022092003504	BO	USDMXN	oct-22	44,640	20.05	(895,242)
2022092003207	SO	USDMXN	oct-22	(46,800)	20.08	939,566
2022092003208	SO	USDMXN	oct-22	(46,800)	20.08	939,566
2022092003209	SO	USDMXN	oct-22	(46,800)	20.08	939,566
2022092003210	SO	USDMXN	oct-22	(46,800)	20.08	939,566
2022092003211	SO	USDMXN	oct-22	(46,800)	20.08	939,566
2022092003467	SO	USDMXN	oct-22	(48,800)	20.08	979,719
2022092003520	SO	USDMXN	oct-22	(44,640)	20.11	897,621
2022090903522	B	USDMXN	oct-22	15,200	20.02	(304,289)
2022090903738	BO	USDMXN	oct-22	182,400	19.99	(3,646,783)
2022090903321	SO	USDMXN	oct-22	(15,200)	20.01	304,076
2022090903697	SO	USDMXN	oct-22	(45,600)	20.01	912,593
2022090903698	SO	USDMXN	oct-22	(45,600)	20.01	912,593
2022090903699	SO	USDMXN	oct-22	(45,600)	20.01	912,593
2022090903700	SO	USDMXN	oct-22	(45,600)	20.01	912,593
2022090803377	BO	USDMXN	oct-22	51,900	20.13	(1,044,534)
2022090803183	SO	USDMXN	oct-22	(51,900)	20.14	1,045,214
2022090203113	BO	USDMXN	oct-22	2,000,000	20.10	(40,191,172)
2022090203514	BO	USDMXN	oct-22	400,000	20.10	(8,039,200)
2022090203138	SO	USDMXN	oct-22	(2,000,000)	20.11	40,226,000
2022090203538	SO	USDMXN	oct-22	(400,000)	20.15	8,058,280
2022082603489	BO	USDMXN	oct-22	32,400	20.12	(651,789)
2022082603449	SO	USDMXN	oct-22	(32,400)	20.13	652,309
2022081203737	BO	USDMXN	oct-22	50,000	20.04	(1,002,092)
2022081203611	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.14	1,006,750
2022071903200	B	USDMXN	oct-22	144,500	20.78	(3,003,380)
2022071903160	SO	USDMXN	oct-22	(74,000)	20.76	1,535,870
2022071903161	SO	USDMXN	oct-22	(70,500)	20.76	1,463,228
2022053003159	BO	USDMXN	oct-22	125,000	20.01	(2,501,677)
2022053003069	SO	USDMXN	oct-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003127	SO	USDMXN	oct-22	(10,000)	19.84	198,401
2022033003102	B	USDMXN	oct-22	1,100,000	20.58	(22,633,240)
2022033003138	SO	USDMXN	oct-22	(987,000)	20.48	20,212,872
2022033003186	SO	USDMXN	oct-22	(103,000)	20.48	2,109,347
2022033003226	SO	USDMXN	oct-22	(10,000)	20.48	204,791
2022010403267	SO	USDMXN	oct-22	(290,832)	21.66	6,300,247
2022010403252	BON	USDMXN	oct-22	290,832	21.66	(6,300,000)
2022010403279	BON	USDMXN	oct-22	290,832	21.66	(6,300,000)
2021122103324	SO	USDMXN	oct-22	(285,650)	22.05	6,299,496
2021122103274	BON	USDMXN	oct-22	285,650	22.06	(6,300,000)
2021122103278	BON	USDMXN	oct-22	285,650	22.06	(6,300,000)
2021120703490	SO	USDMXN	oct-22	(283,592)	22.22	6,300,917
2021120703376	BON	USDMXN	oct-22	283,592	22.22	(6,300,000)
2021120703397	BON	USDMXN	oct-22	283,592	22.22	(6,300,000)
2021120703439	BON	USDMXN	oct-22	283,592	22.22	(6,300,000)
2021113003609	S	USDMXN	oct-22	(276,801)	22.67	6,274,553
2021113003408	BON	USDMXN	oct-22	276,801	22.76	(6,300,000)
2021113003432	BON	USDMXN	oct-22	276,801	22.76	(6,300,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022100703204	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	21.10	2,110,300
2022092703244	BO	USDMXN	oct-22	11,474	20.36	(233,656)
2022092703215	SO	USDMXN	oct-22	(11,474)	20.39	233,966
2022092203506	BO	USDMXN	oct-22	60,000	19.96	(1,197,643)
2022092203632	BO	USDMXN	oct-22	60,000	20.01	(1,200,471)
2022092203480	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.04	1,202,640
2022092203608	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.00	1,200,048
2022092203611	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.00	1,200,054
2022092203613	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.00	1,200,054
2022091203502	BO	USDMXN	oct-22	16,261	19.99	(324,994)
2022091203536	B	USDMXN	oct-22	60,000	19.97	(1,198,098)
2022091203160	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	19.89	1,193,100
2022091203575	SO	USDMXN	oct-22	(16,261)	20.00	325,275
2022090903524	B	USDMXN	oct-22	60,000	20.02	(1,201,360)
2022090903442	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.01	1,200,858
2022082503599	B	USDMXN	oct-22	60,000	20.11	(1,206,344)
2022082503606	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.11	1,206,312
2022082403328	B	USDMXN	oct-22	12,500	20.11	(251,376)
2022082403113	SO	USDMXN	oct-22	(12,500)	20.05	250,610
2022081003685	BO	USDMXN	oct-22	60,000	20.22	(1,213,043)
2022081003556	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.22	1,213,200
2022071203148	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	21.18	2,117,752
2022071203078	BO	USDMXN	oct-22	100,000	21.10	(2,110,300)
2022032203500	B	USDMXN	oct-22	1,388,498	21.09	(29,280,082)
2022032203529	SO	USDMXN	oct-22	(1,388,498)	21.00	29,157,487
2022031503282	SO	USDMXN	oct-22	(118,987)	21.73	2,585,239
2022031503210	BON	USDMXN	oct-22	118,987	21.73	(2,585,000)
2022031503226	BON	USDMXN	oct-22	118,987	21.73	(2,585,000)
2022012503190	SO	USDMXN	oct-22	(225,702)	21.71	4,900,814
2022012503184	BON	USDMXN	oct-22	225,702	21.71	(4,900,000)
2022012503187	BON	USDMXN	oct-22	225,702	21.71	(4,900,000)
202201103418	SO	USDMXN	oct-22	(83)	21.46	1,788
202201103436	SO	USDMXN	oct-22	(228,142)	21.46	4,895,582
202201103316	BON	USDMXN	oct-22	228,225	21.47	(4,900,000)
202201103349	BON	USDMXN	oct-22	228,225	21.47	(4,900,000)
2022010403345	S	USDMXN	oct-22	(226,088)	21.66	4,896,841
2022010403309	BON	USDMXN	oct-22	226,088	21.67	(4,900,000)
2022010403311	BON	USDMXN	oct-22	226,088	21.67	(4,900,000)
2021112403189	S	USDMXN	oct-22	(500,000)	22.68	11,337,849
2021110503466	B	USDMXN	oct-22	250,000	21.56	(5,391,140)
2021110503471	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	21.66	5,414,500
2021110303636	BO	USDMXN	oct-22	250,000	21.94	(5,486,172)
2021110303644	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	21.98	5,494,250
2022101003264	S	USDMXN	oct-22	(329,047)	19.99	6,578,628
2022100703037	B	USDMXN	oct-22	3,733,793	20.06	(74,896,162)
2022100703039	B	USDMXN	oct-22	2,844,851	20.06	(57,064,858)
2022100703040	B	USDMXN	oct-22	60,651	20.06	(1,216,594)
2022100703041	B	USDMXN	oct-22	61,139	20.06	(1,226,395)
2022100703042	B	USDMXN	oct-22	1,264,529	20.06	(25,365,188)
2022100703043	B	USDMXN	oct-22	706,177	20.06	(14,165,210)
2022100703044	B	USDMXN	oct-22	8,553,966	20.06	(171,584,004)
2022100703045	B	USDMXN	oct-22	183,710	20.06	(3,685,036)
2022100703046	B	USDMXN	oct-22	183,064	20.06	(3,672,073)
2022100703047	B	USDMXN	oct-22	791,605	20.06	(15,878,796)
2022100703048	B	USDMXN	oct-22	1,337,188	20.06	(26,822,648)
2022100703049	B	USDMXN	oct-22	9,721,256	20.06	(194,998,666)
2022100503006	B	USDMXN	oct-22	150,000,000	20.09	(3,012,990,000)
2022100503008	S	USDMXN	oct-22	(150,000,000)	20.09	3,013,140,000
2022093003612	BO	USDMXN	oct-22	50,000	20.17	(1,008,275)
2022093003194	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.24	1,011,950
2022092303466	S	USDMXN	oct-22	(112,000)	20.27	2,270,332
2022092303273	BO	USDMXN	oct-22	112,000	20.08	(2,249,408)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022092303280	BO	USDMXN	oct-22	110,000	20.08	(2,209,240)
2022092203402	B	USDMXN	oct-22	500,000	20.02	(10,009,490)
2022092203507	BO	USDMXN	oct-22	40,000	19.96	(798,575)
2022092203284	SO	USDMXN	oct-22	(500,000)	21.10	10,550,000
2022092203479	SO	USDMXN	oct-22	(40,000)	20.05	801,920
2022091203305	BO	USDMXN	oct-22	50,000	19.90	(995,192)
2022091203340	B	USDMXN	oct-22	100,000	19.96	(1,995,669)
2022091203059	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	19.91	1,990,500
2022091203271	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.01	1,000,515
2022090603566	BO	USDMXN	oct-22	51,617	20.28	(1,046,821)
2022090603548	SO	USDMXN	oct-22	(51,617)	20.28	1,046,951
2022081803338	SO	USDMXN	oct-22	(1,000,000)	20.38	20,378,677
2022081803461	S	USDMXN	oct-22	(652,610)	20.31	13,255,214
2022081803339	BO	USDMXN	oct-22	1,652,611	20.38	(33,675,261)
2022081803403	BON	USDMXN	oct-22	1,652,611	20.38	(33,675,261)
2022081703417	B	USDMXN	oct-22	20,000	20.20	(404,018)
2022081703409	SO	USDMXN	oct-22	(20,000)	20.27	405,344
2022081103465	B	USDMXN	oct-22	537,600	20.19	(10,855,612)
2022081103344	SO	USDMXN	oct-22	(537,601)	20.17	10,841,259
2022081103428	SON	USDMXN	oct-22	(537,601)	20.17	10,841,259
2022070603173	BO	EURUSD	oct-22	50,000	1.02	(51,211)
2022070603263	SO	USDMXN	oct-22	(500,000)	21.12	10,559,268
2022070603449	SO	USDMXN	oct-22	(234)	21.05	4,917
2022070603211	SO	EURUSD	oct-22	(50,000)	1.03	51,445
2022070603259	BO	USDMXN	oct-22	500,000	21.10	(10,550,000)
2022053003328	B	USDMXN	oct-22	3,000,000	20.05	(60,162,597)
2022053003340	B	USDMXN	oct-22	250,000	20.06	(5,014,100)
2022053003193	SO	USDMXN	oct-22	(3,000,000)	19.86	59,580,600
2022053003214	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	20.18	5,045,125
2022040403475	BO	USDMXN	oct-22	1,435,448	20.52	(29,450,682)
2022040403497	SO	USDMXN	oct-22	(1,435,448)	20.53	29,466,877
2022033003762	B	USDMXN	oct-22	100,000	20.63	(2,063,344)
2022033003452	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.65	2,065,130
2022032403615	B	USDMXN	oct-22	995,503	20.89	(20,791,356)
2022032403700	SO	USDMXN	oct-22	(995,503)	20.90	20,803,026
2022030703236	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	21.98	2,197,748
2022030703044	BO	USDMXN	oct-22	100,000	22.02	(2,201,910)
2022013103125	B	USDMXN	oct-22	669,464	21.70	(14,527,232)
2022013103174	SO	USDMXN	oct-22	(669,464)	21.76	14,567,202
2021120203417	BO	USDMXN	oct-22	333,333	22.51	(7,504,037)
2021120203425	SO	USDMXN	oct-22	(333,333)	22.56	7,519,000
2021112503071	SO	USDMXN	oct-22	(90,000)	22.78	2,049,788
2021112503140	BO	USDMXN	oct-22	90,000	22.52	(2,026,944)
2021111003160	BO	USDMXN	oct-22	3,000,000	21.69	(65,063,373)
2021111003159	SO	USDMXN	oct-22	(3,000,000)	21.69	65,079,000
2021111003164	SO	USDMXN	oct-22	(3,000,000)	21.69	65,079,000
2021092103415	S	USDMXN	oct-22	(131,250)	21.30	2,795,565
2021092103594	BO	USDMXN	oct-22	131,250	21.30	(2,795,901)
2022101103286	SO	USDMXN	oct-22	(1,243,342)	19.98	24,846,943
2022101103349	SON	USDMXN	oct-22	(1,243,342)	19.98	24,846,943
2022101003105	BO	USDMXN	oct-22	667,200	19.98	(13,328,134)
2022101003094	SON	USDMXN	oct-22	(667,200)	19.98	13,329,322
2022101003098	SON	USDMXN	oct-22	(667,200)	19.98	13,329,322
2022101003153	SON	USDMXN	oct-22	(667,200)	19.98	13,329,322
2022100403416	BO	USDMXN	oct-22	3,400,000	20.04	(68,128,739)
2022100403431	B	USDMXN	oct-22	7,902,121	20.04	(158,338,115)
2022100403413	SO	USDMXN	oct-22	(11,302,121)	20.04	226,514,855
2022100403477	SON	USDMXN	oct-22	(11,302,121)	20.04	226,514,855
2022093003613	BO	USDMXN	oct-22	50,000	20.18	(1,008,835)
2022093003193	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.25	1,012,525
2022092703437	S	USDMXN	oct-22	(12,855,540)	20.43	262,621,055
2022092703406	BO	USDMXN	oct-22	12,855,540	20.43	(262,600,114)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022092703444	BON	USDMXN	oct-22	12,855,540	20.43	(262,600,114)
2022092303468	S	USDMXN	oct-22	(336,000)	20.28	6,814,716
2022092303290	BO	USDMXN	oct-22	113,000	20.10	(2,270,735)
2022092303291	BO	USDMXN	oct-22	113,000	20.10	(2,270,735)
2022092303292	BO	USDMXN	oct-22	110,000	20.10	(2,210,450)
2022092003342	S	USDMXN	oct-22	(3,029,846)	20.10	60,894,148
2022092003344	S	USDMXN	oct-22	(551,854)	20.10	11,090,575
2022092003356	S	USDMXN	oct-22	(3,771,973)	20.09	75,782,335
2022092003230	BO	USDMXN	oct-22	7,353,673	20.10	(147,780,884)
2022092003301	BON	USDMXN	oct-22	7,353,673	20.10	(147,780,884)
2022090903464	B	USDMXN	oct-22	500,000	20.03	(10,017,224)
2022090903376	SO	USDMXN	oct-22	(500,000)	20.04	10,020,700
2022090203204	BO	USDMXN	oct-22	1,000,000	20.10	(20,097,640)
2022090203212	SO	USDMXN	oct-22	(1,000,000)	20.11	20,107,800
2022083003502	B	USDMXN	oct-22	1,289,828	20.31	(26,198,366)
2022083003470	SO	USDMXN	oct-22	(1,289,828)	20.33	26,221,953
2022083003518	SON	USDMXN	oct-22	(1,289,828)	20.33	26,221,953
2022082403271	B	USDMXN	oct-22	500,000	20.09	(10,044,620)
2022082403222	SO	USDMXN	oct-22	(500,000)	20.19	10,096,000
2022081603373	B	USDMXN	oct-22	1,000,000	20.14	(20,144,839)
2022081603416	BO	USDMXN	oct-22	167,755	20.14	(3,379,346)
2022081603298	SO	USDMXN	oct-22	(1,167,755)	20.11	23,483,318
2022081603328	SON	USDMXN	oct-22	(1,167,755)	20.11	23,483,318
2022070603443	BO	USDMXN	oct-22	255,668	21.08	(5,388,543)
2022070603300	SO	USDMXN	oct-22	(255,668)	21.09	5,390,992
2022070603350	SON	USDMXN	oct-22	(255,668)	21.09	5,390,992
2022052503105	BO	USDMXN	oct-22	3,200,000	20.39	(65,239,155)
2022052503112	BO	USDMXN	oct-22	66,193	20.39	(1,349,761)
2022052503292	SON	USDMXN	oct-22	(3,266,193)	20.39	66,603,554
2022040103606	BO	USDMXN	oct-22	280,000	20.61	(5,770,679)
2022040103607	BO	USDMXN	oct-22	292,039	20.60	(6,014,806)
2022040103501	SO	USDMXN	oct-22	(286,019)	20.60	5,893,135
2022040103510	SON	USDMXN	oct-22	(286,019)	20.60	5,893,135
2022040103532	SO	USDMXN	oct-22	(572,039)	20.60	11,786,292
2022040103545	SON	USDMXN	oct-22	(572,039)	20.60	11,786,292
2021110103244	SO	USDMXN	oct-22	(500,000)	22.13	11,064,927
2021101803019	BO	USDMXN	oct-22	50,000	21.70	(1,085,108)
2021101803029	BO	USDMXN	oct-22	450,000	21.70	(9,766,622)
2021101803022	SO	USDMXN	oct-22	(500,000)	21.72	10,858,500
2022093003614	BO	USDMXN	oct-22	30,000	20.15	(604,600)
2022093003191	SO	USDMXN	oct-22	(30,000)	20.24	607,200
2022091403155	B	USDMXN	oct-22	50,000,000	20.08	(1,004,200,000)
2022090603540	BO	USDMXN	oct-22	5,000,000	20.29	(101,462,046)
2022090603541	BO	USDMXN	oct-22	5,000,000	20.29	(101,457,350)
2022090603551	BO	USDMXN	oct-22	3,000,000	20.30	(60,891,768)
2022090603552	BO	USDMXN	oct-22	3,000,000	20.30	(60,890,343)
2022090603554	BO	USDMXN	oct-22	910,559	20.30	(18,481,522)
2022090603587	SO	USDMXN	oct-22	(2,499)	20.28	50,685
2022090603547	SO	USDMXN	oct-22	(16,908,060)	20.30	343,250,532
2022081503333	BO	USDMXN	oct-22	25,000	20.10	(502,592)
2022081503108	SO	USDMXN	oct-22	(25,000)	20.22	505,450
2022081203264	B	USDMXN	oct-22	30,000	20.12	(603,603)
2022081203219	SO	USDMXN	oct-22	(30,000)	20.22	606,540
2022052403367	B	USDMXN	oct-22	100,000	20.42	(2,041,649)
2022052403090	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.43	2,043,120
2022101203410	BO	USDMXN	oct-22	38,800	20.01	(776,428)
2022101203371	SO	USDMXN	oct-22	(38,800)	20.03	777,114
2022100503453	BO	USDMXN	oct-22	88,800	20.07	(1,782,595)
2022100503442	SO	USDMXN	oct-22	(88,800)	20.09	1,783,877
2022100403394	BO	USDMXN	oct-22	41,656	20.05	(835,119)
2022100403393	SO	USDMXN	oct-22	(41,656)	20.06	835,707
2022092803476	B	USDMXN	oct-22	64,800	20.19	(1,308,396)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022092803457	SO	USDMXN	oct-22	(32,400)	20.22	655,096
2022092803461	SO	USDMXN	oct-22	(32,400)	20.22	655,096
2022092303470	S	USDMXN	oct-22	(384,000)	20.29	7,790,207
2022092303296	BO	USDMXN	oct-22	124,000	20.10	(2,492,648)
2022092303297	BO	USDMXN	oct-22	111,000	20.10	(2,231,322)
2022092303422	BO	USDMXN	oct-22	149,000	20.11	(2,996,390)
2022092003338	BO	USDMXN	oct-22	21,550	20.12	(433,497)
2022092003369	SO	USDMXN	oct-22	(21,550)	20.17	434,599
2022091903329	BO	USDMXN	oct-22	48,800	20.07	(979,496)
2022091903421	BO	USDMXN	oct-22	48,800	20.03	(977,657)
2022091903232	SO	USDMXN	oct-22	(48,800)	20.09	980,177
2022091903411	SO	USDMXN	oct-22	(48,800)	20.07	979,367
2022091503571	BO	USDMXN	oct-22	48,000	20.18	(968,645)
2022091503617	BO	USDMXN	oct-22	48,000	20.19	(969,034)
2022091503374	SO	USDMXN	oct-22	(47,200)	20.16	951,670
2022091503572	SO	USDMXN	oct-22	(48,800)	20.19	985,321
2022091403332	BO	USDMXN	oct-22	47,000	20.03	(941,593)
2022091403501	BO	USDMXN	oct-22	600	20.08	(12,047)
2022091403337	SO	USDMXN	oct-22	(47,600)	20.04	954,094
2022091203564	BO	USDMXN	oct-22	46,400	19.97	(926,827)
2022091203559	SO	USDMXN	oct-22	(46,400)	19.99	927,568
2022090903526	B	USDMXN	oct-22	15,200	20.05	(304,748)
2022090903320	SO	USDMXN	oct-22	(15,200)	20.04	304,532
2022090803469	BO	USDMXN	oct-22	46,000	20.09	(924,038)
2022090803463	SO	USDMXN	oct-22	(46,000)	20.10	924,508
2022090203515	BO	USDMXN	oct-22	400,000	20.13	(8,050,469)
2022090203537	SO	USDMXN	oct-22	(400,000)	20.17	8,069,240
2022082503400	BO	USDMXN	oct-22	20,000	20.13	(402,672)
2022082503199	SO	USDMXN	oct-22	(20,000)	20.17	403,498
2022082203005	SON	USDMXN	oct-22	(1)	20.40	20
2022082203008	SON	USDMXN	oct-22	(1)	20.40	20
2022062803571	B	USDMXN	oct-22	55,348	20.57	(1,138,684)
2022062803487	SO	USDMXN	oct-22	(461,806)	20.50	9,468,964
2022062803620	SO	USDMXN	oct-22	(55,348)	20.66	1,143,335
2022062303447	B	USDMXN	oct-22	461,806	20.46	(9,448,751)
2022062303466	SO	USDMXN	oct-22	(461,806)	20.63	9,527,658
2022062203437	B	USDMXN	oct-22	41,931	20.49	(859,171)
2022062203417	SO	USDMXN	oct-22	(41,931)	20.68	867,167
2022053003160	BO	USDMXN	oct-22	125,000	20.04	(2,505,257)
2022053003068	SO	USDMXN	oct-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003126	SO	USDMXN	oct-22	(10,000)	19.84	198,401
2022051303528	B	USDMXN	oct-22	152,664	20.76	(3,169,428)
2022051303562	SO	USDMXN	oct-22	(77,872)	20.82	1,621,342
2022051303563	SO	USDMXN	oct-22	(47,150)	20.82	981,691
2022051303564	SO	USDMXN	oct-22	(27,642)	20.82	575,523
2022040703252	BO	USDMXN	oct-22	182,445	20.90	(3,812,928)
2022040703186	SO	USDMXN	oct-22	(182,445)	20.84	3,801,789
2022040603424	B	USDMXN	oct-22	57,472	20.91	(1,201,852)
2022040603453	SO	USDMXN	oct-22	(57,472)	20.88	1,200,182
2022040103574	B	USDMXN	oct-22	1,321,453	20.61	(27,235,992)
2022040103716	SO	USDMXN	oct-22	(170,866)	20.59	3,518,814
2022040103717	SO	USDMXN	oct-22	(222,473)	20.59	4,581,609
2022040103718	SO	USDMXN	oct-22	(900,833)	20.59	18,551,755
2022040103720	SO	USDMXN	oct-22	(27,281)	20.59	561,825
2022033103361	B	USDMXN	oct-22	211,501	20.63	(4,363,641)
2022033103279	SO	USDMXN	oct-22	(79,771)	20.60	1,643,386
2022033103299	SO	USDMXN	oct-22	(131,730)	20.60	2,713,809
2022033003104	B	USDMXN	oct-22	1,100,000	20.60	(22,665,255)
2022033003137	SO	USDMXN	oct-22	(987,000)	20.48	20,212,872
2022033003185	SO	USDMXN	oct-22	(103,000)	20.48	2,109,347
2022033003225	SO	USDMXN	oct-22	(10,000)	20.48	204,791
2022022503519	B	USDMXN	oct-22	387,095	21.30	(8,246,119)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022022503543	SO	USDMXN	oct-22	(119,932)	21.07	2,527,447
2022022503544	SO	USDMXN	oct-22	(267,163)	21.07	5,630,193
2022022303620	B	USDMXN	oct-22	3,901,468	21.16	(82,560,837)
2022022303656	SO	USDMXN	oct-22	(764,535)	21.00	16,054,700
2022022303670	SO	USDMXN	oct-22	(819,367)	21.00	17,206,133
2022022303694	SO	USDMXN	oct-22	(2,317,566)	21.00	48,667,264
2022021703610	B	USDMXN	oct-22	86,028	21.24	(1,827,184)
2022021703170	SO	USDMXN	oct-22	(86,028)	21.05	1,810,545
2022020803483	B	USDMXN	oct-22	65,753	21.59	(1,419,877)
2022020803506	SO	USDMXN	oct-22	(65,753)	21.30	1,400,736
2022020403026	B	USDMXN	oct-22	220,008	21.64	(4,761,137)
2022020403083	SO	USDMXN	oct-22	(81,302)	21.39	1,738,643
2022020403084	SO	USDMXN	oct-22	(128,760)	21.39	2,753,533
2022020403085	SO	USDMXN	oct-22	(9,946)	21.39	212,695
2022020203204	B	USDMXN	oct-22	91,371	21.59	(1,972,919)
2022020203456	B	USDMXN	oct-22	111,404	21.56	(2,402,110)
2022020203232	SO	USDMXN	oct-22	(25,792)	21.31	549,731
2022020203233	SO	USDMXN	oct-22	(65,579)	21.31	1,397,751
2022020203479	SO	USDMXN	oct-22	(46,449)	21.28	988,277
2022020203480	SO	USDMXN	oct-22	(64,955)	21.28	1,382,022
2022013103470	B	USDMXN	oct-22	90,116	21.64	(1,949,886)
2022013103597	B	USDMXN	oct-22	26,845	21.65	(581,279)
2022013103505	SO	USDMXN	oct-22	(90,116)	21.34	1,922,688
2022013103617	SO	USDMXN	oct-22	(26,845)	21.32	572,397
2022012803196	B	USDMXN	oct-22	942,726	21.92	(20,666,952)
2022012803479	B	USDMXN	oct-22	267,989	21.92	(5,875,508)
2022012803521	B	USDMXN	oct-22	227,870	21.93	(4,996,879)
2022012803248	SO	USDMXN	oct-22	(579,967)	21.62	12,537,727
2022012803249	SO	USDMXN	oct-22	(113,048)	21.62	2,443,872
2022012803250	SO	USDMXN	oct-22	(51,106)	21.62	1,104,810
2022012803251	SO	USDMXN	oct-22	(198,605)	21.62	4,293,443
2022012803599	SO	USDMXN	oct-22	(227,870)	21.62	4,925,410
2022012803647	SO	USDMXN	oct-22	(50,522)	21.62	1,092,159
2022012803648	SO	USDMXN	oct-22	(93,187)	21.62	2,014,470
2022012803649	SO	USDMXN	oct-22	(57,079)	21.62	1,233,905
2022012803650	SO	USDMXN	oct-22	(67,201)	21.62	1,452,718
2022012803668	SO	USDMXN	oct-22	(227,870)	21.61	4,923,131
2022012703307	B	USDMXN	oct-22	738,234	21.82	(16,104,728)
2022012703540	SO	USDMXN	oct-22	(82,964)	21.51	1,784,240
2022012703541	SO	USDMXN	oct-22	(161,570)	21.51	3,474,757
2022012703542	SO	USDMXN	oct-22	(68,108)	21.51	1,464,744
2022012703543	SO	USDMXN	oct-22	(57,913)	21.51	1,245,489
2022012703544	SO	USDMXN	oct-22	(71,067)	21.51	1,528,381
2022012703545	SO	USDMXN	oct-22	(230,606)	21.51	4,959,459
2022012703546	SO	USDMXN	oct-22	(66,006)	21.51	1,419,538
2021111003174	SO	USDMXN	oct-22	(500,000,000)	25.00	12,500,000,000
2022100303145	B	USDMXN	oct-22	50,000	20.04	(1,002,121)
2022100303100	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.18	1,009,000
2022093003659	SO	USDMXN	oct-22	(491,315)	20.18	9,913,811
2022093003571	BO	USDMXN	oct-22	491,315	20.15	(9,900,000)
2022092203630	BO	USDMXN	oct-22	60,000	20.03	(1,201,995)
2022092203607	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.03	1,201,614
2022091203504	BO	USDMXN	oct-22	8,131	20.01	(162,714)
2022091203539	B	USDMXN	oct-22	60,000	19.99	(1,199,640)
2022091203159	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	19.91	1,194,612
2022091203266	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	19.91	1,194,612
2022091203574	SO	USDMXN	oct-22	(8,131)	20.00	162,643
2022090903528	B	USDMXN	oct-22	60,000	20.05	(1,203,182)
2022090903441	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.04	1,202,442
2022090603557	BO	USDMXN	oct-22	5,000,000	20.30	(101,499,050)
2022090603560	BO	USDMXN	oct-22	4,640,015	20.30	(94,196,058)
2022090603588	SO	USDMXN	oct-22	(2,848)	20.29	57,787

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022090603546	SO	USDMXN	oct-22	(9,637,167)	20.31	195,721,228
2022082503597	B	USDMXN	oct-22	60,000	20.13	(1,208,043)
2022082503605	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.13	1,207,998
2022082303200	B	USDMXN	oct-22	300,000	20.24	(6,073,206)
2022082303194	SO	USDMXN	oct-22	(300,000)	20.28	6,083,250
2022081003686	BO	USDMXN	oct-22	60,000	20.25	(1,214,726)
2022081003555	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.25	1,214,910
2022071203149	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	21.21	2,120,531
2022071203077	BO	USDMXN	oct-22	100,000	21.13	(2,112,500)
2022032203382	B	USDMXN	oct-22	15,000,000	21.10	(316,455,000)
2022032203502	B	USDMXN	oct-22	1,388,498	21.12	(29,318,766)
2022032203376	SON	USDMXN	oct-22	(15,000,000)	21.19	317,880,000
2022032203528	SO	USDMXN	oct-22	(1,388,498)	21.00	29,157,487
2021121603437	B	USDMXN	oct-22	270,000	22.09	(5,963,302)
2021121603407	SO	USDMXN	oct-22	(270,000)	22.12	5,971,860
2021120103034	BO	USDMXN	oct-22	250,000	22.49	(5,622,297)
2021120103049	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	22.40	5,601,075
2022101703409	S	USDMXN	oct-22	(227,103)	20.12	4,568,179
2022100303148	B	USDMXN	oct-22	50,000	20.04	(1,002,123)
2022100303099	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.18	1,009,175
2022092303472	S	USDMXN	oct-22	(109,000)	20.29	2,212,103
2022092303295	BO	USDMXN	oct-22	149,000	20.11	(2,996,390)
2022092303445	BO	USDMXN	oct-22	109,000	20.08	(2,189,156)
2022090603573	B	USDMXN	oct-22	7,735,132	20.30	(157,020,750)
2022090603575	B	USDMXN	oct-22	60,000	20.30	(1,218,141)
2022090603545	SO	USDMXN	oct-22	(7,795,134)	20.31	158,326,958
2022053003343	B	USDMXN	oct-22	250,000	20.09	(5,021,564)
2022053003219	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	20.21	5,052,250
2022033003765	B	USDMXN	oct-22	100,000	20.66	(2,066,014)
2022033003451	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.68	2,068,060
2022031803517	BO	USDMXN	oct-22	1,389,002	21.23	(29,483,043)
2022031803524	BO	USDMXN	oct-22	46,500	21.23	(987,046)
2022031803530	SO	USDMXN	oct-22	(1,435,500)	21.23	30,482,125
2021113003545	B	USDMXN	oct-22	200,000	22.75	(4,549,007)
2021113003546	SO	USDMXN	oct-22	(200,000)	22.84	4,568,000
2021112603144	BO	USDMXN	oct-22	200,000	23.16	(4,631,879)
2021112603573	SO	USDMXN	oct-22	(200,000)	23.10	4,620,641
2021112603238	SO	USDMXN	oct-22	(200,000)	22.69	4,538,160
2021092103418	S	USDMXN	oct-22	(131,250)	21.32	2,798,548
2021092103593	BO	USDMXN	oct-22	131,250	21.33	(2,799,234)
2022101803504	B	USDMXN	oct-22	109,000	20.03	(2,182,780)
2022101803508	B	USDMXN	oct-22	130,000	20.03	(2,603,315)
2022101803509	B	USDMXN	oct-22	115,000	20.03	(2,302,933)
2022092303474	S	USDMXN	oct-22	(333,000)	20.31	6,761,855
2022092303346	BO	USDMXN	oct-22	109,000	20.12	(2,193,189)
2022092303347	BO	USDMXN	oct-22	112,000	20.12	(2,253,552)
2022092303348	BO	USDMXN	oct-22	112,000	20.12	(2,253,552)
2022091203306	BO	USDMXN	oct-22	50,000	19.94	(997,067)
2022091203270	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.05	1,002,315
2022052303092	B	USDMXN	oct-22	750,000	20.39	(15,295,351)
2022052303102	SO	USDMXN	oct-22	(750,000)	20.21	15,157,200
2022052303132	SO	USDMXN	oct-22	(750,000)	20.21	15,157,200
2021122003335	BO	USDMXN	oct-22	900,000	21.99	(19,794,623)
2021122003439	SO	USDMXN	oct-22	(900,000)	22.04	19,836,000
2022101803462	S	USDMXN	oct-22	(224,000)	20.08	4,497,967
2022101803443	BO	USDMXN	oct-22	124,000	20.01	(2,480,992)
2022101803444	BO	USDMXN	oct-22	100,000	20.01	(2,000,800)
2022100403180	B	USDMXN	oct-22	60,000	20.06	(1,203,337)
2022100403150	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.11	1,206,300
2022092203572	BO	USDMXN	oct-22	210,000	20.05	(4,210,310)
2022092203641	BO	USDMXN	oct-22	40,000	20.05	(802,025)
2022092203552	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	20.06	5,014,750

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022091203090	BO	USDMXN	oct-22	400,000	19.94	(7,976,999)
2022091203530	BO	USDMXN	oct-22	250,000	20.01	(5,001,504)
2022091203116	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	19.97	1,996,950
2022091203117	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	19.97	1,996,950
2022091203118	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	19.97	1,996,950
2022091203119	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	19.97	1,996,950
2022091203443	SON	USDMXN	oct-22	(250,000)	19.99	4,997,500
2022091203616	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	19.99	4,997,500
2022081503334	BO	USDMXN	oct-22	50,000	20.13	(1,006,563)
2022081503107	SO	USDMXN	oct-22	(50,000)	20.25	1,012,300
2022052403370	B	USDMXN	oct-22	100,000	20.45	(2,044,878)
2022052403089	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.46	2,045,980
2022102003538	SO	USDMXN	oct-22	(5,659,000)	20.06	113,544,038
2022102003526	BO	USDMXN	oct-22	5,658,913	20.07	(113,547,227)
2022102003556	BON	USDMXN	oct-22	5,658,913	20.07	(113,547,227)
2022101703268	B	USDMXN	oct-22	104,800	20.00	(2,096,467)
2022101703237	SO	USDMXN	oct-22	(52,400)	20.01	1,048,781
2022101703238	SO	USDMXN	oct-22	(52,400)	20.01	1,048,781
2022101203301	S	USDMXN	oct-22	(22,500)	20.05	451,085
2022101203265	BO	USDMXN	oct-22	22,500	20.38	(458,550)
2022101003444	BO	USDMXN	oct-22	44,616	20.01	(892,830)
2022101003374	SO	USDMXN	oct-22	(44,616)	20.03	893,435
2022100603430	BO	USDMXN	oct-22	56,800	20.18	(1,146,019)
2022100603472	BO	USDMXN	oct-22	242,000	20.66	(5,000,206)
2022100603484	BO	USDMXN	oct-22	63,376	20.17	(1,278,563)
2022100603486	BO	USDMXN	oct-22	242,000	20.17	(4,880,221)
2022100603330	SO	USDMXN	oct-22	(56,800)	20.18	1,145,940
2022100603394	SO	USDMXN	oct-22	(242,576)	20.17	4,892,278
2022100603422	SON	USDMXN	oct-22	(242,576)	20.17	4,892,278
2022100603438	SO	USDMXN	oct-22	(62,800)	20.19	1,267,806
2022100403182	B	USDMXN	oct-22	40,000	20.06	(802,387)
2022100403581	BO	USDMXN	oct-22	56,000	20.03	(1,121,930)
2022100403149	SO	USDMXN	oct-22	(40,000)	20.11	804,360
2022100403579	SO	USDMXN	oct-22	(56,000)	20.05	1,122,632
2022092903526	SO	USDMXN	oct-22	(154,367)	20.26	3,127,015
2022092903487	BO	USDMXN	oct-22	154,367	20.27	(3,128,864)
2022092903536	BON	USDMXN	oct-22	154,367	20.27	(3,128,864)
2022092603364	S	USDMXN	oct-22	(210,000)	20.52	4,309,533
2022092603311	BO	USDMXN	oct-22	1,000,000	20.24	(20,236,800)
2022092603337	BO	USDMXN	oct-22	1,000,000	20.24	(20,236,800)
2022092603310	SO	USDMXN	oct-22	(790,000)	20.24	15,987,072
2022092603334	SO	USDMXN	oct-22	(790,000)	20.24	15,987,072
2022092303566	BO	USDMXN	oct-22	59,600	20.32	(1,210,787)
2022092303524	SO	USDMXN	oct-22	(59,600)	20.35	1,212,860
2022092003505	BO	USDMXN	oct-22	44,640	20.11	(897,573)
2022092003358	SO	USDMXN	oct-22	(427)	20.11	8,591
2022092003519	SO	USDMXN	oct-22	(44,640)	20.16	899,942
2022091903393	BO	USDMXN	oct-22	140,000	20.10	(2,813,616)
2022091903392	SO	USDMXN	oct-22	(139,573)	20.10	2,805,344
2022091903436	SON	USDMXN	oct-22	(139,573)	20.10	2,805,344
2022091503618	BO	USDMXN	oct-22	85,200	20.21	(1,722,250)
2022091503429	SO	USDMXN	oct-22	(85,200)	20.19	1,720,273
2022091403403	BO	USDMXN	oct-22	46,000	20.07	(923,196)
2022091403502	BO	USDMXN	oct-22	1,200	20.10	(24,126)
2022091403499	SO	USDMXN	oct-22	(47,200)	20.08	947,729
2022091303329	BO	USDMXN	oct-22	169,200	20.19	(3,415,642)
2022091303295	SO	USDMXN	oct-22	(56,400)	20.20	1,139,489
2022091303296	SO	USDMXN	oct-22	(56,400)	20.20	1,139,489
2022091303297	SO	USDMXN	oct-22	(56,400)	20.20	1,139,489
2022090903530	B	USDMXN	oct-22	101,200	20.08	(2,031,916)
2022090903134	SO	USDMXN	oct-22	(50,600)	20.06	1,015,188
2022090903135	SO	USDMXN	oct-22	(50,600)	20.06	1,015,188



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022090803378	BO	USDMXN	oct-22	32,800	20.18	(661,875)
2022090803311	SO	USDMXN	oct-22	(32,800)	20.16	661,084
2022090603542	BO	USDMXN	oct-22	22,500	20.33	(457,357)
2022090603582	SO	USDMXN	oct-22	(22,500)	20.38	458,550
2022090203516	BO	USDMXN	oct-22	400,000	20.15	(8,061,276)
2022090203536	SO	USDMXN	oct-22	(400,000)	20.20	8,080,240
2022090103353	BO	USDMXN	oct-22	51,200	20.39	(1,043,883)
2022090103336	SO	USDMXN	oct-22	(51,200)	20.42	1,045,504
2022082603517	B	USDMXN	oct-22	32,400	20.22	(655,187)
2022082603448	SO	USDMXN	oct-22	(32,400)	20.18	653,978
2022082503547	SO	USDMXN	oct-22	(372,000)	20.15	7,497,278
2022082503549	SO	USDMXN	oct-22	(691)	20.15	13,926
2022082503548	BO	USDMXN	oct-22	372,691	20.15	(7,511,509)
2022082503579	BON	USDMXN	oct-22	372,691	20.15	(7,511,509)
2022081103307	BO	USDMXN	oct-22	1,000,000	20.24	(20,239,233)
2022081103468	B	USDMXN	oct-22	334,794	20.24	(6,775,067)
2022081103159	SO	USDMXN	oct-22	(1,000,000)	20.24	20,236,800
2022081103345	SO	USDMXN	oct-22	(334,795)	20.22	6,768,875
2022081103430	SON	USDMXN	oct-22	(334,795)	20.22	6,768,875
2022053003161	BO	USDMXN	oct-22	125,000	20.07	(2,508,837)
2022053003067	SO	USDMXN	oct-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003125	SO	USDMXN	oct-22	(10,000)	19.84	198,401
2022033003106	B	USDMXN	oct-22	1,100,000	20.63	(22,697,928)
2022033003136	SO	USDMXN	oct-22	(987,000)	20.48	20,212,872
2022033003184	SO	USDMXN	oct-22	(103,000)	20.48	2,109,347
2022033003224	SO	USDMXN	oct-22	(10,000)	20.48	204,791
2022010403047	SO	USDMXN	oct-22	(6)	21.71	130
2022010403269	SO	USDMXN	oct-22	(290,015)	21.72	6,299,919
2022010403253	BON	USDMXN	oct-22	290,015	21.72	(6,300,000)
2022010403283	BON	USDMXN	oct-22	290,015	21.72	(6,300,000)
2021122803235	SO	USDMXN	oct-22	(288,932)	21.81	6,300,531
2021122803208	BON	USDMXN	oct-22	288,938	21.80	(6,300,000)
2021122803214	BON	USDMXN	oct-22	288,938	21.80	(6,300,000)
2021122803232	BON	USDMXN	oct-22	288,938	21.80	(6,300,000)
2021122103326	SO	USDMXN	oct-22	(284,681)	22.12	6,295,746
2021122103282	BON	USDMXN	oct-22	284,681	22.13	(6,300,000)
2021122103285	BON	USDMXN	oct-22	284,681	22.13	(6,300,000)
2021121403182	S	USDMXN	oct-22	(280,000)	22.45	6,286,862
2021121403193	SO	USDMXN	oct-22	(874)	22.46	19,629
2021121403158	BON	USDMXN	oct-22	280,874	22.43	(6,300,000)
2021121403166	BON	USDMXN	oct-22	280,874	22.43	(6,300,000)
2021120703491	SO	USDMXN	oct-22	(282,955)	22.27	6,302,443
2021120703392	BON	USDMXN	oct-22	282,955	22.27	(6,300,000)
2021120703406	BON	USDMXN	oct-22	282,955	22.27	(6,300,000)
2021113003612	S	USDMXN	oct-22	(276,110)	22.72	6,274,170
2021113003411	BON	USDMXN	oct-22	276,110	22.82	(6,300,000)
2021113003415	BON	USDMXN	oct-22	276,110	22.82	(6,300,000)
2022102103449	S	USDMXN	oct-22	(14,832)	20.01	296,732
2022102003477	BO	USDMXN	oct-22	13,228	20.08	(265,561)
2022102003321	SO	USDMXN	oct-22	(13,228)	20.05	265,235
2022101803437	S	USDMXN	oct-22	(1,519,028)	20.07	30,481,040
2022101803446	S	USDMXN	oct-22	(13,154,413)	20.08	264,122,741
2022101803464	S	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.09	2,008,874
2022101803407	BO	USDMXN	oct-22	14,673,441	20.07	(294,537,048)
2022101803442	BO	USDMXN	oct-22	100,000	20.02	(2,001,500)
2022101803528	BON	USDMXN	oct-22	14,673,441	20.07	(294,537,048)
2022101803532	BON	USDMXN	oct-22	14,673,441	20.07	(294,537,048)
2022101103290	SO	USDMXN	oct-22	(3,000,000)	20.02	60,074,639
2022101103299	SO	USDMXN	oct-22	(14,500,000)	20.03	290,432,715
2022101103312	S	USDMXN	oct-22	(11,730,152)	20.04	235,030,740
2022101103287	BO	USDMXN	oct-22	14,730,152	20.02	(294,912,369)
2022101103301	BO	USDMXN	oct-22	14,500,000	20.03	(290,391,500)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022101103351	BON	USDMXN	oct-22	14,500,000	20.03	(290,391,500)
2022101103353	BON	USDMXN	oct-22	14,730,152	20.02	(294,912,369)
2022100403155	B	USDMXN	oct-22	82,000	20.07	(1,645,614)
2022100403432	S	USDMXN	oct-22	(7,902,121)	20.07	158,634,548
2022100403495	SO	USDMXN	oct-22	(73,133)	20.07	1,467,602
2022100403415	BO	USDMXN	oct-22	7,975,255	20.07	(160,088,879)
2022100403479	BON	USDMXN	oct-22	7,975,255	20.07	(160,088,879)
2022100403142	SO	USDMXN	oct-22	(82,000)	20.24	1,659,516
2022093003624	SO	USDMXN	oct-22	(200,000)	20.20	4,040,887
2022093003318	BO	USDMXN	oct-22	200,000	20.19	(4,038,000)
2022092203631	BO	USDMXN	oct-22	60,000	20.06	(1,203,510)
2022092203606	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.05	1,203,120
2022091203505	BO	USDMXN	oct-22	16,261	20.04	(325,841)
2022091203542	B	USDMXN	oct-22	60,000	20.02	(1,201,108)
2022091203158	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	19.94	1,196,136
2022091203573	SO	USDMXN	oct-22	(16,261)	20.00	325,275
2022090903533	B	USDMXN	oct-22	60,000	20.08	(1,205,011)
2022090903440	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.07	1,203,990
2022082503595	B	USDMXN	oct-22	60,000	20.16	(1,209,742)
2022082503604	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.16	1,209,690
2022081003687	BO	USDMXN	oct-22	60,000	20.27	(1,216,409)
2022081003554	SO	USDMXN	oct-22	(60,000)	20.28	1,216,620
2022071203150	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	21.23	2,123,305
2022071203076	BO	USDMXN	oct-22	100,000	21.15	(2,115,010)
2022040103384	BO	USDMXN	oct-22	100,000	20.62	(2,062,012)
2022040103353	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.70	2,070,000
2022032203504	B	USDMXN	oct-22	1,388,498	21.14	(29,358,652)
2022032203527	SO	USDMXN	oct-22	(1,388,498)	21.00	29,157,487
2022031503280	SO	USDMXN	oct-22	(118,649)	21.79	2,585,070
2022031503219	BON	USDMXN	oct-22	118,649	21.79	(2,585,000)
2022031503228	BON	USDMXN	oct-22	118,649	21.79	(2,585,000)
2022012503228	SO	USDMXN	oct-22	(225,000)	21.77	4,899,276
2022012503229	SO	USDMXN	oct-22	(80)	21.77	1,750
2022012503188	BON	USDMXN	oct-22	225,080	21.77	(4,900,000)
2022012503192	BON	USDMXN	oct-22	225,080	21.77	(4,900,000)
2022011103296	B	USDMXN	oct-22	5,000,000	21.55	(107,758,090)
2022011103323	B	USDMXN	oct-22	10,000,000	21.54	(215,419,000)
2022011103437	SO	USDMXN	oct-22	(227,484)	21.52	4,894,823
2022011103321	BON	USDMXN	oct-22	227,484	21.54	(4,900,000)
2022011103500	BON	USDMXN	oct-22	227,484	21.54	(4,900,000)
2022011103302	SON	USDMXN	oct-22	(15,000,000)	21.50	322,552,500
2022010403347	S	USDMXN	oct-22	(225,391)	21.72	4,895,223
2022010403312	BON	USDMXN	oct-22	225,391	21.74	(4,900,000)
2022010403316	BON	USDMXN	oct-22	225,391	21.74	(4,900,000)
2021122803343	SO	USDMXN	oct-22	(224,102)	21.85	4,897,414
2021122803309	BON	USDMXN	oct-22	224,102	21.87	(4,900,000)
2021122803338	BON	USDMXN	oct-22	224,102	21.87	(4,900,000)
2022102103403	BO	USDMXN	oct-22	150,000	19.93	(2,988,927)
2022102103418	SO	USDMXN	oct-22	(150,000)	19.98	2,997,450
2022101803466	S	USDMXN	oct-22	(223,000)	20.09	4,480,404
2022101803441	BO	USDMXN	oct-22	114,000	20.02	(2,282,166)
2022101803452	BO	USDMXN	oct-22	109,000	20.02	(2,182,071)
2022101003279	BO	USDMXN	oct-22	100,000	20.01	(2,000,845)
2022101003198	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.08	2,008,300
2022100503351	B	USDMXN	oct-22	800,000	20.15	(16,119,885)
2022100503340	SO	USDMXN	oct-22	(800,000)	20.20	16,158,080
2022092603352	B	USDMXN	oct-22	700,000	20.53	(14,370,299)
2022092603340	S	USDMXN	oct-22	(700,000)	20.50	14,351,400
2022092103141	BO	EURMXN	oct-22	400,000	19.93	(7,972,865)
2022092103148	SO	EURMXN	oct-22	(400,000)	19.94	7,974,400
2022092103152	SO	EURMXN	oct-22	(400,000)	19.94	7,974,400
2022082503500	B	USDMXN	oct-22	50,000,000	20.16	(1,008,152,500)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022072903491	B	USDMXN	oct-22	400,000	20.74	(8,295,651)
2022072903190	S	USDMXN	oct-22	(400,000)	20.71	8,285,200
2022072603268	B	USDMXN	oct-22	100,000,000	20.80	(2,079,800,000)
2022072603273	B	USDMXN	oct-22	100,000,000	20.80	(2,079,800,000)
2022072603275	S	USDMXN	oct-22	(120,000,000)	20.79	2,495,088,000
2022072603284	S	USDMXN	oct-22	(30,000,000)	20.79	623,655,000
2022072603286	S	USDMXN	oct-22	(50,000,000)	20.79	1,039,400,000
2022053003344	BO	USDMXN	oct-22	250,000	20.09	(5,023,080)
2022053003222	SO	USDMXN	oct-22	(250,000)	20.24	5,059,500
2022030703237	SO	USDMXN	oct-22	(75,000)	22.04	1,652,841
2022030703045	BO	USDMXN	oct-22	75,000	22.02	(1,651,433)
2022011703409	BO	USDMXN	oct-22	400,000	21.46	(8,582,279)
2022011703418	SO	USDMXN	oct-22	(400,000)	21.49	8,594,440
2022011703492	SO	USDMXN	oct-22	(400,000)	21.49	8,594,440
2021112503072	SO	USDMXN	oct-22	(65,000)	22.83	1,484,183
2021112503139	BO	USDMXN	oct-22	65,000	22.52	(1,463,904)
2021092103420	S	USDMXN	oct-22	(131,250)	21.35	2,801,779
2021092103592	BO	USDMXN	oct-22	131,250	21.35	(2,802,384)
2022101803468	S	USDMXN	oct-22	(224,000)	20.10	4,502,998
2022101803459	BO	USDMXN	oct-22	115,000	20.03	(2,303,450)
2022101803460	BO	USDMXN	oct-22	109,000	20.03	(2,183,270)
2022101403614	B	USDMXN	oct-22	1,000,000	20.12	(20,118,323)
2022101103285	BO	USDMXN	oct-22	30,000	20.01	(600,375)
2022101103182	SO	USDMXN	oct-22	(30,000)	20.09	602,685
2022100403586	S	USDMXN	oct-22	(587,500)	20.05	11,778,701
2022100303410	B	USDMXN	oct-22	587,500	20.12	(11,820,741)
2022100303105	S	USDMXN	oct-22	(50,000,000)	20.18	1,008,860,000
2022100303124	S	USDMXN	oct-22	(25,000,000)	20.18	504,430,000
2022100303130	S	USDMXN	oct-22	(50,000,000)	20.18	1,008,860,000
2022093003108	BO	USDMXN	oct-22	587,750	20.21	(11,880,716)
2022093003662	B	USDMXN	oct-22	587,750	20.22	(11,881,936)
2022093003620	S	USDMXN	oct-22	(1,000,000)	20.20	20,198,411
2022093003454	BO	USDMXN	oct-22	1,000,000	20.16	(20,157,000)
2022093003112	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.22	11,885,774
2022093003211	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.22	11,885,774
2022093003630	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.21	11,878,134
2022093003650	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.21	11,878,134
2022092903392	B	USDMXN	oct-22	587,750	20.25	(11,903,844)
2022092903223	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.28	11,920,158
2022092703086	BO	USDMXN	oct-22	87,750	20.50	(1,798,719)
2022092703100	B	USDMXN	oct-22	500,000	20.48	(10,240,208)
2022092703104	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.51	12,054,753
2022092703134	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.51	12,054,753
2022092303389	B	USDMXN	oct-22	587,750	20.33	(11,947,034)
2022092303350	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.31	11,938,378
2022092203571	BO	USDMXN	oct-22	587,750	20.09	(11,807,873)
2022092203578	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.10	11,812,423
2022092103289	B	USDMXN	oct-22	587,750	20.13	(11,829,018)
2022092103306	BO	USDMXN	oct-22	587,750	20.13	(11,828,810)
2022092103118	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.13	11,828,763
2022092103334	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.13	11,833,347
2022092003348	BO	USDMXN	oct-22	587,741	20.14	(11,834,321)
2022092003273	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.14	11,839,460
2022091903217	BO	USDMXN	oct-22	587,759	20.17	(11,853,668)
2022091903145	SON	USDMXN	oct-22	(587,750)	20.17	11,857,269
2022081703414	B	USDMXN	oct-22	20,000	20.27	(405,466)
2022081703408	SO	USDMXN	oct-22	(20,000)	20.34	406,712
2022050303511	BO	USDMXN	oct-22	1,022,142	21.00	(21,464,837)
2022050303519	SO	USDMXN	oct-22	(1,022,142)	21.12	21,591,728
2022033003769	B	USDMXN	oct-22	100,000	20.70	(2,070,300)
2022033003467	SO	USDMXN	oct-22	(100,000)	20.72	2,072,210
2022030703489	SO	USDMXN	oct-22	(575,000)	22.28	12,808,376



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022030703529	BO	USDMXN	oct-22	575,000	22.26	(12,798,350)
2022010303078	B	USDMXN	oct-22	108,000	21.76	(2,350,478)
2021122903525	SO	USDMXN	oct-22	(108,000)	21.86	2,360,934
2021113003291	S	USDMXN	oct-22	(2,508,707)	22.02	55,241,720
2021113003298	S	USDMXN	oct-22	(2,508,707)	22.02	55,241,720
2021111903125	S	USDMXN	oct-22	(2,508,707)	22.02	55,241,720
2021113003378	S	USDMXN	oct-22	(2,508,707)	22.02	55,241,720
2021110503277	S	USDMXN	oct-22	(1,215,976)	21.62	26,289,455
2022102503249	BO	USDMXN	nov-22	20,000	19.88	(397,646)
2022102503275	SO	USDMXN	nov-22	(20,000)	19.96	399,122
2022102103320	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.02	(1,000,920)
2022102103266	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.09	1,004,700
2022101803470	S	USDMXN	nov-22	(122,000)	20.11	2,453,082
2022101803475	BO	USDMXN	nov-22	122,000	20.03	(2,444,087)
2022101403344	B	USDMXN	nov-22	589,500	20.12	(11,863,001)
2022101403186	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.12	11,860,386
2022101303250	BO	USDMXN	nov-22	589,500	20.08	(11,835,310)
2022101303300	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.12	11,862,155
2022101203225	BO	USDMXN	nov-22	589,000	20.12	(11,853,339)
2022101203232	BO	USDMXN	nov-22	500	20.09	(10,045)
2022101203094	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.14	11,869,936
2022100703252	BO	USDMXN	nov-22	339,000	20.11	(6,817,612)
2022100703258	B	USDMXN	nov-22	589,500	20.09	(11,843,577)
2022100703448	B	USDMXN	nov-22	250,000	20.08	(5,019,491)
2022100703453	BO	USDMXN	nov-22	500	20.08	(10,042)
2022100703230	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.12	11,862,450
2022100703231	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.12	11,862,803
2022100603433	B	USDMXN	nov-22	1,179,000	20.20	(23,810,114)
2022100603346	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.20	11,910,553
2022100603347	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.17	11,892,632
2022100603374	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.20	11,910,553
2022100603376	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.17	11,892,632
2022100503241	BO	USDMXN	nov-22	589,000	20.22	(11,909,062)
2022100503357	B	USDMXN	nov-22	590,000	20.17	(11,898,768)
2022100503243	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.23	11,924,996
2022100503345	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.20	11,909,963
2022100403336	BO	USDMXN	nov-22	589,500	20.06	(11,824,837)
2022100403587	B	USDMXN	nov-22	587,500	20.05	(11,781,473)
2022100403588	BO	USDMXN	nov-22	2,500	20.06	(50,143)
2022100403342	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.07	11,830,027
2022100303422	B	USDMXN	nov-22	589,000	20.15	(11,868,815)
2022100303237	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.10	11,851,013
2022100303398	SON	USDMXN	nov-22	(589,500)	20.14	11,873,886
2022092603548	S	USDMXN	nov-22	(250,000)	20.52	5,131,182
2022092603493	BO	USDMXN	nov-22	250,000	20.53	(5,132,500)
2022090203517	BO	USDMXN	nov-22	400,000	20.18	(8,070,538)
2022090203535	SO	USDMXN	nov-22	(400,000)	20.22	8,089,640
2021112403191	S	USDMXN	nov-22	(500,000)	22.74	11,372,196
2021110503479	B	USDMXN	nov-22	250,000	21.64	(5,410,351)
2021110503470	SO	USDMXN	nov-22	(250,000)	21.74	5,433,750
2021110303637	BO	USDMXN	nov-22	250,000	22.03	(5,506,419)
2021110303643	SO	USDMXN	nov-22	(250,000)	22.06	5,514,500
2022102803560	S	USDMXN	nov-22	(13,646)	19.81	270,341
2022102703057	BO	USDMXN	nov-22	68,040	19.90	(1,353,738)
2022102703053	SO	USDMXN	nov-22	(68,040)	19.91	1,354,949
2022102503248	BO	USDMXN	nov-22	40,000	19.89	(795,597)
2022102503336	BO	USDMXN	nov-22	11,320	19.89	(225,132)
2022102503588	BO	USDMXN	nov-22	57,600	19.89	(1,145,720)
2022102503688	B	USDMXN	nov-22	100,644	19.89	(2,002,262)
2022102503274	SO	USDMXN	nov-22	(40,000)	19.96	798,584
2022102503337	SO	USDMXN	nov-22	(11,320)	19.89	225,200
2022102503559	SO	USDMXN	nov-22	(57,600)	19.91	1,146,874

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022102503614	SO	USDMXN	nov-22	(50,872)	19.92	1,013,574
2022102503615	SO	USDMXN	nov-22	(49,772)	19.93	991,976
2022102603030	SO	USDMXN	nov-22	(49,772)	19.92	991,657
2022102403258	BO	USDMXN	nov-22	44,996	19.98	(899,013)
2022102403176	SO	USDMXN	nov-22	(44,996)	20.00	899,830
2022102103238	BO	USDMXN	nov-22	266,800	20.04	(5,346,665)
2022102103542	BO	USDMXN	nov-22	7,004	19.95	(139,706)
2022102103052	SO	USDMXN	nov-22	(88,800)	20.06	1,780,884
2022102103053	SO	USDMXN	nov-22	(88,800)	20.06	1,780,884
2022102103054	SO	USDMXN	nov-22	(89,200)	20.06	1,788,906
2022102103448	SO	USDMXN	nov-22	(7,004)	20.01	140,123
2022101703270	B	USDMXN	nov-22	81,723	20.03	(1,637,258)
2022101703308	BO	USDMXN	nov-22	46,100	20.05	(924,441)
2022101703233	SO	USDMXN	nov-22	(48,924)	20.05	980,760
2022101703236	SO	USDMXN	nov-22	(32,800)	20.04	657,463
2022101703323	SO	USDMXN	nov-22	(46,100)	20.07	925,365
2022101003445	BO	USDMXN	nov-22	152,000	20.04	(3,046,498)
2022101003371	SO	USDMXN	nov-22	(51,200)	20.06	1,026,862
2022101003372	SO	USDMXN	nov-22	(50,400)	20.06	1,010,817
2022101003373	SO	USDMXN	nov-22	(50,400)	20.06	1,010,817
2022100703451	BO	USDMXN	nov-22	135,450	20.09	(2,721,203)
2022100703310	SO	USDMXN	nov-22	(135,450)	20.12	2,725,132
2022100403582	BO	USDMXN	nov-22	17,200	20.06	(345,083)
2022100403578	SO	USDMXN	nov-22	(17,200)	20.08	345,316
2022092803462	BO	USDMXN	nov-22	22,300	20.27	(452,104)
2022092803491	SO	USDMXN	nov-22	(22,300)	20.33	453,337
2022092203633	BO	USDMXN	nov-22	60,000	20.09	(1,205,101)
2022092203605	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.08	1,204,674
2022091503554	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.25	(1,012,344)
2022091503619	BO	USDMXN	nov-22	800	20.24	(16,195)
2022091503558	SO	USDMXN	nov-22	(50,800)	20.26	1,029,106
2022091403589	BO	USDMXN	nov-22	112,800	20.14	(2,271,486)
2022091403591	SO	USDMXN	nov-22	(56,400)	20.16	1,136,844
2022091403592	SO	USDMXN	nov-22	(56,400)	20.16	1,136,844
2022091203506	BO	USDMXN	nov-22	8,131	20.06	(163,127)
2022091203544	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.04	(1,202,669)
2022091203157	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	19.96	1,197,660
2022091203572	SO	USDMXN	nov-22	(8,131)	20.00	162,643
2022090903538	B	USDMXN	nov-22	75,200	20.11	(1,512,355)
2022090903319	SO	USDMXN	nov-22	(15,200)	20.09	305,391
2022090903439	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.09	1,205,580
2022090803455	BO	USDMXN	nov-22	43,100	20.21	(871,056)
2022090803459	BO	USDMXN	nov-22	14,901	20.15	(300,233)
2022090803447	SO	USDMXN	nov-22	(58,000)	20.16	1,169,048
2022082503593	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.19	(1,211,429)
2022082503603	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.19	1,211,370
2022081503243	B	USDMXN	nov-22	35,000,000	20.12	(704,290,895)
2022081503248	S	USDMXN	nov-22	(35,000,000)	20.13	704,375,000
2022081003222	BO	USDMXN	nov-22	5,450,000	20.27	(110,472,688)
2022081003688	BO	USDMXN	nov-22	60,000	20.30	(1,218,093)
2022081003689	BO	USDMXN	nov-22	4,954	20.33	(100,717)
2022081003220	SO	USDMXN	nov-22	(5,454,954)	20.27	110,585,555
2022081003227	SO	USDMXN	nov-22	(5,454,954)	20.27	110,585,555
2022081003553	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.31	1,218,300
2022072903389	B	USDMXN	nov-22	50,000,000	20.72	(1,036,000,000)
2022072903414	S	USDMXN	nov-22	(50,000,000)	20.73	1,036,450,000
2022071403321	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	21.33	2,133,275
2022071403169	BO	USDMXN	nov-22	100,000	21.26	(2,126,400)
2022053003162	BO	USDMXN	nov-22	125,000	20.10	(2,512,941)
2022053003066	SO	USDMXN	nov-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003124	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	19.84	198,401
2022033003108	B	USDMXN	nov-22	1,100,000	20.67	(22,733,924)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022033003135	SO	USDMXN	nov-22	(987,000)	20.48	20,212,872
2022033003183	SO	USDMXN	nov-22	(103,000)	20.48	2,109,347
2022033003223	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	20.48	204,791
2022032203508	B	USDMXN	nov-22	1,425,144	21.18	(30,187,286)
2022032203526	SO	USDMXN	nov-22	(1,425,144)	21.00	29,927,026
2021112403199	S	USDMXN	nov-22	(250,000)	22.74	5,685,090
2021110503481	B	USDMXN	nov-22	250,000	21.65	(5,412,380)
2021110503469	SO	USDMXN	nov-22	(250,000)	21.74	5,435,750
2021100403406	BO	USDMXN	nov-22	49,584	21.84	(1,082,719)
2021083003117	S	MXNUSD	nov-22	(29,381,712)	21.42	1,371,782
2021083003119	S	MXNUSD	nov-22	(90,553,609)	21.42	4,227,894
2021083003122	S	MXNUSD	nov-22	(47,459,331)	21.42	2,215,448
2021083003455	BO	USDMXN	nov-22	80,180	21.41	(1,716,698)
2021083003308	SO	USDMXN	nov-22	(7,895,304)	21.20	167,394,653
2021092903488	SO	USDMXN	nov-22	(7,944,888)	21.07	167,394,653
2022103103169	S	USDMXN	nov-22	(50,000)	19.85	992,250
2022102503250	BO	USDMXN	nov-22	20,000	19.89	(397,871)
2022102503273	SO	USDMXN	nov-22	(20,000)	19.97	399,364
2022102403486	BO	USDMXN	nov-22	32,000	19.97	(639,092)
2022102403445	SO	USDMXN	nov-22	(32,000)	20.17	645,280
2022102103589	BO	USDMXN	nov-22	100,000	19.98	(1,998,072)
2022102103623	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.04	2,004,000
2022101803474	S	USDMXN	nov-22	(217,000)	20.12	4,365,662
2022101803476	BO	USDMXN	nov-22	115,000	20.04	(2,305,118)
2022101803477	BO	USDMXN	nov-22	102,000	20.04	(2,044,539)
2022100403158	B	USDMXN	nov-22	50,000	20.10	(1,004,987)
2022100403146	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.13	1,006,700
2022093003090	B	USDMXN	nov-22	1,600,000	20.23	(32,372,388)
2022093003053	SO	USDMXN	nov-22	(1,600,000)	20.22	32,347,200
2022093003055	SO	USDMXN	nov-22	(1,600,000)	20.22	32,347,200
2022081003196	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.25	(1,012,569)
2022081003251	BO	USDMXN	nov-22	250,000	20.35	(5,086,883)
2022081003612	BO	USDMXN	nov-22	200,000	20.35	(4,069,919)
2022081003658	BO	USDMXN	nov-22	25,000	20.33	(508,324)
2022081003097	SO	USDMXN	nov-22	(250,000)	20.45	5,111,500
2022081003268	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.38	1,019,125
2022081003742	SO	USDMXN	nov-22	(200,000)	20.58	4,115,600
2022081003782	SO	USDMXN	nov-22	(25,000)	20.60	514,878
2022060203388	BO	USDMXN	nov-22	55,000	20.15	(1,108,452)
2022060203367	SO	USDMXN	nov-22	(55,000)	20.27	1,114,933
2022052603544	BO	USDMXN	nov-22	25,000	20.41	(510,248)
2022052603566	SO	USDMXN	nov-22	(25,000)	20.48	511,975
2021092103424	S	USDMXN	nov-22	(131,250)	21.37	2,804,762
2021092103591	BO	USDMXN	nov-22	131,250	21.38	(2,805,482)
2022082503371	BO	USDMXN	nov-22	2,000,000	20.22	(40,437,585)
2022082503261	SO	USDMXN	nov-22	(2,000,000)	20.22	40,445,600
2022082503263	SO	USDMXN	nov-22	(2,000,000)	20.22	40,445,600
2022081003275	BO	USDMXN	nov-22	1,500,000	20.32	(30,484,286)
2022081003279	SO	USDMXN	nov-22	(1,500,000)	20.33	30,499,500
2021113003526	B	USDMXN	nov-22	200,000	22.78	(4,555,826)
2021113003576	SO	USDMXN	nov-22	(200,000)	22.91	4,581,000
2022102503251	BO	USDMXN	nov-22	10,000	19.91	(199,080)
2022102503272	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	19.98	199,826
2022102403538	BO	USDMXN	nov-22	50,000	19.98	(999,098)
2022102403536	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.06	1,002,800
2022091203089	BO	USDMXN	nov-22	400,000	19.99	(7,997,441)
2022091203112	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.02	2,002,050
2022091203113	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.02	2,002,050
2022091203114	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.02	2,002,050
2022091203115	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.02	2,002,050
2022060203119	BO	USDMXN	nov-22	4,000,000	20.18	(80,712,135)
2022060203122	BO	USDMXN	nov-22	1,100,000	20.18	(22,195,287)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022060203118	SO	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	20.18	80,736,000
2022060203121	SO	USDMXN	nov-22	(1,100,000)	20.18	22,198,000
2022060203129	SO	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	20.18	80,736,000
2022060203132	SO	USDMXN	nov-22	(1,100,000)	20.18	22,198,000
2022060103510	BO	USDMXN	nov-22	4,000,000	20.35	(81,416,520)
2022060103514	BO	USDMXN	nov-22	4,000,000	20.36	(81,429,160)
2022060103511	SO	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	20.37	81,484,000
2022060103515	SO	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	20.37	81,484,000
2022060103519	SO	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	20.37	81,484,000
2022060103521	SO	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	20.37	81,484,000
2022110303222	SO	USDMXN	nov-22	(1,500,000)	19.78	29,667,150
2022110303273	S	USDMXN	nov-22	(225,000)	19.72	4,437,000
2022110303369	SO	USDMXN	nov-22	(115,000)	19.78	2,274,827
2022110303383	SO	USDMXN	nov-22	(11,000)	19.78	217,592
2022110103542	B	USDMXN	nov-22	48,276	19.74	(952,892)
2022110103536	SO	USDMXN	nov-22	(48,276)	19.75	953,625
2022102803726	BO	USDMXN	nov-22	345,188	19.84	(6,847,507)
2022102803584	SO	USDMXN	nov-22	(49,180)	19.85	976,346
2022102803585	SO	USDMXN	nov-22	(49,180)	19.85	976,346
2022102803586	SO	USDMXN	nov-22	(49,180)	19.85	976,346
2022102803587	SO	USDMXN	nov-22	(49,180)	19.85	976,346
2022102803588	SO	USDMXN	nov-22	(50,172)	19.85	996,040
2022102803589	SO	USDMXN	nov-22	(50,772)	19.85	1,007,951
2022102803715	SO	USDMXN	nov-22	(47,524)	19.85	943,328
2022102703058	BO	USDMXN	nov-22	128,040	19.92	(2,550,321)
2022102703050	SO	USDMXN	nov-22	(46,800)	19.94	933,052
2022102703051	SO	USDMXN	nov-22	(13,200)	19.94	263,168
2022102703052	SO	USDMXN	nov-22	(68,040)	19.94	1,356,513
2022102503252	BO	USDMXN	nov-22	30,000	19.91	(597,348)
2022102503589	BO	USDMXN	nov-22	81,200	19.91	(1,616,905)
2022102503271	SO	USDMXN	nov-22	(30,000)	19.99	599,586
2022102503558	SO	USDMXN	nov-22	(81,200)	19.93	1,618,641
2022102103597	BO	USDMXN	nov-22	201,600	19.99	(4,030,221)
2022102103549	SO	USDMXN	nov-22	(50,400)	19.98	1,007,158
2022102103550	SO	USDMXN	nov-22	(50,400)	19.98	1,007,158
2022102103551	SO	USDMXN	nov-22	(50,400)	19.98	1,007,158
2022102103552	SO	USDMXN	nov-22	(50,400)	19.98	1,007,158
2022102003490	BO	USDMXN	nov-22	50,800	20.13	(1,022,364)
2022102003267	SO	USDMXN	nov-22	(50,800)	20.11	1,021,334
2022101403034	BO	USDMXN	nov-22	89,200	20.09	(1,791,861)
2022101303486	SO	USDMXN	nov-22	(89,200)	20.07	1,790,030
2022100703452	BO	USDMXN	nov-22	33,500	20.11	(673,761)
2022100703401	SO	USDMXN	nov-22	(33,500)	20.18	675,997
2022100603429	BO	USDMXN	nov-22	47,600	20.23	(962,710)
2022100603474	BO	USDMXN	nov-22	15,200	20.23	(307,521)
2022100603337	SO	USDMXN	nov-22	(47,600)	20.24	963,272
2022100603437	SO	USDMXN	nov-22	(15,200)	20.24	307,648
2022100403583	BO	USDMXN	nov-22	64,000	20.09	(1,285,469)
2022100403574	SO	USDMXN	nov-22	(46,800)	20.10	940,600
2022100403577	SO	USDMXN	nov-22	(17,200)	20.10	345,691
2022093003663	BO	USDMXN	nov-22	83,600	20.25	(1,692,653)
2022093003628	SO	USDMXN	nov-22	(83,600)	20.25	1,692,566
2022092803464	BO	USDMXN	nov-22	22,300	20.30	(452,604)
2022092803490	SO	USDMXN	nov-22	(22,300)	20.35	453,850
2022092203409	BO	USDMXN	nov-22	32,000	20.12	(643,955)
2022092203393	SO	USDMXN	nov-22	(32,000)	20.14	644,416
2022092103274	BO	USDMXN	nov-22	56,400	20.16	(1,137,062)
2022092103223	SO	USDMXN	nov-22	(56,400)	20.19	1,138,462
2022091203303	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.00	(999,913)
2022091203269	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.10	1,005,200
2022090903540	B	USDMXN	nov-22	15,200	20.13	(306,042)
2022090903318	SO	USDMXN	nov-22	(15,200)	20.11	305,718

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022090203518	BO	USDMXN	nov-22	400,000	20.21	(8,082,986)
2022090203534	SO	USDMXN	nov-22	(400,000)	20.26	8,102,160
2022081103410	BO	USDMXN	nov-22	100,000	20.30	(2,030,305)
2022081103418	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.38	2,037,600
2022081003404	BO	USDMXN	nov-22	100,000	20.32	(2,031,798)
2022081003407	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.40	2,039,700
2022071203506	SO	USDMXN	nov-22	(300,000)	21.32	6,396,251
2022071203604	BO	USDMXN	nov-22	300,000	21.25	(6,374,400)
2022053003163	BO	USDMXN	nov-22	125,000	20.13	(2,516,049)
2022053003065	SO	USDMXN	nov-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003123	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	19.84	198,401
2022033003111	B	USDMXN	nov-22	1,100,000	20.69	(22,762,149)
2022033003134	SO	USDMXN	nov-22	(987,000)	20.48	20,212,872
2022033003182	SO	USDMXN	nov-22	(103,000)	20.48	2,109,347
2022033003222	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	20.48	204,791
2022010403268	SO	USDMXN	nov-22	(269,153)	21.78	5,862,876
2022010403299	SO	USDMXN	nov-22	(1,700)	21.80	37,074
2022010403255	BON	USDMXN	nov-22	270,853	21.78	(5,900,000)
2022010403285	BON	USDMXN	nov-22	270,853	21.78	(5,900,000)
2021122803234	SO	USDMXN	nov-22	(269,739)	21.87	5,898,055
2021122803212	BON	USDMXN	nov-22	269,739	21.87	(5,900,000)
2021122803217	BON	USDMXN	nov-22	269,739	21.87	(5,900,000)
2021122803227	BON	USDMXN	nov-22	269,739	21.87	(5,900,000)
2021122103327	SO	USDMXN	nov-22	(128,849)	22.18	2,857,521
2021122103417	SO	USDMXN	nov-22	(136,977)	22.20	3,040,389
2021122103287	BON	USDMXN	nov-22	265,826	22.20	(5,900,000)
2021122103289	BON	USDMXN	nov-22	265,826	22.20	(5,900,000)
2021121403188	S	USDMXN	nov-22	(260,000)	22.52	5,855,519
2021121403196	SO	USDMXN	nov-22	(2,281)	22.51	51,341
2021121403164	BON	USDMXN	nov-22	262,281	22.50	(5,900,000)
2021121403169	BON	USDMXN	nov-22	262,281	22.50	(5,900,000)
2021120703492	SO	USDMXN	nov-22	(264,337)	22.33	5,902,385
2021120703402	BON	USDMXN	nov-22	264,337	22.32	(5,900,000)
2021120703411	BON	USDMXN	nov-22	264,337	22.32	(5,900,000)
2021113003615	S	USDMXN	nov-22	(258,127)	22.78	5,879,357
2021113003430	BON	USDMXN	nov-22	258,127	22.86	(5,900,000)
2021113003510	BON	USDMXN	nov-22	258,127	22.86	(5,900,000)
2022110403693	S	USDMXN	nov-22	(10,000)	19.55	195,450
2022110303740	B	USDMXN	nov-22	100,000	19.65	(1,964,583)
2022110303658	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	21.29	2,128,600
2022110103479	B	USDMXN	nov-22	100,000	19.76	(1,975,517)
2022110103402	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.83	1,982,700
2022110103424	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.83	1,982,700
2022102703334	SO	USDMXN	nov-22	(75,000)	19.88	1,491,266
2022102703352	BO	USDMXN	nov-22	75,000	19.88	(1,490,625)
2022102503253	BO	USDMXN	nov-22	30,000	19.92	(597,457)
2022102503332	BO	USDMXN	nov-22	291,000	19.92	(5,795,450)
2022102503700	BO	USDMXN	nov-22	100,000	19.92	(1,992,192)
2022102503270	SO	USDMXN	nov-22	(30,000)	19.99	599,694
2022102503339	SO	USDMXN	nov-22	(291,000)	19.93	5,799,339
2022102503708	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.98	1,997,870
2022102103541	BO	USDMXN	nov-22	14,832	19.97	(296,239)
2022102103447	SO	USDMXN	nov-22	(14,832)	20.01	296,732
2022101903441	S	USDMXN	nov-22	(350,000)	20.21	7,071,925
2022101903408	BO	USDMXN	nov-22	350,000	20.11	(7,037,800)
2022101703310	BO	USDMXN	nov-22	46,100	20.08	(925,626)
2022101703322	SO	USDMXN	nov-22	(46,100)	20.07	925,365
2022101003287	B	USDMXN	nov-22	350,000	20.08	(7,026,726)
2022101003284	SO	USDMXN	nov-22	(350,000)	20.11	7,037,800
2022100303388	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.16	(1,209,379)
2022100303265	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.21	1,212,600
2022092203634	BO	USDMXN	nov-22	60,000	20.11	(1,206,668)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022092203604	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.10	1,206,234
2022091203507	BO	USDMXN	nov-22	16,261	20.09	(326,646)
2022091203548	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.07	(1,204,178)
2022091203156	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	19.99	1,199,184
2022091203571	SO	USDMXN	nov-22	(16,261)	20.00	325,275
2022090903544	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.14	(1,208,282)
2022090903438	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.12	1,207,092
2022082503591	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.22	(1,213,113)
2022082503602	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.22	1,213,050
2022081203738	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.16	(1,007,847)
2022081203610	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.25	1,012,450
2022081003197	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.28	(1,013,778)
2022081003254	B	USDMXN	nov-22	250,000	20.33	(5,083,399)
2022081003259	B	USDMXN	nov-22	100,000	20.33	(2,033,312)
2022081003614	BO	USDMXN	nov-22	200,000	20.37	(4,074,740)
2022081003659	BO	USDMXN	nov-22	25,000	20.36	(508,926)
2022081003098	SO	USDMXN	nov-22	(250,000)	20.47	5,117,500
2022081003128	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.38	2,038,020
2022081003267	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.38	1,019,125
2022081003741	SO	USDMXN	nov-22	(200,000)	20.58	4,115,600
2022081003781	SO	USDMXN	nov-22	(25,000)	20.60	514,878
2022071403322	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	21.36	2,135,984
2022071403168	BO	USDMXN	nov-22	100,000	21.29	(2,128,600)
2022052603549	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.44	(1,021,807)
2022052603565	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.50	1,025,200
2022052303094	B	USDMXN	nov-22	4,900,000	20.46	(100,274,507)
2022052303101	SO	USDMXN	nov-22	(4,900,000)	20.21	99,027,040
2022052303134	SO	USDMXN	nov-22	(4,900,000)	20.21	99,027,040
2022040403479	B	USDMXN	nov-22	1,488,492	20.62	(30,694,266)
2022040403496	SO	USDMXN	nov-22	(1,488,492)	20.64	30,717,265
2022032203510	B	USDMXN	nov-22	1,425,144	21.21	(30,232,135)
2022032203525	SO	USDMXN	nov-22	(1,425,144)	21.00	29,927,026
2022012503213	SO	USDMXN	nov-22	(242,000)	21.83	5,282,756
2022012503215	SO	USDMXN	nov-22	(852)	21.83	18,595
2022012503197	BON	USDMXN	nov-22	242,852	21.82	(5,300,000)
2022012503201	BON	USDMXN	nov-22	242,852	21.82	(5,300,000)
202201103438	SO	USDMXN	nov-22	(245,427)	21.58	5,295,340
202201103328	BON	USDMXN	nov-22	245,427	21.60	(5,300,000)
202201103351	BON	USDMXN	nov-22	245,427	21.60	(5,300,000)
2022010403349	S	USDMXN	nov-22	(243,119)	21.78	5,294,845
2022010403317	BON	USDMXN	nov-22	243,119	21.80	(5,300,000)
2022010403319	BON	USDMXN	nov-22	243,119	21.80	(5,300,000)
2021122803344	SO	USDMXN	nov-22	(241,733)	21.91	5,297,097
2021122803316	BON	USDMXN	nov-22	241,733	21.93	(5,300,000)
2021122803340	BON	USDMXN	nov-22	241,733	21.93	(5,300,000)
2021120103033	BO	USDMXN	nov-22	250,000	22.58	(5,644,177)
2021120103048	SO	USDMXN	nov-22	(250,000)	22.40	5,601,075
2021092103426	S	USDMXN	nov-22	(131,250)	21.39	2,807,413
2021092103590	BO	USDMXN	nov-22	131,250	21.40	(2,808,133)
2022110703269	S	USDMXN	nov-22	(300,000)	19.49	5,845,500
2022110703270	S	USDMXN	nov-22	(300,000)	19.49	5,845,500
2022110803329	B	USDMXN	nov-22	3,803,257	19.51	(74,184,436)
2022110803345	S	USDMXN	nov-22	(124,000)	19.51	2,419,482
2022110803386	S	USDMXN	nov-22	(224,000)	19.51	4,370,677
2022110803374	B	USDMXN	nov-22	117,000	19.44	(2,274,948)
2022110803375	B	USDMXN	nov-22	107,000	19.44	(2,080,508)
2022110803304	SO	USDMXN	nov-22	(3,803,258)	19.51	74,219,815
2022110803428	SON	USDMXN	nov-22	(3,803,258)	19.51	74,219,815
2022110703645	S	USDMXN	nov-22	(50,000)	19.46	972,853
2022110403598	BO	USDMXN	nov-22	60,000	19.56	(1,173,649)
2022110403403	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	19.69	984,525
2022110403412	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	19.73	197,330

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022102703054	BO	USDMXN	nov-22	120,000	19.92	(2,390,110)
2022102703570	S	USDMXN	nov-22	(4,747,811)	19.91	94,531,115
2022102703555	BO	USDMXN	nov-22	4,747,811	19.91	(94,505,187)
2022102703605	BON	USDMXN	nov-22	4,747,811	19.91	(94,505,187)
2022102703131	SO	USDMXN	nov-22	(120,000)	19.96	2,395,200
2022102603276	BO	USDMXN	nov-22	60,000	19.91	(1,194,536)
2022102603229	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	19.98	1,199,010
2022102503646	S	USDMXN	nov-22	(9,944,559)	19.95	198,402,842
2022102503695	S	USDMXN	nov-22	(55,441)	19.93	1,105,161
2022102503485	BO	USDMXN	nov-22	10,000,000	19.94	(199,362,000)
2022102503599	BON	USDMXN	nov-22	10,000,000	19.94	(199,362,000)
2022102403099	BO	USDMXN	nov-22	4,000,000	20.02	(80,068,676)
2022102403098	SON	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	20.02	80,070,400
2022102403132	SON	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	20.02	80,070,400
2022102103596	BO	USDMXN	nov-22	100,000	20.01	(2,001,018)
2022102103622	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.08	2,007,900
2022100603099	BO	USDCHF	nov-22	185,000	0.99	(182,564)
2022100603096	SO	USDCHF	nov-22	(185,000)	0.99	182,523
2022100403186	B	USDMXN	nov-22	1,000,000	20.13	(20,129,420)
2022100403418	BO	USDMXN	nov-22	1,900,000	20.14	(38,267,837)
2022100403437	BO	USDMXN	nov-22	12,595	20.14	(253,603)
2022100403060	SO	USDMXN	nov-22	(1,000,000)	20.13	20,127,500
2022100403417	SO	USDMXN	nov-22	(1,912,595)	20.14	38,526,931
2022100403481	SON	USDMXN	nov-22	(1,912,595)	20.14	38,526,931
2022092203643	SO	USDMXN	nov-22	(156,615)	20.11	3,150,247
2022092203519	BO	USDMXN	nov-22	156,615	20.11	(3,149,836)
2022092203591	BON	USDMXN	nov-22	156,615	20.11	(3,149,836)
2022092003345	B	USDMXN	nov-22	551,854	20.20	(11,148,655)
2022092003232	SO	USDMXN	nov-22	(551,854)	20.20	11,147,890
2022092003299	SON	USDMXN	nov-22	(551,854)	20.20	11,147,890
2022090903367	B	USDMXN	nov-22	338,174	20.13	(6,806,909)
2022090903546	B	USDMXN	nov-22	16,557	20.15	(333,694)
2022090903116	SO	USDMXN	nov-22	(354,680)	20.12	7,134,920
2022090903275	SON	USDMXN	nov-22	(354,680)	20.12	7,134,920
2022090203111	BO	USDMXN	nov-22	2,000,000	20.22	(40,448,074)
2022090203137	SO	USDMXN	nov-22	(2,000,000)	20.24	40,485,000
2022090103456	BO	USDMXN	nov-22	216,500	20.46	(4,430,025)
2022090103454	SO	USDMXN	nov-22	(216,551)	20.45	4,429,382
2022090103485	SON	USDMXN	nov-22	(216,551)	20.45	4,429,382
2022042803457	SO	USDMXN	nov-22	(105,560)	21.27	2,244,820
2022042803432	BO	USDMXN	nov-22	105,560	21.28	(2,246,528)
2022042803487	BON	USDMXN	nov-22	105,560	21.28	(2,246,528)
2022110803347	B	USDMXN	nov-22	123,000	19.53	(2,402,210)
2022110803361	S	USDMXN	nov-22	(123,000)	19.53	2,402,210
2022110803373	BO	USDMXN	nov-22	123,000	19.45	(2,391,981)
2022110703539	B	USDMXN	nov-22	10,000,000	19.46	(194,562,460)
2022110703570	B	USDMXN	nov-22	100,000	19.45	(1,945,274)
2022110703536	S	USDMXN	nov-22	(10,100,000)	19.46	196,505,600
2022110703545	S	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	19.46	77,824,000
2022110703552	S	USDMXN	nov-22	(1,100,000)	19.46	21,401,600
2022110703554	S	USDMXN	nov-22	(1,000,000)	19.46	19,456,000
2022110703556	S	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	19.46	77,824,000
2022102603277	BO	USDMXN	nov-22	40,000	19.91	(796,505)
2022102603228	SO	USDMXN	nov-22	(40,000)	19.99	799,480
2022092203053	B	USDMXN	nov-22	5,573,871	20.10	(112,032,929)
2022092203047	S	USDMXN	nov-22	(5,573,871)	20.11	112,069,922
2022092203070	S	USDMXN	nov-22	(5,573,871)	20.11	112,069,922
2022053003332	B	USDMXN	nov-22	3,000,000	20.19	(60,556,992)
2022053003197	SO	USDMXN	nov-22	(3,000,000)	19.86	59,580,600
2022032403622	B	USDMXN	nov-22	899,815	21.02	(18,910,764)
2022032403699	SO	USDMXN	nov-22	(899,815)	21.03	18,925,359
2022031503242	B	USDMXN	nov-22	284,700	21.88	(6,228,522)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022031503172	SO	USDMXN	nov-22	(284,700)	21.88	6,229,805
2022031503178	SON	USDMXN	nov-22	(284,700)	21.88	6,229,805
2022030703238	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	22.12	2,211,548
2022030703046	BO	USDMXN	nov-22	100,000	22.02	(2,201,910)
2022022303366	BO	USDMXN	nov-22	285,000	21.27	(6,062,764)
2022022303456	SO	USDMXN	nov-22	(301)	21.28	6,404
2022022303368	SO	USDMXN	nov-22	(284,699)	21.27	6,056,943
2022022303377	SON	USDMXN	nov-22	(284,699)	21.27	6,056,943
2022013103129	B	USDMXN	nov-22	669,083	21.84	(14,610,072)
2022013103173	SO	USDMXN	nov-22	(669,083)	21.90	14,651,914
2021112503073	SO	USDMXN	nov-22	(90,000)	22.91	2,061,716
2021112503138	BO	USDMXN	nov-22	90,000	22.52	(2,026,944)
2022110703644	BO	USDMXN	nov-22	142,844	19.47	(2,780,730)
2022110703608	SO	USDMXN	nov-22	(48,276)	19.48	940,368
2022110703609	SO	USDMXN	nov-22	(47,284)	19.48	921,045
2022110703610	SO	USDMXN	nov-22	(47,284)	19.48	921,045
2022110403599	BO	USDMXN	nov-22	56,800	19.57	(1,111,590)
2022110403662	BO	USDMXN	nov-22	141,652	19.55	(2,769,668)
2022110403411	SO	USDMXN	nov-22	(20,000)	19.74	394,800
2022110403447	SO	USDMXN	nov-22	(36,800)	19.59	720,728
2022110403659	SO	USDMXN	nov-22	(47,088)	19.56	921,183
2022110403660	SO	USDMXN	nov-22	(47,088)	19.56	921,183
2022110403661	SO	USDMXN	nov-22	(47,476)	19.56	928,773
2022110303451	B	USDMXN	nov-22	1,626,000	19.70	(32,033,250)
2022110303841	BO	USDMXN	nov-22	14,400	19.69	(283,608)
2022110303221	SO	USDMXN	nov-22	(1,500,000)	19.78	29,667,150
2022110303365	SO	USDMXN	nov-22	(115,000)	19.78	2,274,827
2022110303382	SO	USDMXN	nov-22	(11,000)	19.78	217,592
2022110303791	SO	USDMXN	nov-22	(14,400)	19.69	283,594
2022103103121	BO	USDMXN	nov-22	41,000	19.89	(815,639)
2022103103440	BO	USDMXN	nov-22	272	19.88	(5,407)
2022103103123	SO	USDMXN	nov-22	(41,272)	19.91	821,643
2022102803049	BO	USDMXN	nov-22	180,000	19.87	(3,577,136)
2022102803725	BO	USDMXN	nov-22	65,600	19.86	(1,302,943)
2022102803050	SO	USDMXN	nov-22	(90,000)	19.89	1,790,190
2022102803051	SO	USDMXN	nov-22	(90,000)	19.89	1,790,190
2022102803582	SO	USDMXN	nov-22	(31,200)	19.88	620,225
2022102803583	SO	USDMXN	nov-22	(34,400)	19.88	683,838
2022102703059	BO	USDMXN	nov-22	63,600	19.94	(1,268,400)
2022102703049	SO	USDMXN	nov-22	(63,600)	19.96	1,269,615
2022102603541	B	USDMXN	nov-22	68,040	20.02	(1,361,827)
2022102603539	SO	USDMXN	nov-22	(68,040)	20.03	1,362,603
2022102003492	BO	USDMXN	nov-22	72,400	20.16	(1,459,346)
2022102003265	SO	USDMXN	nov-22	(20,800)	20.13	418,704
2022102003266	SO	USDMXN	nov-22	(51,600)	20.13	1,038,708
2022101303598	BO	USDMXN	nov-22	30,350	20.10	(609,894)
2022101303605	SO	USDMXN	nov-22	(30,350)	20.17	612,008
2022100603475	BO	USDMXN	nov-22	15,200	20.26	(307,966)
2022100603436	SO	USDMXN	nov-22	(15,200)	20.27	308,043
2022100503454	BO	USDMXN	nov-22	15,200	20.18	(306,747)
2022100503441	SO	USDMXN	nov-22	(15,200)	20.20	306,973
2022092203405	B	USDMXN	nov-22	500,000	20.14	(10,068,563)
2022092203293	SO	USDMXN	nov-22	(500,000)	21.23	10,613,500
2022091903422	BO	USDMXN	nov-22	52,000	20.14	(1,047,446)
2022091903410	SO	USDMXN	nov-22	(52,000)	20.18	1,049,100
2022091503620	BO	USDMXN	nov-22	112,800	20.29	(2,288,960)
2022091503372	SO	USDMXN	nov-22	(56,400)	20.27	1,143,087
2022091503373	SO	USDMXN	nov-22	(56,400)	20.27	1,143,087
2022090903468	B	USDMXN	nov-22	2,000,000	20.15	(40,290,294)
2022090903548	B	USDMXN	nov-22	46,000	20.16	(927,391)
2022090903136	SO	USDMXN	nov-22	(46,000)	20.14	926,578
2022090903375	SO	USDMXN	nov-22	(2,000,000)	20.15	40,307,400



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022090203203	BO	USDMXN	nov-22	1,000,000	20.21	(20,213,651)
2022090203519	BO	USDMXN	nov-22	400,000	20.24	(8,094,122)
2022090203211	SO	USDMXN	nov-22	(1,000,000)	20.23	20,225,500
2022090203533	SO	USDMXN	nov-22	(400,000)	20.28	8,113,040
2022082203002	BON	USDMXN	nov-22	1	20.49	(20)
2022082203004	BON	USDMXN	nov-22	1	20.49	(20)
2022081003707	B	USDMXN	nov-22	83,000	20.37	(1,690,494)
2022081003462	SO	USDMXN	nov-22	(83,000)	20.37	1,691,042
2022070603264	SO	USDMXN	nov-22	(500,000)	21.25	10,626,468
2022070603261	BO	USDMXN	nov-22	500,000	21.23	(10,613,500)
2022053003164	BO	USDMXN	nov-22	125,000	20.16	(2,519,674)
2022053003064	SO	USDMXN	nov-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003122	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	19.84	198,401
2022033003113	B	USDMXN	nov-22	1,100,000	20.72	(22,792,631)
2022033003133	SO	USDMXN	nov-22	(987,000)	20.48	20,212,872
2022033003181	SO	USDMXN	nov-22	(103,000)	20.48	2,109,347
2022033003221	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	20.48	204,791
2022110803251	B	USDMXN	nov-22	100,000	19.50	(1,949,945)
2022110803349	S	USDMXN	nov-22	(223,000)	19.54	4,356,893
2022110803391	S	USDMXN	nov-22	(233,000)	19.54	4,552,269
2022110803371	BO	USDMXN	nov-22	119,000	19.45	(2,315,026)
2022110803372	BO	USDMXN	nov-22	114,000	19.45	(2,217,756)
2022110803146	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	21.31	2,130,800
2022110403559	B	USDMXN	nov-22	10,000	19.59	(195,925)
2022110403410	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	19.74	197,435
2022102703149	BO	USDMXN	nov-22	30,000	19.90	(596,980)
2022102703253	SO	USDMXN	nov-22	(30,000)	19.96	598,920
2022102503697	B	USDMXN	nov-22	15,128	19.95	(301,779)
2022102503500	SO	USDMXN	nov-22	(15,128)	19.96	301,908
2022100503349	B	USDMXN	nov-22	1,000,000	20.22	(20,223,702)
2022100503339	SO	USDMXN	nov-22	(1,000,000)	20.27	20,272,000
2022100303393	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.18	(1,210,952)
2022100303264	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.24	1,214,160
2022092203635	BO	USDMXN	nov-22	60,000	20.14	(1,208,206)
2022092203603	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.13	1,207,794
2022091203550	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.09	(1,205,667)
2022091203155	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.01	1,200,702
2022090903551	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.16	(1,209,879)
2022090903437	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.15	1,208,730
2022082503589	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.25	(1,214,786)
2022082503601	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.25	1,214,718
2022071403323	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	21.39	2,138,693
2022071403167	BO	USDMXN	nov-22	100,000	21.31	(2,130,800)
2022032203514	B	USDMXN	nov-22	1,425,144	21.24	(30,275,887)
2022032203524	SO	USDMXN	nov-22	(1,425,144)	21.00	29,927,026
2022111403436	S	USDMXN	nov-22	(426,225)	19.36	8,253,416
2022111103414	B	USDMXN	nov-22	51,585	19.52	(1,006,924)
2022111103240	BO	EURUSD	nov-22	50,000	1.03	(51,585)
2022110803352	S	USDMXN	nov-22	(231,000)	19.54	4,514,265
2022110803369	BO	USDMXN	nov-22	117,000	19.46	(2,276,469)
2022110803370	BO	USDMXN	nov-22	114,000	19.46	(2,218,098)
2022110103481	B	USDMXN	nov-22	100,000	19.78	(1,978,413)
2022110103401	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.86	1,986,130
2022110103431	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.86	1,986,130
2022102803729	BO	USDMXN	nov-22	50,000	19.87	(993,461)
2022102803696	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	19.94	997,150
2022102703147	BO	USDMXN	nov-22	20,000	19.90	(398,021)
2022102703252	SO	USDMXN	nov-22	(20,000)	19.97	399,380
2022102503702	BO	USDMXN	nov-22	100,000	19.95	(1,995,174)
2022102503707	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.98	1,997,870
2022101803451	S	MXNUSD	nov-22	(381,000,000)	20.17	18,893,230
2022101803533	BO	USDMXN	nov-22	1,362	20.14	(27,439)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022101803472	S	USDMXN	nov-22	(18,894,592)	20.16	381,000,000
2022101003104	BO	USDMXN	nov-22	696,800	20.09	(14,000,529)
2022101003095	SON	USDMXN	nov-22	(696,800)	20.10	14,002,753
2022101003101	SON	USDMXN	nov-22	(696,800)	20.10	14,002,753
2022101003157	SON	USDMXN	nov-22	(696,800)	20.10	14,002,753
2022081003198	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.31	(1,015,342)
2022081003255	BO	USDMXN	nov-22	250,000	20.40	(5,100,795)
2022081003613	BO	USDMXN	nov-22	200,000	20.40	(4,080,978)
2022081003657	BO	USDMXN	nov-22	25,000	20.39	(509,706)
2022081003099	SO	USDMXN	nov-22	(250,000)	20.50	5,125,500
2022081003266	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.38	1,019,125
2022081003740	SO	USDMXN	nov-22	(200,000)	20.58	4,115,600
2022081003780	SO	USDMXN	nov-22	(25,000)	20.60	514,878
2022070603174	BO	EURUSD	nov-22	50,000	1.03	(51,351)
2022070603450	SO	USDMXN	nov-22	(234)	21.19	4,958
2022070603210	SO	EURUSD	nov-22	(50,000)	1.03	51,585
2022052603550	BO	USDMXN	nov-22	75,000	20.47	(1,535,193)
2022052603564	SO	USDMXN	nov-22	(75,000)	20.54	1,540,275
2022051803283	BO	USDMXN	nov-22	3,800,000	20.72	(78,747,218)
2022051803275	SO	USDMXN	nov-22	(3,800,000)	20.73	78,758,800
2022051803279	SO	USDMXN	nov-22	(3,800,000)	20.73	78,758,800
2022051703167	B	USDMXN	nov-22	1,931,962	20.71	(40,005,861)
2022051703151	SO	USDMXN	nov-22	(1,931,962)	20.73	40,046,672
2022040403482	B	USDMXN	nov-22	1,488,492	20.66	(30,745,305)
2022040403495	SO	USDMXN	nov-22	(1,488,492)	20.67	30,764,153
2021112603143	BO	USDMXN	nov-22	200,000	23.29	(4,658,025)
2021112603574	SO	USDMXN	nov-22	(200,000)	23.22	4,643,123
2021112603239	SO	USDMXN	nov-22	(200,000)	22.69	4,538,160
2021092103428	S	USDMXN	nov-22	(131,250)	21.42	2,811,092
2021092103589	BO	USDMXN	nov-22	131,250	21.42	(2,811,690)
2022111603353	S	USDMXN	nov-22	(400,000)	19.29	7,717,200
2022111503414	S	USDMXN	nov-22	(287,317)	19.42	5,579,698
2022111103541	B	USDMXN	nov-22	4,000,000	19.52	(78,062,476)
2022111103556	B	USDMXN	nov-22	4,000,000	19.51	(78,043,136)
2022111103576	B	USDMXN	nov-22	2,100,000	19.52	(40,987,968)
2022111103532	S	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	19.53	78,104,000
2022111103539	S	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	19.53	78,104,000
2022111103550	S	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	19.53	78,104,000
2022111103554	S	USDMXN	nov-22	(4,000,000)	19.53	78,104,000
2022111103561	S	USDMXN	nov-22	(1,100,000)	19.53	21,478,600
2022111103565	S	USDMXN	nov-22	(1,100,000)	19.53	21,478,600
2022111103567	S	USDMXN	nov-22	(1,000,000)	19.53	19,526,000
2022111103571	S	USDMXN	nov-22	(1,000,000)	19.53	19,526,000
2022110803322	BO	USDMXN	nov-22	20,000	19.52	(390,315)
2022110803354	S	USDMXN	nov-22	(233,000)	19.56	4,556,377
2022110803367	BO	USDMXN	nov-22	118,000	19.47	(2,297,342)
2022110803368	BO	USDMXN	nov-22	115,000	19.47	(2,238,935)
2022110803298	SO	USDMXN	nov-22	(20,000)	19.59	391,760
2022110703067	BO	USDMXN	nov-22	120,000	19.53	(2,343,881)
2022110703087	SO	USDMXN	nov-22	(120,000)	19.58	2,349,840
2022110103619	B	USDMXN	nov-22	30,000	19.80	(594,034)
2022110103599	SO	USDMXN	nov-22	(30,000)	19.91	597,165
2022102803727	BO	USDMXN	nov-22	50,000	19.88	(994,190)
2022102803695	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	19.95	997,400
2022102603501	BO	USDMXN	nov-22	25,000	20.04	(501,064)
2022102603428	SO	USDMXN	nov-22	(25,000)	20.06	501,613
2022102503333	BO	USDMXN	nov-22	198,000	19.96	(3,951,944)
2022102503345	SO	USDMXN	nov-22	(198,000)	19.97	3,954,654
2022102503366	SO	USDMXN	nov-22	(198,000)	19.97	3,954,654
2022102403487	BO	USDMXN	nov-22	85,000	20.04	(1,703,438)
2022102403444	SO	USDMXN	nov-22	(85,000)	20.23	1,719,805
2022091203307	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.05	(1,002,276)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022091203268	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.15	1,007,360
2022052603445	B	USDMXN	nov-22	1,000,000	20.48	(20,478,931)
2022052603269	SO	USDMXN	nov-22	(1,000,000)	22.53	22,527,000
2021122003337	BO	USDMXN	nov-22	1,050,000	22.12	(23,223,875)
2021122003438	SO	USDMXN	nov-22	(1,050,000)	22.18	23,284,800
2021122003585	SO	USDMXN	nov-22	(1,050,000)	22.18	23,284,800
2021113003549	B	USDMXN	nov-22	200,000	22.88	(4,576,683)
2021113003579	SO	USDMXN	nov-22	(200,000)	22.97	4,594,000
2021112303153	SO	USDMXN	nov-22	(1,000,000)	22.64	22,644,083
2021112303165	BO	USDMXN	nov-22	1,000,000	22.53	(22,527,000)
2020111803127	S	MXNUSD	nov-22	(200,000,000)	22.13	9,037,589
2020111803153	S	USDMXN	nov-22	(9,033,832)	22.14	200,000,000
2020111803377	SO	USDMXN	nov-22	(3,757)	22.09	82,975
2022111603065	BO	USDMXN	nov-22	5,000,000	19.34	(96,680,000)
2022111603068	S	USDMXN	nov-22	(5,000,000)	19.33	96,663,965
2022111503074	BO	USDMXN	nov-22	104,048	19.37	(2,015,471)
2022111503051	SO	USDMXN	nov-22	(52,424)	19.40	1,016,921
2022111503052	SO	USDMXN	nov-22	(51,624)	19.40	1,001,402
2022111403512	B	USDMXN	nov-22	10,000,000	19.53	(195,310,000)
2022111403510	S	USDMXN	nov-22	(10,000,000)	19.37	193,728,880
2022111103497	B	USDMXN	nov-22	290,804	19.53	(5,678,163)
2022111103485	SO	USDMXN	nov-22	(49,048)	19.54	958,447
2022111103486	SO	USDMXN	nov-22	(48,904)	19.54	955,633
2022111103487	SO	USDMXN	nov-22	(48,904)	19.54	955,633
2022111103488	SO	USDMXN	nov-22	(48,332)	19.54	944,456
2022111103489	SO	USDMXN	nov-22	(48,332)	19.54	944,456
2022111103490	SO	USDMXN	nov-22	(47,284)	19.54	923,977
2022110903496	BO	USDMXN	nov-22	45,444	19.61	(891,202)
2022110903489	SO	USDMXN	nov-22	(45,444)	19.62	891,648
2022110703438	BO	USDMXN	nov-22	440,800	19.50	(8,595,889)
2022110703424	SO	USDMXN	nov-22	(90,400)	19.51	1,764,111
2022110703425	SO	USDMXN	nov-22	(90,400)	19.51	1,764,111
2022110703426	SO	USDMXN	nov-22	(90,400)	19.51	1,764,111
2022110703427	SO	USDMXN	nov-22	(84,800)	19.51	1,654,830
2022110703428	SO	USDMXN	nov-22	(84,800)	19.51	1,654,830
2022110303454	B	USDMXN	nov-22	1,626,000	19.72	(32,070,336)
2022110303220	SO	USDMXN	nov-22	(1,500,000)	19.78	29,667,150
2022110303364	SO	USDMXN	nov-22	(115,000)	19.78	2,274,827
2022110303381	SO	USDMXN	nov-22	(11,000)	19.78	217,592
2022110103621	B	USDMXN	nov-22	30,000	19.80	(594,146)
2022110103598	SO	USDMXN	nov-22	(30,000)	19.91	597,285
2022102703060	BO	USDMXN	nov-22	97,620	19.97	(1,949,401)
2022102703047	SO	USDMXN	nov-22	(63,600)	19.99	1,271,269
2022102703048	SO	USDMXN	nov-22	(34,020)	19.99	680,009
2022102603262	B	USDMXN	nov-22	400,000	19.96	(7,983,630)
2022102603543	B	USDMXN	nov-22	34,020	20.04	(681,849)
2022102603159	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.99	1,999,000
2022102603160	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.99	1,999,000
2022102603161	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.99	1,999,000
2022102603162	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.99	1,999,000
2022102603538	SO	USDMXN	nov-22	(34,020)	20.05	682,237
2022102503590	BO	USDMXN	nov-22	56,000	19.96	(1,118,011)
2022102503557	SO	USDMXN	nov-22	(56,000)	19.99	1,119,160
2022102403061	B	USDMXN	nov-22	320,000	20.07	(6,421,276)
2022102403316	BO	USDMXN	nov-22	56,000	20.05	(1,122,820)
2022102403314	SO	USDMXN	nov-22	(56,000)	20.06	1,123,472
2022102103328	B	USDMXN	nov-22	350,000	20.06	(7,019,559)
2022102103417	B	USDMXN	nov-22	400,000	20.04	(8,014,065)
2022102103293	SO	USDMXN	nov-22	(350,000)	20.18	7,062,650
2022102103372	SO	USDMXN	nov-22	(400,000)	20.10	8,039,600
2022102103835	SO	USDMXN	nov-22	(80,000)	20.06	1,604,480
2022102103836	SO	USDMXN	nov-22	(80,000)	20.06	1,604,480

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022102103837	SO	USDMXN	nov-22	(80,000)	20.06	1,604,480
2022102103838	SO	USDMXN	nov-22	(80,000)	20.06	1,604,480
2022102003494	BO	USDMXN	nov-22	90,400	20.19	(1,824,730)
2022102003587	BO	USDMXN	nov-22	35,450	20.17	(715,087)
2022102003263	SO	USDMXN	nov-22	(10,800)	20.16	217,683
2022102003264	SO	USDMXN	nov-22	(79,600)	20.16	1,604,402
2022102003589	SO	USDMXN	nov-22	(35,450)	20.23	717,083
2022101903537	BO	USDMXN	nov-22	35,250	20.24	(713,592)
2022101903541	BO	USDMXN	nov-22	21,900	20.25	(443,463)
2022101903553	SO	USDMXN	nov-22	(21,900)	20.30	444,461
2022101903554	SO	USDMXN	nov-22	(35,250)	20.30	715,399
2022101703272	B	USDMXN	nov-22	47,200	20.11	(949,168)
2022101703235	SO	USDMXN	nov-22	(47,200)	20.12	949,820
2022100403225	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.16	(1,209,469)
2022100403219	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.16	1,209,480
2022100303397	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.21	(1,212,799)
2022100303263	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.26	1,215,480
2022092203398	SO	USDCAD	nov-22	(160,000,000)	1.35	215,870,400
2022092203426	SO	CADMXN	nov-22	(64,537)	14.94	963,981
2022092203411	BO	USDMXN	nov-22	32,000	20.17	(645,596)
2022092203421	B	USDMXN	nov-22	75,000,000	20.18	(1,513,725,000)
2022092203425	B	USDMXN	nov-22	75,000,000	20.18	(1,513,725,000)
2022092203636	BO	USDMXN	nov-22	60,000	20.16	(1,209,524)
2022092203314	SO	CADMXN	nov-22	(215,805,863)	14.97	3,230,808,000
2022092203449	SO	CADMXN	nov-22	(215,805,863)	14.97	3,230,808,000
2022092203392	SO	USDMXN	nov-22	(32,000)	20.19	646,080
2022092203602	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.15	1,209,114
2022091503621	BO	USDMXN	nov-22	36,400	20.32	(739,603)
2022091503371	SO	USDMXN	nov-22	(36,400)	20.29	738,683
2022091203552	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.12	(1,206,985)
2022091203154	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.03	1,201,998
2022090903553	B	USDMXN	nov-22	60,000	20.19	(1,211,214)
2022090903436	SO	USDMXN	nov-22	(60,000)	20.17	1,210,080
2022082503401	BO	USDMXN	nov-22	20,000	20.27	(405,482)
2022082503198	SO	USDMXN	nov-22	(20,000)	20.31	406,252
2022072803558	BO	USDMXN	nov-22	350,000	20.74	(7,260,197)
2022072803585	SO	USDMXN	nov-22	(350,000)	20.78	7,274,050
2022070503262	SO	USDMXN	nov-22	(199,052)	21.10	4,200,585
2022070503248	BON	USDMXN	nov-22	199,052	21.10	(4,200,000)
2022070503269	BON	USDMXN	nov-22	199,052	21.10	(4,200,000)
2022062803573	B	USDMXN	nov-22	56,037	20.72	(1,160,958)
2022062803488	SO	USDMXN	nov-22	(534,854)	20.65	11,043,425
2022062803619	SO	USDMXN	nov-22	(56,037)	20.66	1,157,568
2022062303449	B	USDMXN	nov-22	534,854	20.60	(11,017,930)
2022062303465	SO	USDMXN	nov-22	(534,854)	20.63	11,034,733
2022062203442	B	USDMXN	nov-22	42,453	20.63	(875,904)
2022062203416	SO	USDMXN	nov-22	(42,453)	20.68	877,962
2022051303530	B	USDMXN	nov-22	172,332	20.90	(3,602,095)
2022051303559	SO	USDMXN	nov-22	(81,843)	20.82	1,704,020
2022051303560	SO	USDMXN	nov-22	(61,369)	20.82	1,277,739
2022051303561	SO	USDMXN	nov-22	(29,120)	20.82	606,296
2022040703254	BO	USDMXN	nov-22	122,751	21.04	(2,583,101)
2022040703185	SO	USDMXN	nov-22	(122,751)	20.84	2,557,885
2022040603426	B	USDMXN	nov-22	60,571	21.05	(1,275,189)
2022040603452	SO	USDMXN	nov-22	(60,571)	20.88	1,264,898
2022040103576	B	USDMXN	nov-22	1,275,315	20.75	(26,468,892)
2022040103737	SO	USDMXN	nov-22	(162,103)	20.59	3,338,349
2022040103738	SO	USDMXN	nov-22	(217,994)	20.59	4,489,368
2022040103739	SO	USDMXN	nov-22	(870,276)	20.59	17,922,464
2022040103740	SO	USDMXN	nov-22	(24,942)	20.59	513,656
2022033103364	B	USDMXN	nov-22	204,866	20.78	(4,257,266)
2022033103278	SO	USDMXN	nov-22	(75,350)	20.60	1,552,308

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022033103298	SO	USDMXN	nov-22	(129,516)	20.60	2,668,198
2022033003116	B	USDMXN	nov-22	1,100,000	20.75	(22,828,647)
2022033003132	SO	USDMXN	nov-22	(987,000)	20.48	20,212,872
2022033003180	SO	USDMXN	nov-22	(103,000)	20.48	2,109,347
2022033003220	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	20.48	204,791
2022032203516	B	USDMXN	nov-22	1,425,144	21.27	(30,311,245)
2022032203523	SO	USDMXN	nov-22	(1,425,144)	21.00	29,927,026
2022031503281	SO	USDMXN	nov-22	(121,582)	21.90	2,663,235
2022031503248	BON	USDMXN	nov-22	121,582	21.90	(2,663,000)
2022031503251	BON	USDMXN	nov-22	121,582	21.90	(2,663,000)
2022022503521	B	USDMXN	nov-22	299,798	21.46	(6,432,841)
2022022503541	SO	USDMXN	nov-22	(88,075)	21.07	1,856,093
2022022503542	SO	USDMXN	nov-22	(211,723)	21.07	4,461,851
2022022303617	B	USDMXN	nov-22	3,222,894	21.31	(68,678,015)
2022022303655	SO	USDMXN	nov-22	(628,182)	21.00	13,191,382
2022022303669	SO	USDMXN	nov-22	(635,446)	21.00	13,343,921
2022022303693	SO	USDMXN	nov-22	(1,959,266)	21.00	41,143,215
2022021703612	B	USDMXN	nov-22	67,366	21.38	(1,440,363)
2022021703169	SO	USDMXN	nov-22	(67,367)	21.05	1,417,806
2022020803485	B	USDMXN	nov-22	50,475	21.74	(1,097,083)
2022020803505	SO	USDMXN	nov-22	(50,475)	21.30	1,075,269
2022020403028	B	USDMXN	nov-22	200,222	21.78	(4,360,958)
2022020403080	SO	USDMXN	nov-22	(62,411)	21.39	1,334,659
2022020403081	SO	USDMXN	nov-22	(127,929)	21.39	2,735,762
2022020403082	SO	USDMXN	nov-22	(9,882)	21.39	211,327
2022020203206	B	USDMXN	nov-22	90,780	21.74	(1,973,312)
2022020203458	B	USDMXN	nov-22	118,435	21.71	(2,570,803)
2022020203230	SO	USDMXN	nov-22	(25,625)	21.31	546,171
2022020203231	SO	USDMXN	nov-22	(65,155)	21.31	1,388,714
2022020203477	SO	USDMXN	nov-22	(51,625)	21.28	1,098,404
2022020203478	SO	USDMXN	nov-22	(66,810)	21.28	1,421,490
2022013103472	B	USDMXN	nov-22	71,407	21.79	(1,555,678)
2022013103602	B	USDMXN	nov-22	27,001	21.80	(588,662)
2022013103504	SO	USDMXN	nov-22	(71,407)	21.34	1,523,518
2022013103616	SO	USDMXN	nov-22	(27,001)	21.32	575,723
2022012803194	B	USDMXN	nov-22	949,625	22.07	(20,962,020)
2022012803492	B	USDMXN	nov-22	288,513	22.08	(6,369,366)
2022012803547	B	USDMXN	nov-22	228,927	22.08	(5,054,826)
2022012803253	SO	USDMXN	nov-22	(594,129)	21.62	12,843,881
2022012803254	SO	USDMXN	nov-22	(100,824)	21.62	2,179,613
2022012803255	SO	USDMXN	nov-22	(48,521)	21.62	1,048,927
2022012803256	SO	USDMXN	nov-22	(206,151)	21.62	4,456,572
2022012803598	SO	USDMXN	nov-22	(228,927)	21.62	4,948,257
2022012803663	SO	USDMXN	nov-22	(228,927)	21.61	4,945,968
2022012803677	SO	USDMXN	nov-22	(50,195)	21.62	1,085,090
2022012803678	SO	USDMXN	nov-22	(92,585)	21.62	2,001,456
2022012803679	SO	USDMXN	nov-22	(56,711)	21.62	1,225,950
2022012803680	SO	USDMXN	nov-22	(89,022)	21.62	1,924,433
2022012703311	B	USDMXN	nov-22	741,202	21.97	(16,283,754)
2022012703549	SO	USDMXN	nov-22	(83,087)	21.51	1,786,886
2022012703550	SO	USDMXN	nov-22	(160,529)	21.51	3,452,369
2022012703551	SO	USDMXN	nov-22	(74,739)	21.51	1,607,352
2022012703552	SO	USDMXN	nov-22	(57,539)	21.51	1,237,445
2022012703553	SO	USDMXN	nov-22	(70,609)	21.51	1,518,531
2022012703554	SO	USDMXN	nov-22	(229,118)	21.51	4,927,458
2022012703555	SO	USDMXN	nov-22	(65,580)	21.51	1,410,377
2022012503214	SO	USDMXN	nov-22	(242,219)	21.88	5,300,883
2022012503206	BON	USDMXN	nov-22	242,219	21.88	(5,300,000)
2022012503263	BON	USDMXN	nov-22	242,219	21.88	(5,300,000)
2022011103439	SO	USDMXN	nov-22	(244,838)	21.63	5,296,053
2022011103332	BON	USDMXN	nov-22	244,838	21.65	(5,300,000)
2022011103354	BON	USDMXN	nov-22	244,838	21.65	(5,300,000)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022010403264	SO	USDMXN	nov-22	(270,085)	21.85	5,900,885
2022010403353	S	USDMXN	nov-22	(242,585)	21.83	5,296,549
2022010403258	BON	USDMXN	nov-22	270,085	21.85	(5,900,000)
2022010403287	BON	USDMXN	nov-22	270,085	21.85	(5,900,000)
2022010403321	BON	USDMXN	nov-22	242,585	21.85	(5,300,000)
2022010403323	BON	USDMXN	nov-22	242,585	21.85	(5,300,000)
2021122803237	SO	USDMXN	nov-22	(269,001)	21.93	5,897,981
2021122803345	SO	USDMXN	nov-22	(241,084)	21.97	5,296,241
2021122803228	BON	USDMXN	nov-22	269,001	21.93	(5,900,000)
2021122803332	BON	USDMXN	nov-22	241,084	21.98	(5,300,000)
2021122803342	BON	USDMXN	nov-22	241,084	21.98	(5,300,000)
2021122803390	BON	USDMXN	nov-22	269,001	21.93	(5,900,000)
2021122803462	BON	USDMXN	nov-22	241,084	21.98	(5,300,000)
2021122103414	SO	USDMXN	nov-22	(265,000)	22.25	5,895,514
2021122103418	SO	USDMXN	nov-22	(228)	22.26	5,077
2021122103298	BON	USDMXN	nov-22	265,228	22.25	(5,900,000)
2021122103316	BON	USDMXN	nov-22	265,228	22.25	(5,900,000)
2021121403190	S	USDMXN	nov-22	(260,000)	22.58	5,870,413
2021121403197	SO	USDMXN	nov-22	(1,536)	22.57	34,671
2021121403172	BON	USDMXN	nov-22	261,536	22.56	(5,900,000)
2021121403174	BON	USDMXN	nov-22	261,536	22.56	(5,900,000)
2021120703493	SO	USDMXN	nov-22	(263,628)	22.38	5,900,532
2021120703414	BON	USDMXN	nov-22	263,628	22.38	(5,900,000)
2021120703425	BON	USDMXN	nov-22	263,628	22.38	(5,900,000)
2021113003617	S	USDMXN	nov-22	(257,698)	22.84	5,885,275
2021113003439	BON	USDMXN	nov-22	257,698	22.90	(5,900,000)
2021113003442	BON	USDMXN	nov-22	257,698	22.90	(5,900,000)
2022111803063	S	USDMXN	nov-22	(3,410,000)	19.51	66,525,690
2022111603259	BO	USDMXN	nov-22	33,000	19.34	(638,308)
2022111603323	BO	USDMXN	nov-22	33,000	19.32	(637,661)
2022111603577	B	USDMXN	nov-22	650,000	19.34	(12,573,634)
2022111603440	SO	USDMXN	nov-22	(33,000)	19.35	638,469
2022111603216	SO	USDMXN	nov-22	(33,000)	19.44	641,408
2022111603226	SO	USDMXN	nov-22	(33,000)	19.44	641,408
2022111603578	SO	USDMXN	nov-22	(650,000)	19.36	12,583,285
2022111403346	BO	USDMXN	nov-22	35,000	19.36	(677,774)
2022111403527	B	USDMXN	nov-22	100,000	19.38	(1,937,832)
2022111403374	SO	USDMXN	nov-22	(35,000)	19.62	686,665
2022111403467	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	21.34	2,133,500
2022111103165	BO	USDMXN	nov-22	1,200,000	19.56	(23,476,721)
2022111103169	BO	USDMXN	nov-22	81,952	19.56	(1,603,384)
2022111103212	B	USDMXN	nov-22	100,000	19.56	(1,955,915)
2022111103173	SO	USDMXN	nov-22	(1,281,952)	19.57	25,088,954
2022111103204	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.35	1,934,800
2022111003573	BO	USDMXN	nov-22	500,000	19.43	(9,715,289)
2022111003701	SO	USDMXN	nov-22	(1,021)	19.39	19,805
2022111003571	SO	USDMXN	nov-22	(498,979)	19.44	9,699,145
2022111003730	SON	USDMXN	nov-22	(498,979)	19.44	9,699,145
2022112403338	SON	USDMXN	nov-22	(498,979)	19.44	9,699,145
2022110803356	S	USDMXN	nov-22	(516,000)	19.57	10,095,724
2022110803362	BO	USDMXN	nov-22	119,000	19.48	(2,318,001)
2022110803363	BO	USDMXN	nov-22	120,000	19.48	(2,337,480)
2022110803364	BO	USDMXN	nov-22	119,000	19.47	(2,316,811)
2022110803365	BO	USDMXN	nov-22	120,000	19.48	(2,337,480)
2022110803366	BO	USDMXN	nov-22	38,000	19.48	(740,202)
2022110403652	BO	USDMXN	nov-22	44,756	19.60	(877,236)
2022110403685	SO	USDMXN	nov-22	(44,756)	19.68	880,820
2022110303061	BO	USDMXN	nov-22	150,000	19.72	(2,958,731)
2022110303735	BO	USDMXN	nov-22	14,563	19.70	(286,899)
2022110303070	SO	USDMXN	nov-22	(150,000)	19.75	2,962,500
2022110303294	SO	USDMXN	nov-22	(14,563)	19.75	287,561
2022110103483	B	USDMXN	nov-22	100,000	19.81	(1,980,630)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022110103500	BO	USDMXN	nov-22	50,000	19.79	(989,525)
2022110103309	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	19.88	993,800
2022110103400	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.90	1,989,780
2022110103428	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.90	1,989,780
2022102703335	SO	USDMXN	nov-22	(45,000)	19.94	897,195
2022102703576	SO	USDMXN	nov-22	(18,000)	19.94	359,004
2022102703354	BO	USDMXN	nov-22	45,000	19.93	(896,850)
2022102703577	BO	USDMXN	nov-22	18,000	19.93	(358,776)
2022102503595	B	USDMXN	nov-22	600,000	19.99	(11,993,624)
2022102503703	BO	USDMXN	nov-22	100,000	19.98	(1,997,838)
2022102503338	SO	USDMXN	nov-22	(600,000)	20.00	12,000,000
2022102503706	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	19.98	1,997,870
2022102103543	BO	USDMXN	nov-22	14,832	20.03	(297,103)
2022102103446	SO	USDMXN	nov-22	(14,832)	20.01	296,732
2022102003540	BO	USDMXN	nov-22	109,244	20.18	(2,204,358)
2022102003527	SO	USDMXN	nov-22	(109,244)	20.18	2,204,646
2022102003558	SON	USDMXN	nov-22	(109,244)	20.18	2,204,646
2022112403334	SON	USDMXN	nov-22	(109,244)	20.18	2,204,646
2022101403035	BO	USDMXN	nov-22	374	20.15	(7,543)
2022101303514	BO	USDMXN	nov-22	145,000	20.12	(2,917,836)
2022101303513	SO	USDMXN	nov-22	(145,374)	20.12	2,925,078
2022101303592	SON	USDMXN	nov-22	(145,374)	20.12	2,925,078
2022112403324	SON	USDMXN	nov-22	(145,374)	20.12	2,925,078
2022081003199	BO	USDMXN	nov-22	50,000	20.33	(1,016,669)
2022081003256	BO	USDMXN	nov-22	250,000	20.43	(5,107,389)
2022081003615	BO	USDMXN	nov-22	200,000	20.43	(4,086,268)
2022081003660	BO	USDMXN	nov-22	25,000	20.41	(510,367)
2022081003102	SO	USDMXN	nov-22	(250,000)	20.53	5,132,500
2022081003265	SO	USDMXN	nov-22	(50,000)	20.38	1,019,125
2022081003739	SO	USDMXN	nov-22	(200,000)	20.58	4,115,600
2022081003779	SO	USDMXN	nov-22	(25,000)	20.60	514,878
2022072903494	BO	USDMXN	nov-22	350,000	20.71	(7,247,259)
2022072903379	SO	USDMXN	nov-22	(350,000)	20.72	7,253,400
2022071403324	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	21.42	2,141,877
2022071403166	BO	USDMXN	nov-22	100,000	21.34	(2,133,500)
2022060603371	B	USDMXN	nov-22	500,000	20.26	(10,132,140)
2022060603340	SO	USDMXN	nov-22	(500,000)	23.00	11,500,000
2022052603551	BO	USDMXN	nov-22	75,000	20.50	(1,537,365)
2022052603563	SO	USDMXN	nov-22	(75,000)	20.57	1,542,450
2022051803310	BO	USDMXN	nov-22	1,060,000	20.73	(21,978,864)
2022051803304	SO	USDMXN	nov-22	(1,060,000)	20.73	21,974,860
2022051803312	SO	USDMXN	nov-22	(1,060,000)	20.73	21,974,860
2021121603432	B	USDMXN	nov-22	320,000	22.23	(7,115,103)
2021121603406	SO	USDMXN	nov-22	(320,000)	22.26	7,123,840
2021112603198	SO	USDMXN	nov-22	(500,000)	23.23	11,612,688
2021112603156	BO	USDMXN	nov-22	500,000	23.00	(11,500,000)
2021112603161	BO	USDMXN	nov-22	500,000	23.00	(11,500,000)
2021092103430	S	USDMXN	nov-22	(131,250)	21.44	2,814,269
2021092103588	BO	USDMXN	nov-22	131,250	21.45	(2,814,788)
2022111603418	S	USDMXN	nov-22	(2,687,821)	19.35	52,004,799
2022111603425	S	USDMXN	nov-22	(634,141)	19.36	12,273,831
2022111603465	S	USDMXN	nov-22	(11,123,188)	19.36	215,291,640
2022111603369	BO	USDMXN	nov-22	14,445,151	19.33	(279,256,539)
2022111603448	BON	USDMXN	nov-22	14,445,151	19.33	(279,256,539)
2022111603459	BON	USDMXN	nov-22	14,445,151	19.33	(279,256,539)
2022111103594	S	USDMXN	nov-22	(37,000)	19.55	723,332
2022111103587	BO	USDMXN	nov-22	37,000	19.44	(719,110)
2022110803315	S	USDMXN	nov-22	(4,889,235)	19.55	95,595,593
2022110803317	S	USDMXN	nov-22	(1,385,140)	19.55	27,082,592
2022110803330	S	USDMXN	nov-22	(3,803,257)	19.55	74,363,822
2022110803333	S	USDMXN	nov-22	(1,922,368)	19.55	37,580,134
2022110803309	BO	USDMXN	nov-22	12,000,000	19.55	(234,614,400)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022110803424	BON	USDMXN	nov-22	12,000,000	19.55	(234,614,400)
2022110803513	BON	USDMXN	nov-22	12,000,000	19.55	(234,614,400)
2022110103390	BO	USDMXN	nov-22	256,772	19.82	(5,090,447)
2022110103623	B	USDMXN	nov-22	40,000	19.82	(792,937)
2022110103388	SO	USDMXN	nov-22	(256,772)	19.83	5,090,720
2022110103504	SON	USDMXN	nov-22	(256,772)	19.83	5,090,720
2022110103597	SO	USDMXN	nov-22	(40,000)	19.93	797,100
2022102503612	BO	USDMXN	nov-22	350,000	20.01	(7,004,042)
2022102503673	S	USDMXN	nov-22	(727,200)	19.99	14,539,012
2022102503699	S	USDMXN	nov-22	(48,529)	19.99	969,898
2022102503480	BO	USDMXN	nov-22	775,729	19.99	(15,504,502)
2022102503593	BON	USDMXN	nov-22	775,729	19.99	(15,504,502)
2022102503602	BON	USDMXN	nov-22	775,729	19.99	(15,504,502)
2022102503362	SO	USDMXN	nov-22	(350,000)	20.05	7,016,100
2022101103369	B	USDMXN	nov-22	766,456	20.18	(15,465,266)
2022101103291	SO	USDMXN	nov-22	(766,456)	20.15	15,441,024
2022101103355	SON	USDMXN	nov-22	(766,456)	20.15	15,441,024
2022101103412	SON	USDMXN	nov-22	(766,456)	20.15	15,441,024
2022100303418	B	USDMXN	nov-22	1,000,000	20.24	(20,241,770)
2022100303284	SO	USDMXN	nov-22	(1,000,000)	20.28	20,282,000
2022083003498	BO	USDMXN	nov-22	3,363,791	20.50	(68,954,414)
2022083003472	SO	USDMXN	nov-22	(3,363,791)	20.50	68,960,398
2022083003522	SON	USDMXN	nov-22	(3,363,791)	20.50	68,960,398
2022082303431	B	USDMXN	nov-22	1,717,868	20.41	(35,067,231)
2022082303336	SO	USDMXN	nov-22	(1,717,868)	20.41	35,061,676
2022082303408	SON	USDMXN	nov-22	(1,717,868)	20.41	35,061,676
2022082303533	SON	USDMXN	nov-22	(1,717,868)	20.41	35,061,676
2022040103385	BO	USDMXN	nov-22	100,000	20.75	(2,074,969)
2022040103352	SO	USDMXN	nov-22	(100,000)	20.83	2,083,300
2021122303525	SO	USDMXN	nov-22	(130,000)	22.05	2,866,548
2021121403438	S	USDMXN	nov-22	(1,500,000)	22.61	33,916,071
2021113003665	BO	USDMXN	nov-22	1,500,000	22.86	(34,290,549)
2021113003671	SO	USDMXN	nov-22	(1,500,000)	22.90	34,342,500
2021112903297	BO	USDMXN	nov-22	130,000	23.16	(3,011,064)
2021112903301	SO	USDMXN	nov-22	(130,000)	23.18	3,013,530
2022111003531	SO	USDMXN	nov-22	(170,000)	19.45	3,306,718
2022111003532	BO	USDMXN	nov-22	117,000	19.38	(2,267,811)
2022111003533	BO	USDMXN	nov-22	53,000	19.38	(1,027,299)
2022110703446	B	USDMXN	nov-22	62,000	19.52	(1,210,370)
2022110703323	SO	USDMXN	nov-22	(62,000)	19.56	1,212,782
2022110403555	B	USDMXN	nov-22	10,000	19.63	(196,343)
2022110403409	SO	USDMXN	nov-22	(10,000)	19.79	197,870
2022102603502	BO	USDMXN	nov-22	30,000	20.07	(602,105)
2022102603427	SO	USDMXN	nov-22	(30,000)	20.09	602,760
2022092603549	BON	USDMXN	nov-22	200,000,000	20.65	(4,130,600,000)
2022092603523	SON	USDMXN	nov-22	(200,000,000)	20.65	4,130,600,000
2022092603537	SON	USDMXN	nov-22	(200,000,000)	20.66	4,131,300,000
2022082503498	BON	USDMXN	nov-22	100,000,000	20.28	(2,027,850,000)
2022082503503	BON	USDMXN	nov-22	100,000,000	20.28	(2,027,850,000)
2022082503511	SON	USDMXN	nov-22	(100,000,000)	20.29	2,029,180,000
2022082503512	SON	USDMXN	nov-22	(100,000,000)	20.29	2,029,180,000
2022081203743	BO	USDMXN	nov-22	170,000	20.26	(3,443,810)
2022081203663	SO	USDMXN	nov-22	(170,000)	20.29	3,448,535
2022111603555	BO	USDMXN	nov-22	11,400	19.36	(220,680)
2022111503251	B	USDMXN	nov-22	100,000	19.44	(1,943,505)
2022111503678	B	USDMXN	nov-22	32,804	19.41	(636,770)
2022111503681	BO	USDMXN	nov-22	16,980	19.41	(329,610)
2022111103627	BO	USDMXN	nov-22	32,400	19.55	(633,555)
2022111003439	B	USDMXN	nov-22	52,070	19.50	(1,015,369)
2022110903444	BO	USDMXN	nov-22	90,400	19.64	(1,775,779)
2022110903497	BO	USDMXN	nov-22	50,400	19.64	(989,672)
2022110403124	B	USDMXN	nov-22	2,000,000	19.55	(39,104,161)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022110403553	B	USDMXN	nov-22	10,000	19.64	(196,377)
2022110303458	B	USDMXN	nov-22	1,626,000	19.75	(32,112,814)
2022110303732	B	USDMXN	nov-22	30,000	19.71	(591,388)
2022110103188	B	USDMXN	nov-22	42,000,000	19.83	(832,869,656)
2022110103523	B	USDMXN	nov-22	44,280	19.81	(877,265)
2022102803189	BO	USDMXN	nov-22	589,500	19.93	(11,750,172)
2022102803760	BO	USDMXN	nov-22	45,200	19.91	(899,790)
2022102703061	BO	USDMXN	nov-22	158,760	20.00	(3,174,492)
2022102703528	BO	USDMXN	nov-22	589,500	19.94	(11,757,181)
2022102603268	B	USDMXN	nov-22	81,200	19.98	(1,622,211)
2022102603320	BO	USDMXN	nov-22	35,450	20.01	(709,512)
2022102503575	BO	USDMXN	nov-22	589,500	19.99	(11,785,211)
2022102503576	BO	USDMXN	nov-22	589,500	20.02	(11,801,878)
2022102403063	B	USDMXN	nov-22	400,000	20.10	(8,039,827)
2022102103239	BO	USDMXN	nov-22	36,000	20.15	(725,246)
2022102103420	B	USDMXN	nov-22	400,000	20.07	(8,026,047)
2022101803252	B	USDMXN	nov-22	589,500	20.19	(11,903,620)
2022101703261	B	USDMXN	nov-22	589,500	20.14	(11,871,727)
2022100403540	BO	USDMXN	nov-22	100,000	20.19	(2,018,801)
2022100403584	BO	USDMXN	nov-22	17,200	20.16	(346,818)
2022091303269	B	USDMXN	nov-22	25,000,000	20.34	(508,619,750)
2022082403330	B	USDMXN	nov-22	25,620	20.30	(520,207)
2022033003118	B	USDMXN	nov-22	1,100,000	20.78	(22,860,703)
2022030703240	SO	USDMXN	nov-22	(75,000)	22.18	1,663,514
2022030703497	SO	USDMXN	nov-22	(405,000)	22.41	9,075,082
2022010303080	B	USDMXN	nov-22	108,000	21.89	(2,364,065)
2021120103032	BO	USDMXN	nov-22	250,000	22.66	(5,665,429)
2021112503074	SO	USDMXN	nov-22	(65,000)	22.97	1,493,041
2022112303328	BO	USDMXN	dic-22	140,000	19.36	(2,710,062)
2022112303330	SO	USDMXN	dic-22	(140,000)	19.39	2,714,267
2022111603168	BO	USDMXN	dic-22	533,500	19.35	(10,323,860)
2022111603431	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.37	(1,936,971)
2022111603289	S	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.37	10,332,449
2022111603177	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.36	10,328,400
2022111603242	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	21.35	2,134,900
2022111503409	B	USDMXN	dic-22	1,067,000	19.43	(20,730,908)
2022111503419	S	USDMXN	dic-22	(20,000)	19.42	388,447
2022111503370	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.45	10,374,921
2022111503371	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.41	10,356,782
2022111403209	B	USDMXN	dic-22	533,500	19.43	(10,366,739)
2022111503154	B	USDMXN	dic-22	553,500	19.43	(10,755,370)
2022111403528	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.48	10,391,513
2022111103350	B	USDMXN	dic-22	1,067,000	19.58	(20,888,751)
2022111103596	S	USDMXN	dic-22	(121,000)	19.56	2,367,071
2022111103590	BO	USDMXN	dic-22	121,000	19.45	(2,352,942)
2022111103369	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.59	10,449,078
2022111103370	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.61	10,463,482
2022110903415	BO	USDMXN	dic-22	14,968	19.66	(294,307)
2022110903337	SO	USDMXN	dic-22	(14,968)	19.63	293,807
2022110403476	B	USDMXN	dic-22	1,067,000	19.66	(20,977,455)
2022110403654	BO	USDMXN	dic-22	44,756	19.62	(878,193)
2022110403305	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.57	10,438,408
2022110403306	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.56	10,435,633
2022110403684	SO	USDMXN	dic-22	(44,756)	19.68	880,820
2022110303153	BO	USDMXN	dic-22	533,500	19.76	(10,540,428)
2022110303176	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.76	10,543,987
2022110103038	BO	USDMXN	dic-22	100,000	19.83	(1,982,652)
2022110103043	BO	USDMXN	dic-22	100,000	19.80	(1,980,113)
2022110103151	BO	USDMXN	dic-22	500,000	19.84	(9,919,749)
2022110103252	B	USDMXN	dic-22	533,500	19.85	(10,587,646)
2022110103502	BO	USDMXN	dic-22	50,000	19.82	(991,144)
2022110103522	B	USDMXN	dic-22	533,500	19.82	(10,572,243)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022110103069	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.84	1,983,500
2022110103070	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.81	1,981,000
2022110103153	SO	USDMXN	dic-22	(500,000)	19.85	9,924,750
2022110103170	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.84	10,582,079
2022110103310	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.90	995,000
2022110103501	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.84	10,584,267
2022102103544	BO	USDMXN	dic-22	14,008	20.06	(280,940)
2022102103445	SO	USDMXN	dic-22	(14,008)	20.01	280,247
2022100403227	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.19	(1,211,272)
2022100403218	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.19	1,211,280
2022100303401	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.24	(1,214,550)
2022100303262	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.29	1,217,220
2022092203637	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.19	(1,211,310)
2022092203601	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.18	1,210,914
2022091203566	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.12	(1,207,440)
2022091203153	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.06	1,203,726
2022090903342	B	USDMXN	dic-22	1,876,458	20.20	(37,898,419)
2022090903638	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.18	(1,210,698)
2022090903180	SO	USDMXN	dic-22	(1,876,458)	20.19	37,891,316
2022090903197	SO	USDMXN	dic-22	(1,876,458)	20.19	37,891,316
2022090903611	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.20	1,211,940
2022081203742	BO	USDMXN	dic-22	114,000	20.27	(2,310,283)
2022081203662	SO	USDMXN	dic-22	(114,000)	20.29	2,313,459
2022071403325	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	21.44	2,144,276
2022071403165	BO	USDMXN	dic-22	100,000	21.35	(2,134,900)
2022032903082	B	USDMXN	dic-22	1,196,663	20.94	(25,056,060)
2022032903080	SO	USDMXN	dic-22	(1,196,663)	21.00	25,128,007
2021120203418	BO	USDMXN	dic-22	333,333	22.72	(7,572,889)
2021120203424	SO	USDMXN	dic-22	(333,333)	22.76	7,587,667
2022112203300	B	USDMXN	dic-22	15,000,000	19.50	(292,447,500)
2022112203271	S	USDMXN	dic-22	(15,000,000)	19.46	291,931,080
2022111103598	S	USDMXN	dic-22	(234,000)	19.57	4,579,456
2022111103588	BO	USDMXN	dic-22	117,000	19.45	(2,275,568)
2022111103589	BO	USDMXN	dic-22	117,000	19.45	(2,275,568)
2022110703002	BO	USDMXN	dic-22	200,000	19.55	(3,909,706)
2022110703015	SO	USDMXN	dic-22	(200,000)	19.59	3,917,600
2022110703022	SO	USDMXN	dic-22	(200,000)	19.59	3,917,600
2022110403262	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.62	(1,962,154)
2022110403551	B	USDMXN	dic-22	40,000	19.64	(785,779)
2022110403407	SO	USDMXN	dic-22	(40,000)	19.80	791,920
2022110403416	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.73	1,973,300
2022110303730	B	USDMXN	dic-22	70,000	19.72	(1,380,419)
2022110303181	SO	USDMXN	dic-22	(3,525)	19.86	70,000
2022110303647	SO	USDMXN	dic-22	(70,000)	19.86	1,390,249
2022100403162	B	USDMXN	dic-22	250,000	20.20	(5,050,493)
2022100403108	SO	USDMXN	dic-22	(250,000)	20.27	5,067,250
2022092703008	BON	USDMXN	dic-22	200,000,000	20.54	(4,108,400,000)
2022092703010	SON	USDMXN	dic-22	(200,000,000)	20.56	4,111,000,000
2022083103074	BON	USDMXN	dic-22	100,000,000	20.16	(2,016,000,000)
2022083103075	BON	USDMXN	dic-22	100,000,000	20.51	(2,051,050,000)
2022083103078	BON	USDMXN	dic-22	100,000,000	20.51	(2,051,050,000)
2022083103093	SON	USDMXN	dic-22	(100,000,000)	20.52	2,051,500,000
2022083103094	SON	USDMXN	dic-22	(100,000,000)	20.52	2,051,500,000
2022081003200	BO	USDMXN	dic-22	50,000	20.36	(1,017,996)
2022081003616	BO	USDMXN	dic-22	200,000	20.46	(4,091,557)
2022081003661	BO	USDMXN	dic-22	25,000	20.44	(511,028)
2022081003264	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	20.38	1,019,125
2022081003738	SO	USDMXN	dic-22	(200,000)	20.58	4,115,600
2022081003778	SO	USDMXN	dic-22	(25,000)	20.60	514,878
2022080403414	BO	USDMXN	dic-22	1,280,000	20.81	(26,642,447)
2022080403348	SO	USDMXN	dic-22	(1,280,000)	20.81	26,638,080
2022080403370	SO	USDMXN	dic-22	(1,280,000)	20.81	26,638,080

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022062103393	BO	USDMXN	dic-22	100,000	20.87	(2,086,832)
2022062103392	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.92	2,091,940
2022040403484	B	USDMXN	dic-22	1,623,523	20.71	(33,627,270)
2022040403494	SO	USDMXN	dic-22	(1,623,523)	20.72	33,645,079
2021092103432	S	USDMXN	dic-22	(105,000)	21.47	2,253,962
2021092103587	BO	USDMXN	dic-22	105,000	21.47	(2,254,298)
2022111603424	SO	USDMXN	dic-22	(93,000)	19.38	1,802,075
2022111603422	BO	USDMXN	dic-22	93,000	19.31	(1,795,365)
2022110403549	B	USDMXN	dic-22	50,000	19.66	(982,777)
2022110403406	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.70	984,850
2022103103119	B	USDMXN	dic-22	100,000,000	19.94	(1,994,400,000)
2022090903560	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.23	(1,213,770)
2022090903639	S	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.19	1,211,484
2022090903435	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.20	1,211,940
2022082503267	BO	USDMXN	dic-22	2,000,000	20.33	(40,668,184)
2022082503264	SO	USDMXN	dic-22	(2,000,000)	20.34	40,678,000
2022082503266	SO	USDMXN	dic-22	(2,000,000)	20.34	40,678,000
2022081003276	BO	USDMXN	dic-22	1,500,000	20.43	(30,645,251)
2022081003278	SO	USDMXN	dic-22	(1,500,000)	20.44	30,660,750
2022060203389	BO	USDMXN	dic-22	55,000	20.28	(1,115,458)
2022060203366	SO	USDMXN	dic-22	(55,000)	20.43	1,123,375
2021100403405	BO	USDMXN	dic-22	51,473	21.96	(1,130,331)
2021083003110	S	MXNUSD	dic-22	(22,047,139)	21.54	1,023,770
2021083003112	S	MXNUSD	dic-22	(90,553,609)	21.53	4,205,265
2021083003115	S	MXNUSD	dic-22	(61,171,897)	21.53	2,840,877
2021083003460	BO	USDMXN	dic-22	126,216	21.52	(2,716,076)
2021083003307	SO	USDMXN	dic-22	(8,196,127)	21.20	173,772,646
2021092903491	SO	USDMXN	dic-22	(8,247,601)	21.07	173,772,646
2022111703636	S	USDMXN	dic-22	(232,000)	19.48	4,519,976
2022111703590	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.40	(2,250,516)
2022111703591	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.40	(2,250,516)
2022110803323	BO	USDMXN	dic-22	30,000	19.57	(586,950)
2022110803297	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	19.64	589,125
2022110703449	B	USDMXN	dic-22	60,000	19.55	(1,172,751)
2022110703322	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	19.59	1,175,250
2022110403542	B	USDMXN	dic-22	50,000	19.66	(983,054)
2022110403405	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.70	985,025
2022102603503	BO	USDMXN	dic-22	30,000	20.10	(602,920)
2022102603426	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	20.12	603,570
2022101803244	B	USDMXN	dic-22	1,000,000	20.22	(20,216,617)
2022101703569	BO	USDMXN	dic-22	1,100,000	20.20	(22,216,619)
2022101703572	SO	USDMXN	dic-22	(2,100,000)	20.22	42,451,500
2022101403618	S	USDMXN	dic-22	(2,100,000)	20.25	42,522,024
2022101403536	BO	USDMXN	dic-22	2,100,000	20.26	(42,548,100)
2022101403538	BO	USDMXN	dic-22	2,100,000	20.26	(42,548,100)
2022100703248	B	USDMXN	dic-22	2,100,000	20.22	(42,462,508)
2022100703018	SO	USDMXN	dic-22	(2,100,000)	20.28	42,585,900
2022100703020	SO	USDMXN	dic-22	(2,100,000)	20.28	42,585,900
2022091203308	BO	USDMXN	dic-22	50,000	20.10	(1,004,868)
2022091203267	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	20.20	1,010,010
2022062103395	BO	USDMXN	dic-22	100,000	20.89	(2,088,555)
2022062103391	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.94	2,093,670
2022112303214	BO	USDMXN	dic-22	380,000	19.42	(7,379,436)
2022112303336	BO	USDMXN	dic-22	2,136	19.41	(41,452)
2022112303650	BO	USDMXN	dic-22	45,764	19.40	(887,701)
2022112303226	SO	USDMXN	dic-22	(49,204)	19.44	956,378
2022112303227	SO	USDMXN	dic-22	(49,148)	19.44	955,290
2022112303228	SO	USDMXN	dic-22	(47,604)	19.44	925,279
2022112303229	SO	USDMXN	dic-22	(47,604)	19.44	925,279
2022112303230	SO	USDMXN	dic-22	(47,604)	19.44	925,279
2022112303231	SO	USDMXN	dic-22	(47,604)	19.44	925,279
2022112303232	SO	USDMXN	dic-22	(47,604)	19.44	925,279

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022112303233	SO	USDMXN	dic-22	(45,764)	19.44	889,515
2022112303645	SO	USDMXN	dic-22	(45,764)	19.41	888,233
2022111803708	BO	USDMXN	dic-22	354,109	19.48	(6,899,322)
2022111803712	SO	USDMXN	dic-22	(47,060)	19.49	917,199
2022111803713	SO	USDMXN	dic-22	(49,585)	19.49	966,419
2022111803714	SO	USDMXN	dic-22	(50,545)	19.49	985,118
2022111803715	SO	USDMXN	dic-22	(50,545)	19.49	985,118
2022111803716	SO	USDMXN	dic-22	(50,545)	19.49	985,118
2022111803717	SO	USDMXN	dic-22	(52,915)	19.49	1,031,306
2022111803718	SO	USDMXN	dic-22	(52,915)	19.49	1,031,306
2022111503086	BO	USDMXN	dic-22	95,000	19.42	(1,845,089)
2022111503093	BO	USDMXN	dic-22	120	19.43	(2,331)
2022111503441	BO	USDMXN	dic-22	190,240	19.45	(3,699,274)
2022111503091	SO	USDMXN	dic-22	(47,560)	19.45	924,899
2022111503092	SO	USDMXN	dic-22	(47,560)	19.45	924,899
2022111503436	SO	USDMXN	dic-22	(47,560)	19.46	925,422
2022111503437	SO	USDMXN	dic-22	(47,560)	19.46	925,422
2022111503438	SO	USDMXN	dic-22	(47,560)	19.46	925,422
2022111503439	SO	USDMXN	dic-22	(47,560)	19.46	925,422
2022111103499	B	USDMXN	dic-22	104,000	19.58	(2,036,147)
2022111103628	BO	USDMXN	dic-22	32,400	19.58	(634,339)
2022111103491	SO	USDMXN	dic-22	(104,000)	19.59	2,037,620
2022111103637	SO	USDMXN	dic-22	(32,400)	19.60	634,975
2022111003437	B	USDMXN	dic-22	52,070	19.53	(1,016,734)
2022111003243	SO	USDMXN	dic-22	(52,070)	19.44	1,012,006
2022110903445	BO	USDMXN	dic-22	114,960	19.67	(2,261,038)
2022110903431	SO	USDMXN	dic-22	(114,960)	19.69	2,262,988
2022110803326	BO	USDMXN	dic-22	95,000	19.57	(1,859,019)
2022110803327	BO	USDMXN	dic-22	200	19.59	(3,918)
2022110803300	SO	USDMXN	dic-22	(47,600)	19.58	931,865
2022110803301	SO	USDMXN	dic-22	(47,600)	19.58	931,865
2022110703469	BO	USDMXN	dic-22	137,021	19.55	(2,678,285)
2022110703593	BO	USDMXN	dic-22	23,550	19.54	(460,135)
2022110703216	SO	USDMXN	dic-22	(46,621)	19.55	911,534
2022110703359	SO	USDMXN	dic-22	(90,400)	19.57	1,769,490
2022110703379	SO	USDMXN	dic-22	(90,400)	19.57	1,769,490
2022110703601	SO	USDMXN	dic-22	(23,550)	19.60	461,509
2022110403572	B	USDMXN	dic-22	100,000,000	19.66	(1,965,850,000)
2022110303460	B	USDMXN	dic-22	1,626,000	19.78	(32,154,617)
2022110303734	BO	USDMXN	dic-22	45,100	19.74	(890,405)
2022110303780	B	USDMXN	dic-22	13,000,000	19.75	(256,812,452)
2022110303823	BO	USDMXN	dic-22	26,000	19.77	(514,022)
2022110303842	BO	USDMXN	dic-22	42,400	19.77	(838,305)
2022110303218	SO	USDMXN	dic-22	(1,500,000)	19.78	29,667,150
2022110303344	SO	USDMXN	dic-22	(45,100)	19.80	892,935
2022110303362	SO	USDMXN	dic-22	(115,000)	19.78	2,274,827
2022110303379	SO	USDMXN	dic-22	(11,000)	19.78	217,592
2022110303757	SO	USDMXN	dic-22	(13,000,000)	20.00	259,959,700
2022110303790	SO	USDMXN	dic-22	(42,400)	19.77	838,248
2022110303829	SO	USDMXN	dic-22	(26,000)	19.82	515,320
2022102703062	BO	USDMXN	dic-22	246,760	20.02	(4,940,551)
2022102703044	SO	USDMXN	dic-22	(88,000)	20.04	1,763,696
2022102703045	SO	USDMXN	dic-22	(158,760)	20.04	3,181,868
2022102603259	BO	USDMXN	dic-22	400,000	20.02	(8,006,227)
2022102603155	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.04	2,003,950
2022102603156	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.04	2,003,950
2022102603157	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.04	2,003,950
2022102603158	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.04	2,003,950
2022102403066	B	USDMXN	dic-22	400,000	20.13	(8,053,602)
2022102403315	BO	USDMXN	dic-22	56,000	20.10	(1,125,860)
2022102403313	SO	USDMXN	dic-22	(56,000)	20.12	1,126,552
2022102103423	B	USDMXN	dic-22	400,000	20.09	(8,037,796)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022102103370	SO	USDMXN	dic-22	(400,000)	20.16	8,062,400
2022102103825	SO	USDMXN	dic-22	(80,000)	20.11	1,609,040
2022102103826	SO	USDMXN	dic-22	(80,000)	20.11	1,609,040
2022102103827	SO	USDMXN	dic-22	(80,000)	20.11	1,609,040
2022102103828	SO	USDMXN	dic-22	(80,000)	20.11	1,609,040
2022102103829	SO	USDMXN	dic-22	(80,000)	20.11	1,609,040
2022101903584	BO	USDMXN	dic-22	115,200	20.30	(2,338,350)
2022101903582	SO	USDMXN	dic-22	(63,600)	20.31	1,291,716
2022101903583	SO	USDMXN	dic-22	(51,600)	20.31	1,047,996
2022101703277	B	USDMXN	dic-22	52,800	20.16	(1,064,651)
2022101703232	SO	USDMXN	dic-22	(52,800)	20.23	1,068,213
2022102003382	SO	USDMXN	dic-22	(52,800)	20.18	1,065,346
2022100403585	BO	USDMXN	dic-22	17,200	20.19	(347,249)
2022100403576	SO	USDMXN	dic-22	(17,200)	20.20	347,473
2022091203458	B	USDMXN	dic-22	120,000	20.17	(2,420,916)
2022091203196	SO	USDMXN	dic-22	(110,000)	20.25	2,227,720
2022091203210	SO	USDMXN	dic-22	(10,000)	20.25	202,520
2022090203112	BO	USDMXN	dic-22	2,000,000	20.31	(40,627,120)
2022090203136	SO	USDMXN	dic-22	(2,000,000)	20.33	40,669,000
2022081203744	BO	USDMXN	dic-22	102,000	20.29	(2,069,524)
2022081203661	SO	USDMXN	dic-22	(102,000)	20.32	2,072,334
2022062903500	SO	USDMXN	dic-22	(345,838)	20.71	7,163,814
2022062903326	BON	USDMXN	dic-22	345,838	20.82	(7,200,000)
2022062903350	BON	USDMXN	dic-22	345,838	20.82	(7,200,000)
2022031503355	SO	USDMXN	dic-22	(274,425)	21.96	6,025,876
2022031503313	BON	USDMXN	dic-22	274,425	21.96	(6,025,000)
2022031503315	BON	USDMXN	dic-22	274,425	21.96	(6,025,000)
2022030103307	SO	USDMXN	dic-22	(277,496)	21.72	6,026,125
2022030103245	BON	USDMXN	dic-22	277,496	21.71	(6,025,000)
2022030103260	BON	USDMXN	dic-22	277,496	21.71	(6,025,000)
2022022203453	SO	USDMXN	dic-22	(280,000)	21.42	5,998,446
2022022203454	SO	USDMXN	dic-22	(1,082)	21.42	23,180
2022022203100	BON	USDMXN	dic-22	281,082	21.44	(6,025,000)
2022022203107	BON	USDMXN	dic-22	281,082	21.44	(6,025,000)
2022011103415	SO	USDMXN	dic-22	(175,212)	21.69	3,800,463
2022011103359	BON	USDMXN	dic-22	175,212	21.69	(3,800,000)
2022011103384	BON	USDMXN	dic-22	175,212	21.69	(3,800,000)
2022011103507	BON	USDMXN	dic-22	175,212	21.69	(3,800,000)
2022010403274	SO	USDMXN	dic-22	(170,000)	21.91	3,725,199
2022010403300	SO	USDMXN	dic-22	(431)	21.92	9,447
2022010403301	SO	USDMXN	dic-22	(2,927)	21.92	64,153
2022010403266	BON	USDMXN	dic-22	173,358	21.92	(3,800,000)
2022010403292	BON	USDMXN	dic-22	173,358	21.92	(3,800,000)
2022111603433	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.40	(1,939,523)
2022111603240	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	21.37	2,137,100
2022111103348	BO	USDMXN	dic-22	16,368	19.61	(320,996)
2022111103360	SO	USDMXN	dic-22	(16,368)	19.61	321,042
2022110803058	BO	USDMXN	dic-22	100,000	19.58	(1,957,818)
2022110803063	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.68	1,967,500
2022110403544	B	USDMXN	dic-22	50,000	19.67	(983,339)
2022110403653	BO	USDMXN	dic-22	44,756	19.65	(879,240)
2022110403404	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.69	984,350
2022110403683	SO	USDMXN	dic-22	(44,756)	19.68	880,820
2022110403704	SO	USDMXN	dic-22	(44,756)	19.68	880,820
2022102503618	BO	USDMXN	dic-22	66,200	20.04	(1,326,977)
2022102503288	SO	USDMXN	dic-22	(66,200)	20.07	1,328,449
2022102403280	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	20.10	603,129
2022102403284	BO	USDMXN	dic-22	27,000	20.10	(542,565)
2022102403286	BO	USDMXN	dic-22	3,000	20.10	(60,285)
2022102103537	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.15	(1,209,070)
2022102103606	BO	USDMXN	dic-22	15,000	20.11	(301,649)
2022102103514	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.15	1,209,252



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022102103601	SO	USDMXN	dic-22	(15,000)	20.18	302,625
2022100403229	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.21	(1,212,627)
2022100403217	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.21	1,212,810
2022100303403	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.28	(1,216,612)
2022100303261	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.31	1,218,780
2022092203638	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.22	(1,212,914)
2022092203600	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.21	1,212,534
2022091203568	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.15	(1,208,972)
2022091203152	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.09	1,205,238
2022081203745	BO	USDMXN	dic-22	88,000	20.29	(1,785,820)
2022081203660	SO	USDMXN	dic-22	(88,000)	20.32	1,788,292
2022071403326	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	21.47	2,147,075
2022071403164	BO	USDMXN	dic-22	100,000	21.37	(2,137,100)
2022032903084	B	USDMXN	dic-22	1,196,663	20.97	(25,093,312)
2022032903079	SO	USDMXN	dic-22	(1,196,663)	21.00	25,128,007
2022031503283	SO	USDMXN	dic-22	(283,068)	21.97	6,219,035
2022031503255	BON	USDMXN	dic-22	283,068	21.97	(6,219,000)
2022031503257	BON	USDMXN	dic-22	283,068	21.97	(6,219,000)
2022011103440	SO	USDMXN	dic-22	(285,635)	21.69	6,196,669
2022011103336	BON	USDMXN	dic-22	285,635	21.71	(6,200,000)
2022011103363	BON	USDMXN	dic-22	285,635	21.71	(6,200,000)
2022010503285	BO	USDMXN	dic-22	6,555,000	21.74	(142,517,224)
2022010503318	SO	USDMXN	dic-22	(305,000)	21.77	6,638,539
2022010503319	SO	USDMXN	dic-22	(350,000)	21.77	7,617,995
2022010503407	SO	USDMXN	dic-22	(5,900,000)	21.77	128,417,630
2022010403355	S	USDMXN	dic-22	(282,847)	21.89	6,192,597
2022010403324	BON	USDMXN	dic-22	282,847	21.92	(6,200,000)
2022010403329	BON	USDMXN	dic-22	282,847	21.92	(6,200,000)
2022120203410	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.44	1,943,789
2022120203420	BO	USDMXN	dic-22	100,000	19.43	(1,943,000)
2022113003494	B	USDMXN	dic-22	15,000,000	19.47	(292,096,500)
2022112303255	B	USDMXN	dic-22	1,450,000	19.42	(28,158,453)
2022112303324	SO	USDMXN	dic-22	(1,450,000)	19.72	28,588,200
2022111703638	S	USDMXN	dic-22	(266,000)	19.49	5,185,187
2022111703588	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.40	(2,250,864)
2022111703589	BO	USDMXN	dic-22	150,000	19.40	(2,910,600)
2022111703687	BO	USDMXN	dic-22	150,000	19.40	(2,910,600)
2022110703307	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.56	(1,956,269)
2022110703646	B	USDMXN	dic-22	50,000	19.54	(977,143)
2022110703296	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.59	1,959,300
2022110703331	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.59	1,959,300
2022110403834	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.69	984,525
2022110303062	BO	USDMXN	dic-22	200,000	19.78	(3,955,163)
2022110303072	SO	USDMXN	dic-22	(200,000)	19.82	3,964,000
2022103103304	SO	USDMXN	dic-22	(25,000)	19.93	498,315
2022103103301	BO	USDMXN	dic-22	25,000	19.94	(498,500)
2022102003479	S	USDMXN	dic-22	(45,000)	20.24	910,828
2022102003423	BO	USDMXN	dic-22	4,000	20.22	(80,880)
2022102003424	BO	USDMXN	dic-22	41,000	20.22	(829,020)
2022100403164	B	USDMXN	dic-22	250,000	20.22	(5,056,028)
2022100403107	SO	USDMXN	dic-22	(250,000)	20.29	5,073,500
2022081003201	BO	USDMXN	dic-22	50,000	20.39	(1,019,324)
2022081003617	BO	USDMXN	dic-22	200,000	20.48	(4,096,847)
2022081003662	BO	USDMXN	dic-22	25,000	20.47	(511,689)
2022081003263	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	20.38	1,019,125
2022081003737	SO	USDMXN	dic-22	(200,000)	20.58	4,115,600
2022081003777	SO	USDMXN	dic-22	(25,000)	20.60	514,878
2022062103394	BO	USDMXN	dic-22	100,000	20.90	(2,089,848)
2022062103390	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.95	2,095,180
2022052303528	B	USDMXN	dic-22	4,400,000	20.67	(90,963,994)
2022052303501	SO	USDMXN	dic-22	(4,400,000)	20.68	90,994,200
2022052303521	SO	USDMXN	dic-22	(4,400,000)	20.68	90,994,200

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021092103434	S	USDMXN	dic-22	(105,000)	21.49	2,256,537
2021092103586	BO	USDMXN	dic-22	105,000	21.49	(2,256,755)
2022111803641	SO	USDMXN	dic-22	(352,000)	19.51	6,866,216
2022111803641	SO	USDMXN	dic-22	(352,000)	19.51	6,866,216
2022111803660	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.44	(2,254,901)
2022111803661	BO	USDMXN	dic-22	120,000	19.44	(2,332,656)
2022111803662	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.44	(2,254,901)
2022111403347	BO	USDMXN	dic-22	44,000	19.42	(854,685)
2022111403347	BO	USDMXN	dic-22	44,000	19.42	(854,685)
2022111403373	SO	USDMXN	dic-22	(44,000)	19.68	866,008
2022111003435	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.55	(1,954,537)
2022111003435	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.55	(1,954,537)
2022111003314	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.47	1,947,100
2022110803324	BO	USDMXN	dic-22	30,000	19.59	(587,676)
2022110803324	BO	USDMXN	dic-22	30,000	19.59	(587,676)
2022110803296	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	19.66	589,860
2022110703272	B	USDMXN	dic-22	30,000	19.58	(587,507)
2022110703451	B	USDMXN	dic-22	30,000	19.57	(587,091)
2022110703272	B	USDMXN	dic-22	30,000	19.58	(587,507)
2022110703451	B	USDMXN	dic-22	30,000	19.57	(587,091)
2022110703156	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	19.70	590,895
2022110703321	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	19.61	588,390
2022100703251	B	USDMXN	dic-22	1,000,000	20.25	(20,252,060)
2022100703251	B	USDMXN	dic-22	1,000,000	20.25	(20,252,060)
2022100703175	SO	USDMXN	dic-22	(1,000,000)	20.29	20,290,500
2022062103396	BO	USDMXN	dic-22	100,000	20.92	(2,091,571)
2022062103396	BO	USDMXN	dic-22	100,000	20.92	(2,091,571)
2022062103389	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.97	2,096,890
2022120603473	BO	USDMXN	dic-22	35,000	19.80	(692,868)
2022120603491	BO	USDMXN	dic-22	78,440	19.80	(1,553,295)
2022120603473	BO	USDMXN	dic-22	35,000	19.80	(692,868)
2022120603491	BO	USDMXN	dic-22	78,440	19.80	(1,553,295)
2022120603475	SO	USDMXN	dic-22	(35,000)	20.04	701,505
2022120603485	SO	USDMXN	dic-22	(39,220)	19.81	777,125
2022120603486	SO	USDMXN	dic-22	(39,220)	19.81	777,125
2022120503544	BO	USDMXN	dic-22	205,352	19.75	(4,055,580)
2022120503544	BO	USDMXN	dic-22	205,352	19.75	(4,055,580)
2022120503424	SO	USDMXN	dic-22	(41,060)	19.80	813,152
2022120503425	SO	USDMXN	dic-22	(41,060)	19.80	813,152
2022120503426	SO	USDMXN	dic-22	(41,060)	19.80	813,152
2022120503427	SO	USDMXN	dic-22	(41,416)	19.80	820,202
2022120503511	SO	USDMXN	dic-22	(40,756)	19.76	805,298
2022120203358	S	USDMXN	dic-22	(566,810)	19.44	11,018,159
2022120203411	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.45	1,945,356
2022120203358	S	USDMXN	dic-22	(566,810)	19.44	11,018,159
2022120203411	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.45	1,945,356
2022120203290	BO	USDMXN	dic-22	566,810	19.38	(10,985,909)
2022120203421	BO	USDMXN	dic-22	100,000	19.44	(1,944,000)
2022120203465	BON	USDMXN	dic-22	566,810	19.38	(10,985,909)
2022112903569	BO	USDMXN	dic-22	43,764	19.29	(844,314)
2022112903823	BO	USDMXN	dic-22	271,300	19.28	(5,229,525)
2022112903569	BO	USDMXN	dic-22	43,764	19.29	(844,314)
2022112903823	BO	USDMXN	dic-22	271,300	19.28	(5,229,525)
2022112903549	SO	USDMXN	dic-22	(43,764)	19.32	845,433
2022112903817	SO	USDMXN	dic-22	(45,336)	19.29	874,441
2022112903818	SO	USDMXN	dic-22	(44,536)	19.29	859,010
2022112903819	SO	USDMXN	dic-22	(44,536)	19.29	859,010
2022112903820	SO	USDMXN	dic-22	(45,604)	19.29	879,610
2022112903821	SO	USDMXN	dic-22	(45,644)	19.29	880,381
2022112903822	SO	USDMXN	dic-22	(45,644)	19.29	880,381
2022112403204	B	USDMXN	dic-22	86,640	19.43	(1,683,312)
2022112403204	B	USDMXN	dic-22	86,640	19.43	(1,683,312)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022112403141	SO	USDMXN	dic-22	(43,320)	19.44	842,271
2022112403142	SO	USDMXN	dic-22	(43,320)	19.44	842,271
2022112303547	BO	USDMXN	dic-22	44,000	19.43	(855,091)
2022112303651	BO	USDMXN	dic-22	44,000	19.42	(854,541)
2022112303547	BO	USDMXN	dic-22	44,000	19.43	(855,091)
2022112303651	BO	USDMXN	dic-22	44,000	19.42	(854,541)
2022112303347	SO	USDMXN	dic-22	(44,000)	19.45	855,778
2022112303644	SO	USDMXN	dic-22	(44,000)	19.43	855,118
2022111803701	BO	USDMXN	dic-22	94,300	19.51	(1,839,466)
2022111803701	BO	USDMXN	dic-22	94,300	19.51	(1,839,466)
2022111803627	SO	USDMXN	dic-22	(47,150)	19.55	921,627
2022111803628	SO	USDMXN	dic-22	(47,150)	19.55	921,627
2022111703534	B	USDMXN	dic-22	48,790	19.52	(952,388)
2022111703741	SO	USDMXN	dic-22	(300,000)	19.51	5,853,970
2022111703892	SO	USDMXN	dic-22	(1,316)	19.49	25,637
2022111703534	B	USDMXN	dic-22	48,790	19.52	(952,388)
2022111703741	SO	USDMXN	dic-22	(300,000)	19.51	5,853,970
2022111703892	SO	USDMXN	dic-22	(1,316)	19.49	25,637
2022111703641	BO	USDMXN	dic-22	301,316	19.52	(5,880,174)
2022111703691	BON	USDMXN	dic-22	301,316	19.52	(5,880,174)
2022111703301	SO	USDMXN	dic-22	(48,790)	19.54	953,308
2022111603354	BO	USDMXN	dic-22	47,000	19.39	(911,393)
2022111603479	BO	USDMXN	dic-22	560	19.41	(10,869)
2022111603354	BO	USDMXN	dic-22	47,000	19.39	(911,393)
2022111603479	BO	USDMXN	dic-22	560	19.41	(10,869)
2022111603355	SO	USDMXN	dic-22	(47,560)	19.40	922,807
2022111503568	B	USDMXN	dic-22	154,860	19.47	(3,015,793)
2022111503568	B	USDMXN	dic-22	154,860	19.47	(3,015,793)
2022111503554	SO	USDMXN	dic-22	(103,200)	19.48	2,010,284
2022111503555	SO	USDMXN	dic-22	(51,660)	19.48	1,006,311
2022111103629	BO	USDMXN	dic-22	16,200	19.60	(317,523)
2022111103629	BO	USDMXN	dic-22	16,200	19.60	(317,523)
2022111103636	SO	USDMXN	dic-22	(16,200)	19.61	317,650
2022110703003	BO	USDMXN	dic-22	180,000	19.59	(3,526,542)
2022110703003	BO	USDMXN	dic-22	180,000	19.59	(3,526,542)
2022110703019	SO	USDMXN	dic-22	(180,000)	19.65	3,536,460
2022110303462	B	USDMXN	dic-22	1,626,000	19.80	(32,198,079)
2022110303799	S	USDMXN	dic-22	(490,689)	19.78	9,704,423
2022110303462	B	USDMXN	dic-22	1,626,000	19.80	(32,198,079)
2022110303799	S	USDMXN	dic-22	(490,689)	19.78	9,704,423
2022110303630	BO	USDMXN	dic-22	490,689	19.79	(9,710,249)
2022110303712	BON	USDMXN	dic-22	490,689	19.79	(9,710,249)
2022110303217	SO	USDMXN	dic-22	(1,500,000)	19.78	29,667,150
2022110303361	SO	USDMXN	dic-22	(115,000)	19.78	2,274,827
2022110303378	SO	USDMXN	dic-22	(11,000)	19.78	217,592
2022110103419	BO	USDMXN	dic-22	400,000	19.83	(7,932,086)
2022110103356	SO	USDMXN	dic-22	(180,000)	19.90	3,581,752
2022110103419	BO	USDMXN	dic-22	400,000	19.83	(7,932,086)
2022110103356	SO	USDMXN	dic-22	(180,000)	19.90	3,581,752
2022110103369	BO	USDMXN	dic-22	180,000	19.89	(3,579,300)
2022110103411	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.91	1,990,500
2022110103412	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.91	1,990,500
2022110103413	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.91	1,990,500
2022110103414	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.91	1,990,500
2022102703529	BO	USDMXN	dic-22	400,000	20.02	(8,006,981)
2022102703529	BO	USDMXN	dic-22	400,000	20.02	(8,006,981)
2022102703534	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.04	2,004,200
2022102703535	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.04	2,004,200
2022102703536	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.04	2,004,200
2022102703537	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.04	2,004,200
2022102603545	B	USDMXN	dic-22	158,760	20.12	(3,194,918)
2022102603545	B	USDMXN	dic-22	158,760	20.12	(3,194,918)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022102603537	SO	USDMXN	dic-22	(158,760)	20.14	3,196,633
2022102503591	BO	USDMXN	dic-22	57,200	20.04	(1,146,521)
2022102503626	BO	USDMXN	dic-22	400	20.07	(8,027)
2022102503591	BO	USDMXN	dic-22	57,200	20.04	(1,146,521)
2022102503626	BO	USDMXN	dic-22	400	20.07	(8,027)
2022102503556	SO	USDMXN	dic-22	(57,600)	20.06	1,155,686
2022102103240	BO	USDMXN	dic-22	26,400	20.20	(533,337)
2022102103246	BO	USDMXN	dic-22	50,000	20.20	(1,010,180)
2022102103331	BO	USDMXN	dic-22	3,600	20.13	(72,459)
2022102103426	B	USDMXN	dic-22	400,000	20.12	(8,049,126)
2022102103240	BO	USDMXN	dic-22	26,400	20.20	(533,337)
2022102103246	BO	USDMXN	dic-22	50,000	20.20	(1,010,180)
2022102103331	BO	USDMXN	dic-22	3,600	20.13	(72,459)
2022102103426	B	USDMXN	dic-22	400,000	20.12	(8,049,126)
2022102103050	SO	USDMXN	dic-22	(80,000)	20.22	1,617,416
2022102103369	SO	USDMXN	dic-22	(400,000)	20.20	8,081,600
2022101703279	B	USDMXN	dic-22	71,000	20.19	(1,433,576)
2022101703279	B	USDMXN	dic-22	71,000	20.19	(1,433,576)
2022101703234	SO	USDMXN	dic-22	(47,200)	20.20	953,652
2022101703239	SO	USDMXN	dic-22	(23,800)	20.20	480,820
2022100503455	BO	USDMXN	dic-22	15,200	20.29	(308,341)
2022100503455	BO	USDMXN	dic-22	15,200	20.29	(308,341)
2022100503440	SO	USDMXN	dic-22	(15,200)	20.30	308,536
2022092803440	BO	USDMXN	dic-22	352,000	20.42	(7,186,639)
2022092803479	BO	USDMXN	dic-22	592	20.41	(12,082)
2022092803471	S	USDMXN	dic-22	(98,672)	20.40	2,013,307
2022092803475	S	USDMXN	dic-22	(136,820)	20.41	2,791,947
2022092803477	S	USDMXN	dic-22	(64,800)	20.40	1,321,607
2022092803440	BO	USDMXN	dic-22	352,000	20.42	(7,186,639)
2022092803479	BO	USDMXN	dic-22	592	20.41	(12,082)
2022092803471	S	USDMXN	dic-22	(98,672)	20.40	2,013,307
2022092803475	S	USDMXN	dic-22	(136,820)	20.41	2,791,947
2022092803477	S	USDMXN	dic-22	(64,800)	20.40	1,321,607
2022092803465	SO	USDMXN	dic-22	(52,300)	20.43	1,068,384
2022092603328	B	USDMXN	dic-22	20,000,000	20.68	(413,618,600)
2022092603345	B	USDMXN	dic-22	20,000,000	20.70	(413,922,400)
2022092603328	B	USDMXN	dic-22	20,000,000	20.68	(413,618,600)
2022092603345	B	USDMXN	dic-22	20,000,000	20.70	(413,922,400)
2022092603325	S	USDMXN	dic-22	(50,000,000)	20.71	1,035,525,000
2022091203460	B	USDMXN	dic-22	120,000	20.20	(2,424,056)
2022091203460	B	USDMXN	dic-22	120,000	20.20	(2,424,056)
2022091203195	SO	USDMXN	dic-22	(110,000)	20.25	2,227,720
2022091203209	SO	USDMXN	dic-22	(10,000)	20.25	202,520
2022090903470	B	USDMXN	dic-22	2,000,000	20.25	(40,503,996)
2022090903470	B	USDMXN	dic-22	2,000,000	20.25	(40,503,996)
2022090903374	SO	USDMXN	dic-22	(2,000,000)	20.26	40,523,800
2022090203205	BO	USDMXN	dic-22	1,000,000	20.32	(20,323,511)
2022090203205	BO	USDMXN	dic-22	1,000,000	20.32	(20,323,511)
2022090203210	SO	USDMXN	dic-22	(1,000,000)	20.34	20,336,500
2021122903102	BO	USDMXN	dic-22	250,000	22.02	(5,505,509)
2021122903102	BO	USDMXN	dic-22	250,000	22.02	(5,505,509)
2021122903067	SO	USDMXN	dic-22	(250,000)	22.09	5,522,250
2022121503675	S	USDMXN	dic-22	(4,494,190)	19.83	89,133,262
2022120603388	B	USDMXN	dic-22	5,931,114	19.82	(117,553,681)
2022120603391	B	USDMXN	dic-22	2,142,036	19.82	(42,451,258)
2022120603388	B	USDMXN	dic-22	5,931,114	19.82	(117,553,681)
2022120603391	B	USDMXN	dic-22	2,142,036	19.82	(42,451,258)
2022120603359	SO	USDMXN	dic-22	(1,243,076)	19.82	24,635,286
2022120603360	SO	USDMXN	dic-22	(6,830,075)	19.82	135,372,080
2022120603416	SON	USDMXN	dic-22	(1,243,076)	19.82	24,635,286
2022120603418	SON	USDMXN	dic-22	(6,830,075)	19.82	135,372,080
2022120103438	BO	USDMXN	dic-22	45,000	19.20	(863,905)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022120103545	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.21	(1,921,070)
2022120103438	BO	USDMXN	dic-22	45,000	19.20	(863,905)
2022120103545	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.21	(1,921,070)
2022120103393	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.22	1,921,770
2022120103444	SO	USDMXN	dic-22	(45,000)	19.25	866,358
2022112903573	S	USDMXN	dic-22	(1,614,778)	19.30	31,160,169
2022112903578	S	USDMXN	dic-22	(12,505,706)	19.30	241,358,095
2022112903573	S	USDMXN	dic-22	(1,614,778)	19.30	31,160,169
2022112903578	S	USDMXN	dic-22	(12,505,706)	19.30	241,358,095
2022112903559	BO	USDMXN	dic-22	14,120,485	19.30	(272,567,713)
2022112903753	BON	USDMXN	dic-22	14,120,485	19.30	(272,567,713)
2022112403354	SO	USDMXN	dic-22	(120,000)	19.44	2,332,999
2022112403354	SO	USDMXN	dic-22	(120,000)	19.44	2,332,999
2022112403269	BO	USDMXN	dic-22	120,000	19.38	(2,325,000)
2022112303561	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.42	(1,941,941)
2022112303578	SO	USDMXN	dic-22	(325,000)	19.42	6,312,830
2022112303561	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.42	(1,941,941)
2022112303578	SO	USDMXN	dic-22	(325,000)	19.42	6,312,830
2022112303587	BO	USDMXN	dic-22	161,000	19.36	(3,117,604)
2022112303588	BO	USDMXN	dic-22	93,000	19.36	(1,800,852)
2022112303589	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.36	(2,246,224)
2022112303592	BO	USDMXN	dic-22	161,000	19.36	(3,117,604)
2022112303709	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.36	(2,246,224)
2022112303441	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	21.39	2,139,400
2022112203325	S	USDMXN	dic-22	(1,649,572)	19.51	32,187,151
2022112203334	S	USDMXN	dic-22	(27,927,639)	19.51	544,874,319
2022112203420	S	USDMXN	dic-22	(45)	19.53	879
2022112203325	S	USDMXN	dic-22	(1,649,572)	19.51	32,187,151
2022112203334	S	USDMXN	dic-22	(27,927,639)	19.51	544,874,319
2022112203420	S	USDMXN	dic-22	(45)	19.53	879
2022112203248	BO	USDMXN	dic-22	14,877,256	19.51	(290,256,749)
2022112203250	BO	USDMXN	dic-22	14,700,000	19.50	(286,697,040)
2022112203310	BON	USDMXN	dic-22	14,877,256	19.51	(290,256,749)
2022112203312	BON	USDMXN	dic-22	14,700,000	19.50	(286,697,040)
2022110703274	B	USDMXN	dic-22	30,000	19.59	(587,713)
2022110703274	B	USDMXN	dic-22	30,000	19.59	(587,713)
2022110703155	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	19.70	591,090
2022110403611	BO	USDMXN	dic-22	1,400,000	19.69	(27,559,086)
2022110403655	BO	USDMXN	dic-22	44,756	19.67	(880,352)
2022110403613	SO	USDMXN	dic-22	(3,000)	19.65	58,956
2022110403611	BO	USDMXN	dic-22	1,400,000	19.69	(27,559,086)
2022110403655	BO	USDMXN	dic-22	44,756	19.67	(880,352)
2022110403613	SO	USDMXN	dic-22	(3,000)	19.65	58,956
2022110403569	SO	USDMXN	dic-22	(1,397,000)	19.70	27,516,709
2022110403682	SO	USDMXN	dic-22	(44,756)	19.68	880,820
2022102603148	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.04	(1,202,328)
2022102603148	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.04	(1,202,328)
2022102603058	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.06	1,203,864
2022102503620	BO	USDMXN	dic-22	66,200	20.07	(1,328,783)
2022102503620	BO	USDMXN	dic-22	66,200	20.07	(1,328,783)
2022102503287	SO	USDMXN	dic-22	(66,200)	20.07	1,328,449
2022102103539	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.18	(1,210,761)
2022102103539	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.18	(1,210,761)
2022102103513	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.18	1,210,866
2022100403232	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.24	(1,214,498)
2022100403426	BO	USDMXN	dic-22	107,491	20.25	(2,176,965)
2022100403232	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.24	(1,214,498)
2022100403426	BO	USDMXN	dic-22	107,491	20.25	(2,176,965)
2022100403216	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.24	1,214,280
2022100403419	SO	USDMXN	dic-22	(107,491)	20.25	2,177,104
2022100403483	SON	USDMXN	dic-22	(107,491)	20.25	2,177,104
2022100303405	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.30	(1,218,028)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022100303405	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.30	(1,218,028)
2022100303260	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.34	1,220,220
2022092203639	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.24	(1,214,519)
2022092203639	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.24	(1,214,519)
2022092203599	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.23	1,214,094
2022092003343	B	USDMXN	dic-22	3,029,846	20.32	(61,566,231)
2022092003343	B	USDMXN	dic-22	3,029,846	20.32	(61,566,231)
2022092003233	SO	USDMXN	dic-22	(3,029,846)	20.32	61,556,775
2022092003297	SON	USDMXN	dic-22	(3,029,846)	20.32	61,556,775
2022071403327	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	21.50	2,149,874
2022071403327	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	21.50	2,149,874
2022071403163	BO	USDMXN	dic-22	100,000	21.39	(2,139,400)
2022070603175	BO	EURUSD	dic-22	300,000	1.03	(308,758)
2022070603129	SO	USDMXN	dic-22	(150,000)	21.33	3,200,221
2022070603451	SO	USDMXN	dic-22	(1,412)	21.30	30,082
2022070603175	BO	EURUSD	dic-22	300,000	1.03	(308,758)
2022070603129	SO	USDMXN	dic-22	(150,000)	21.33	3,200,221
2022070603451	SO	USDMXN	dic-22	(1,412)	21.30	30,082
2022070603209	SO	EURUSD	dic-22	(300,000)	1.03	310,170
2022070603134	BO	USDMXN	dic-22	150,000	21.34	(3,200,700)
2022040103608	BO	USDMXN	dic-22	593,000	20.86	(12,367,135)
2022040103609	BO	USDMXN	dic-22	322	20.84	(6,708)
2022040103608	BO	USDMXN	dic-22	593,000	20.86	(12,367,135)
2022040103609	BO	USDMXN	dic-22	322	20.84	(6,708)
2022040103550	SO	USDMXN	dic-22	(593,322)	20.85	12,371,357
2022040103578	SON	USDMXN	dic-22	(593,322)	20.85	12,371,357
2022032903088	B	USDMXN	dic-22	1,196,663	21.00	(25,125,897)
2022032903088	B	USDMXN	dic-22	1,196,663	21.00	(25,125,897)
2022032903078	SO	USDMXN	dic-22	(1,196,663)	21.00	25,128,007
2022032403624	B	USDMXN	dic-22	793,350	21.14	(16,772,652)
2022032403624	B	USDMXN	dic-22	793,350	21.14	(16,772,652)
2022032403698	SO	USDMXN	dic-22	(793,350)	21.16	16,786,096
2022031503244	B	USDMXN	dic-22	296,661	22.01	(6,530,198)
2022031503244	B	USDMXN	dic-22	296,661	22.01	(6,530,198)
2022031503176	SO	USDMXN	dic-22	(296,661)	22.03	6,534,552
2022031503183	SON	USDMXN	dic-22	(296,661)	22.03	6,534,552
2022030703243	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	22.24	2,224,457
2022030703243	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	22.24	2,224,457
2022030703048	BO	USDMXN	dic-22	100,000	22.02	(2,201,910)
2022013103096	B	USDMXN	dic-22	668,621	21.97	(14,687,167)
2022013103096	B	USDMXN	dic-22	668,621	21.97	(14,687,167)
2022013103172	SO	USDMXN	dic-22	(668,621)	22.03	14,729,052
2021112503075	SO	USDMXN	dic-22	(90,000)	23.03	2,072,873
2021112503075	SO	USDMXN	dic-22	(90,000)	23.03	2,072,873
2021112503157	BO	USDMXN	dic-22	90,000	22.52	(2,026,944)
2022120903186	S	USDMXN	dic-22	(4,494,190)	19.83	89,133,262
2022120803412	B	USDMXN	dic-22	14,700,000	19.67	(289,219,560)
2022120803210	S	USDMXN	dic-22	(13,700,000)	19.70	269,893,548
2022120803406	S	USDMXN	dic-22	(14,700,000)	19.67	289,219,560
2022120803421	S	USDMXN	dic-22	(1,000,000)	19.66	19,661,336
2022120803412	B	USDMXN	dic-22	14,700,000	19.67	(289,219,560)
2022120803210	S	USDMXN	dic-22	(13,700,000)	19.70	269,893,548
2022120803406	S	USDMXN	dic-22	(14,700,000)	19.67	289,219,560
2022120803421	S	USDMXN	dic-22	(1,000,000)	19.66	19,661,336
2022120603275	SO	USDMXN	dic-22	(1,500,000)	19.86	29,790,939
2022120603275	SO	USDMXN	dic-22	(1,500,000)	19.86	29,790,939
2022120603169	BO	USDMXN	dic-22	1,500,000	19.84	(29,760,000)
2022120103562	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.21	(1,921,480)
2022120103562	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.21	(1,921,480)
2022120103580	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.28	1,928,400
2022112903694	SO	USDMXN	dic-22	(232,000)	19.29	4,476,285
2022112903694	SO	USDMXN	dic-22	(232,000)	19.29	4,476,285

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022112903596	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.23	(2,230,564)
2022112903597	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.23	(2,230,564)
2022110703276	B	USDMXN	dic-22	40,000	19.59	(783,751)
2022110703462	BO	USDMXN	dic-22	50,000	19.58	(978,932)
2022110703276	B	USDMXN	dic-22	40,000	19.59	(783,751)
2022110703462	BO	USDMXN	dic-22	50,000	19.58	(978,932)
2022110703154	SO	USDMXN	dic-22	(40,000)	19.71	788,260
2022110703354	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.68	984,075
2022110403749	B	USDMXN	dic-22	11,925,693	19.65	(234,306,567)
2022110403749	B	USDMXN	dic-22	11,925,693	19.65	(234,306,567)
2022110403701	SO	USDMXN	dic-22	(11,925,693)	19.68	234,649,931
2022100403166	B	USDMXN	dic-22	250,000	20.25	(5,062,151)
2022100403166	B	USDMXN	dic-22	250,000	20.25	(5,062,151)
2022100403106	SO	USDMXN	dic-22	(250,000)	20.32	5,080,000
2022092703439	SO	USDMXN	dic-22	(18,000)	20.65	371,766
2022092703439	SO	USDMXN	dic-22	(18,000)	20.65	371,766
2022092703442	BO	USDMXN	dic-22	18,000	20.64	(371,520)
2022092203057	B	USDMXN	dic-22	213,054	20.22	(4,307,236)
2022092203407	B	USDMXN	dic-22	500,000	20.25	(10,123,986)
2022092203057	B	USDMXN	dic-22	213,054	20.22	(4,307,236)
2022092203407	B	USDMXN	dic-22	500,000	20.25	(10,123,986)
2022092203055	S	USDMXN	dic-22	(213,054)	20.22	4,308,548
2022092203074	S	USDMXN	dic-22	(213,054)	20.22	4,308,548
2022092203301	SO	USDMXN	dic-22	(500,000)	21.35	10,673,750
2022081003202	BO	USDMXN	dic-22	50,000	20.41	(1,020,632)
2022081003618	BO	USDMXN	dic-22	200,000	20.51	(4,102,022)
2022081003664	BO	USDMXN	dic-22	25,000	20.49	(512,336)
2022081003202	BO	USDMXN	dic-22	50,000	20.41	(1,020,632)
2022081003618	BO	USDMXN	dic-22	200,000	20.51	(4,102,022)
2022081003664	BO	USDMXN	dic-22	25,000	20.49	(512,336)
2022081003262	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	20.38	1,019,125
2022081003736	SO	USDMXN	dic-22	(200,000)	20.58	4,115,600
2022081003776	SO	USDMXN	dic-22	(25,000)	20.60	514,878
2022070603265	SO	USDMXN	dic-22	(500,000)	21.38	10,688,160
2022070603265	SO	USDMXN	dic-22	(500,000)	21.38	10,688,160
2022070603266	BO	USDMXN	dic-22	500,000	21.35	(10,673,750)
2022062403179	BO	USDMXN	dic-22	100,000	20.56	(2,055,805)
2022062403179	BO	USDMXN	dic-22	100,000	20.56	(2,055,805)
2022062403127	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.66	2,065,590
2022040403487	B	USDMXN	dic-22	1,623,523	20.77	(33,718,324)
2022040403487	B	USDMXN	dic-22	1,623,523	20.77	(33,718,324)
2022040403493	SO	USDMXN	dic-22	(1,623,523)	20.78	33,735,184
2021092103436	S	USDMXN	dic-22	(105,000)	21.51	2,258,914
2021092103436	S	USDMXN	dic-22	(105,000)	21.51	2,258,914
2021092103585	BO	USDMXN	dic-22	105,000	21.52	(2,259,212)
2022112903613	BO	USDMXN	dic-22	120,000	19.24	(2,308,560)
2022112903614	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.24	(2,231,608)
2022112903615	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.24	(2,231,608)
202211003261	SO	USDMXN	dic-22	(10,000)	19.64	196,410
2022110703353	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.69	984,600
2022110403700	SO	USDMXN	dic-22	(263,729)	19.69	5,191,506
2022102503106	SON	USDMXN	dic-22	(727,200)	20.06	14,589,668
2022111403454	SO	USDMXN	dic-22	(40,000)	19.54	781,640
2022111003260	SO	USDMXN	dic-22	(10,000)	19.64	196,445
2022110703320	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	19.64	589,170
2022110403699	SO	USDMXN	dic-22	(5,140,686)	19.70	101,261,241
2022062403126	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.67	2,067,380
2022120903524	SO	USDMXN	dic-22	(39,444)	19.82	781,622
2022120903525	SO	USDMXN	dic-22	(38,164)	19.82	756,258
2022120903526	SO	USDMXN	dic-22	(38,164)	19.82	756,258
2022120903527	SO	USDMXN	dic-22	(38,164)	19.82	756,258
2022120903528	SO	USDMXN	dic-22	(38,244)	19.82	757,843



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022120903529	SO	USDMXN	dic-22	(38,244)	19.82	757,843
2022120903565	SO	USDMXN	dic-22	(38,664)	19.80	765,586
2022120903566	SO	USDMXN	dic-22	(38,664)	19.80	765,586
2022120503443	SO	USDMXN	dic-22	(42,996)	19.81	851,794
2022120503444	SO	USDMXN	dic-22	(42,996)	19.81	851,794
2022120503445	SO	USDMXN	dic-22	(42,596)	19.81	843,869
2022120503543	SO	USDMXN	dic-22	(40,756)	19.78	806,276
2022120103576	SO	USDMXN	dic-22	(41,200)	19.24	792,688
2022120103577	SO	USDMXN	dic-22	(54,000)	19.24	1,038,960
2022112403140	SO	USDMXN	dic-22	(45,600)	19.47	887,741
2022112403418	SO	USDMXN	dic-22	(103,200)	19.50	2,012,194
2022112203254	SO	USDMXN	dic-22	(45,600)	19.55	891,662
2022112203255	SO	USDMXN	dic-22	(46,000)	19.55	899,484
2022111803568	SO	USDMXN	dic-22	(47,945)	19.56	937,668
2022111803569	SO	USDMXN	dic-22	(42,230)	19.56	825,892
2022111803570	SO	USDMXN	dic-22	(53,710)	19.56	1,050,406
2022111803571	SO	USDMXN	dic-22	(53,710)	19.56	1,050,406
2022111603476	SO	USDMXN	dic-22	(400,000)	19.49	7,794,400
2022111503049	SO	USDMXN	dic-22	(47,355)	19.50	923,209
2022111503050	SO	USDMXN	dic-22	(47,355)	19.50	923,209
2022111503434	SO	USDMXN	dic-22	(47,560)	19.51	927,777
2022111503435	SO	USDMXN	dic-22	(11,000)	19.51	214,583
2022111503442	SO	USDMXN	dic-22	(47,560)	19.51	927,777
2022111503553	SO	USDMXN	dic-22	(103,200)	19.50	2,012,864
2022111503560	SO	USDMXN	dic-22	(13,120)	19.50	255,899
2022111503561	SO	USDMXN	dic-22	(103,200)	19.50	2,012,864
2022111403438	SO	USDMXN	dic-22	(23,550)	19.52	459,672
2022110703190	SO	USDMXN	dic-22	(440,000)	19.66	8,651,060
2022110303216	SO	USDMXN	dic-22	(1,500,000)	19.78	29,667,150
2022110303360	SO	USDMXN	dic-22	(115,000)	19.78	2,274,827
2022110303377	SO	USDMXN	dic-22	(11,000)	19.78	217,592
2022110103407	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.88	1,988,000
2022110103408	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.88	1,988,000
2022110103409	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.88	1,988,000
2022110103410	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.88	1,988,000
2022102703043	SO	USDMXN	dic-22	(79,380)	20.10	1,595,300
2022102603536	SO	USDMXN	dic-22	(79,380)	20.16	1,600,460
2022102103048	SO	USDMXN	dic-22	(52,800)	20.25	1,068,936
2022102103049	SO	USDMXN	dic-22	(80,000)	20.25	1,619,600
2022100503439	SO	USDMXN	dic-22	(15,200)	20.32	308,910
2022091203194	SO	USDMXN	dic-22	(110,000)	20.25	2,227,720
2022091203208	SO	USDMXN	dic-22	(10,000)	20.25	202,520
2022062803618	SO	USDMXN	dic-22	(56,258)	20.66	1,162,133
2022062203415	SO	USDMXN	dic-22	(42,620)	20.68	881,416
2022051303556	SO	USDMXN	dic-22	(85,791)	20.82	1,786,220
2022051303557	SO	USDMXN	dic-22	(68,489)	20.82	1,425,982
2022051303558	SO	USDMXN	dic-22	(29,905)	20.82	622,640
2022040703184	SO	USDMXN	dic-22	(135,118)	20.84	2,815,589
2022040603451	SO	USDMXN	dic-22	(48,559)	20.88	1,014,053
2022040103731	SO	USDMXN	dic-22	(122,337)	20.59	2,519,408
2022040103732	SO	USDMXN	dic-22	(166,283)	20.59	3,424,432
2022040103733	SO	USDMXN	dic-22	(625,083)	20.59	12,872,959
2022040103734	SO	USDMXN	dic-22	(19,004)	20.59	391,368
2022033103277	SO	USDMXN	dic-22	(63,014)	20.60	1,298,170
2022033103297	SO	USDMXN	dic-22	(96,548)	20.60	1,989,014
2022031503327	BON	USDMXN	dic-22	273,739	22.01	(6,025,000)
2022030103265	BON	USDMXN	dic-22	276,681	21.78	(6,025,000)
2022022503539	SO	USDMXN	dic-22	(92,898)	21.07	1,957,732
2022022503540	SO	USDMXN	dic-22	(211,016)	21.07	4,446,951
2022022303654	SO	USDMXN	dic-22	(711,341)	21.00	14,937,663
2022022303668	SO	USDMXN	dic-22	(770,725)	21.00	16,184,685
2022022303692	SO	USDMXN	dic-22	(3,367,196)	21.00	70,708,759

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022021703167	SO	USDMXN	dic-22	(66,932)	21.05	1,408,651
2022020803504	SO	USDMXN	dic-22	(50,149)	21.30	1,068,324
2022020403077	SO	USDMXN	dic-22	(62,008)	21.39	1,326,041
2022020403078	SO	USDMXN	dic-22	(170,217)	21.39	3,640,091
2022020403079	SO	USDMXN	dic-22	(13,148)	21.39	281,170
2022020203228	SO	USDMXN	dic-22	(34,096)	21.31	726,722
2022020203229	SO	USDMXN	dic-22	(86,693)	21.31	1,847,775
2022020203475	SO	USDMXN	dic-22	(78,669)	21.28	1,673,809
2022020203476	SO	USDMXN	dic-22	(92,290)	21.28	1,963,617
2022013103503	SO	USDMXN	dic-22	(130,131)	21.34	2,776,436
2022013103615	SO	USDMXN	dic-22	(39,396)	21.32	840,013
2022012803261	SO	USDMXN	dic-22	(934,228)	21.62	20,196,141
2022012803262	SO	USDMXN	dic-22	(155,012)	21.62	3,351,049
2022012803263	SO	USDMXN	dic-22	(77,326)	21.62	1,671,633
2022012803264	SO	USDMXN	dic-22	(286,575)	21.62	6,195,178
2022012803661	SO	USDMXN	dic-22	(347,168)	21.61	7,500,565
2022012803698	SO	USDMXN	dic-22	(66,788)	21.62	1,443,790
2022012803699	SO	USDMXN	dic-22	(123,191)	21.62	2,663,081
2022012803700	SO	USDMXN	dic-22	(75,457)	21.62	1,631,192
2022012803701	SO	USDMXN	dic-22	(118,450)	21.62	2,560,593
2022012703559	SO	USDMXN	dic-22	(143,017)	21.51	3,075,752
2022012703560	SO	USDMXN	dic-22	(213,592)	21.51	4,593,552
2022012703561	SO	USDMXN	dic-22	(96,129)	21.51	2,067,370
2022012703562	SO	USDMXN	dic-22	(76,559)	21.51	1,646,493
2022012703563	SO	USDMXN	dic-22	(93,949)	21.51	2,020,486
2022012703564	SO	USDMXN	dic-22	(304,856)	21.51	6,556,294
2022012703565	SO	USDMXN	dic-22	(87,258)	21.51	1,876,588
2022012503295	BON	USDMXN	dic-22	172,633	22.01	(3,800,000)
202201103509	BON	USDMXN	dic-22	174,705	21.75	(3,800,000)
2022010403294	BON	USDMXN	dic-22	172,869	21.98	(3,800,000)
2022121503195	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.87	1,986,820
2022121503720	SO	USDMXN	dic-22	(30,974)	19.76	611,901
202211003259	SO	USDMXN	dic-22	(10,000)	19.65	196,515
2022110403681	SO	USDMXN	dic-22	(44,756)	19.68	880,820
2022110403698	SO	USDMXN	dic-22	(6,143,522)	19.70	121,045,822
2022110303638	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	19.84	1,190,322
2022103103560	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.01	1,200,654
2022102603057	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.09	1,205,424
2022102503286	SO	USDMXN	dic-22	(66,200)	20.07	1,328,449
2022102103512	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.21	1,212,546
2022100403215	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.26	1,215,720
2022032903077	SO	USDMXN	dic-22	(1,196,663)	21.00	25,128,007
202201103504	BON	USDMXN	dic-22	284,979	21.76	(6,200,000)
2022010403337	BON	USDMXN	dic-22	282,100	21.98	(6,200,000)
2022121503369	BO	USDMXN	dic-22	1,000,000	19.86	(19,855,000)
2022120803376	BO	USDMXN	dic-22	116,500	19.63	(2,286,895)
2022120803377	BO	USDMXN	dic-22	99,600	19.63	(1,955,148)
2022112303322	SO	USDMXN	dic-22	(1,450,000)	19.72	28,588,200
202211003258	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.66	982,750
202211003262	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.72	1,971,500
2022103103323	SO	EURMXN	dic-22	(1,000,000)	19.84	19,835,800
2022101003294	SO	USDMXN	dic-22	(1,000,000)	20.26	20,256,000
2022100403105	SO	USDMXN	dic-22	(250,000)	20.35	5,086,750
2022081003261	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	20.38	1,019,125
2022081003735	SO	USDMXN	dic-22	(200,000)	20.58	4,115,600
2022081003775	SO	USDMXN	dic-22	(25,000)	20.60	514,878
2022062403125	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.69	2,068,650
2021092103584	BO	USDMXN	dic-22	105,000	21.54	(2,261,690)
2022122003463	B	USDMXN	dic-22	1,000,000	19.82	(19,820,000)
2022120903115	SO	USDMXN	dic-22	(556,000)	19.81	11,015,771
2022120903056	BO	USDMXN	dic-22	115,000	19.70	(2,265,730)
2022120903057	BO	USDMXN	dic-22	115,000	19.70	(2,265,730)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022120903066	BO	USDMXN	dic-22	116,000	19.70	(2,285,432)
2022120903067	BO	USDMXN	dic-22	90,000	19.70	(1,773,180)
2022120903068	BO	USDMXN	dic-22	120,000	19.70	(2,364,240)
2022120803434	SO	USDMXN	dic-22	(115,000)	19.73	2,269,094
2022120803375	BO	USDMXN	dic-22	115,000	19.64	(2,258,945)
2022120603472	BO	USDMXN	dic-22	85,000	19.84	(1,686,421)
2022120603474	SO	USDMXN	dic-22	(85,000)	20.09	1,707,310
2022120103430	B	USDMXN	dic-22	30,000	19.22	(576,741)
2022120103300	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	19.30	578,955
2022112803489	BO	USDMXN	dic-22	30,000	19.40	(582,010)
2022112803406	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	19.48	584,475
2022111403517	BO	USDMXN	dic-22	30,000	19.49	(584,651)
2022111403453	SO	USDMXN	dic-22	(30,000)	19.57	586,965
2022111003398	B	USDMXN	dic-22	20,000	19.61	(392,168)
2022111003257	SO	USDMXN	dic-22	(20,000)	19.67	393,400
2022110403370	B	USDMXN	dic-22	750,000	19.71	(14,782,447)
2022110303064	B	USDMXN	dic-22	6,243,392	19.84	(123,843,744)
2022110303050	SO	USDMXN	dic-22	(6,243,392)	19.86	124,000,000
2022062403182	BO	USDMXN	dic-22	100,000	20.60	(2,060,400)
2022062403240	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.69	2,069,000
2022030703498	SO	USDMXN	dic-22	(750,000)	22.53	16,894,784
2022122203246	S	USDMXN	dic-22	(447,371)	19.60	8,767,569
2022122203707	S	USDMXN	dic-22	(447,222)	19.57	8,750,207
2022122103147	BO	USDMXN	dic-22	33,000	19.73	(651,060)
2022122103159	SO	USDMXN	dic-22	(33,000)	19.83	654,489
2022121603541	BO	USDMXN	dic-22	191,456	19.82	(3,795,235)
2022121603624	BO	USDMXN	dic-22	39,980	19.83	(792,680)
2022121603439	SO	USDMXN	dic-22	(37,816)	19.84	750,232
2022121603440	SO	USDMXN	dic-22	(37,816)	19.84	750,232
2022121603441	SO	USDMXN	dic-22	(37,816)	19.84	750,232
2022121603442	SO	USDMXN	dic-22	(39,004)	19.84	773,800
2022121603443	SO	USDMXN	dic-22	(39,004)	19.84	773,800
2022121603611	SO	USDMXN	dic-22	(39,980)	19.86	793,883
2022121503680	BO	USDMXN	dic-22	40,500	19.77	(800,590)
2022121503771	BO	USDMXN	dic-22	28	19.78	(554)
2022121503683	SO	USDMXN	dic-22	(40,528)	19.77	801,360
2022121303614	B	USDMXN	dic-22	202,640	19.61	(3,974,419)
2022121303596	SO	USDMXN	dic-22	(40,528)	19.64	795,767
2022121303597	SO	USDMXN	dic-22	(40,528)	19.64	795,767
2022121303598	SO	USDMXN	dic-22	(40,528)	19.64	795,767
2022121303599	SO	USDMXN	dic-22	(40,528)	19.64	795,767
2022121303600	SO	USDMXN	dic-22	(40,528)	19.64	795,767
2022120703252	BO	USDMXN	dic-22	103,200	19.71	(2,034,197)
2022120703504	S	USDMXN	dic-22	(250,000)	19.74	4,933,753
2022120703216	SO	USDMXN	dic-22	(103,200)	19.78	2,041,100
2022120203359	B	USDMXN	dic-22	566,810	19.49	(11,045,206)
2022120203361	B	USDMXN	dic-22	1,155,778	19.49	(22,525,354)
2022120203576	SON	USDMXN	dic-22	(1,722,588)	19.43	33,461,268
2022120103669	BO	USDMXN	dic-22	41,100	19.24	(790,705)
2022120103643	SO	USDMXN	dic-22	(41,100)	19.25	791,171
2022112403305	BO	USDMXN	dic-22	29,350	19.50	(572,363)
2022112403395	B	USDMXN	dic-22	1,299,867	19.50	(25,348,504)
2022112403422	BO	USDMXN	dic-22	206,400	19.51	(4,026,517)
2022112403310	SO	USDMXN	dic-22	(29,350)	19.57	574,233
2022112403406	SON	USDMXN	dic-22	(1,299,867)	19.50	25,352,607
2022112403416	SO	USDMXN	dic-22	(103,200)	19.52	2,014,877
2022112403417	SO	USDMXN	dic-22	(103,200)	19.52	2,014,877
2022112203288	BO	USDMXN	dic-22	81,000	19.57	(1,584,861)
2022112203292	BO	USDMXN	dic-22	360	19.56	(7,040)
2022112203426	BO	USDMXN	dic-22	51,300	19.56	(1,003,227)
2022112203252	SO	USDMXN	dic-22	(40,400)	19.58	790,992
2022112203253	SO	USDMXN	dic-22	(40,960)	19.58	801,956

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022112203435	SO	USDMXN	dic-22	(51,300)	19.61	1,005,993
2022111703536	B	USDMXN	dic-22	44,280	19.57	(866,560)
2022111703186	SO	USDMXN	dic-22	(44,280)	19.60	867,799
2022111603486	B	USDMXN	dic-22	400,000	19.45	(7,779,836)
2022111603475	SO	USDMXN	dic-22	(400,000)	19.52	7,806,000
2022111503572	BO	USDMXN	dic-22	219,520	19.51	(4,282,182)
2022111503573	S	USDMXN	dic-22	(58,920)	19.51	1,149,606
2022111503558	SO	USDMXN	dic-22	(57,400)	19.53	1,120,936
2022111503559	SO	USDMXN	dic-22	(103,200)	19.53	2,015,341
2022111103630	BO	USDMXN	dic-22	75,600	19.65	(1,485,694)
2022111103633	SO	USDMXN	dic-22	(75,600)	19.67	1,486,750
2022110303469	B	USDMXN	dic-22	1,626,000	19.85	(32,280,341)
2022110303719	SO	USDMXN	dic-22	(1,500,000)	19.84	29,758,451
2022110303737	SO	USDMXN	dic-22	(2,440)	19.81	48,334
2022110303715	BON	USDMXN	dic-22	1,502,440	19.84	(29,803,893)
2022110303215	SO	USDMXN	dic-22	(1,500,000)	19.78	29,667,150
2022110303359	SO	USDMXN	dic-22	(115,000)	19.78	2,274,827
2022110303376	SO	USDMXN	dic-22	(11,000)	19.78	217,592
2022102803728	BO	USDMXN	dic-22	39,000	20.02	(780,850)
2022102803601	SO	USDMXN	dic-22	(39,000)	20.03	781,209
2022102003452	BO	USDMXN	dic-22	50,000	20.32	(1,016,170)
2022102003414	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	20.32	1,016,175
2022091203465	B	USDMXN	dic-22	120,000	20.25	(2,430,322)
2022091203193	SO	USDMXN	dic-22	(110,000)	20.25	2,227,720
2022091203207	SO	USDMXN	dic-22	(10,000)	20.25	202,520
2022082403552	BO	USDMXN	dic-22	222,000	20.40	(4,528,403)
2022042203524	S	USDMXN	dic-22	(381,124)	21.22	8,087,580
2022120203585	BON	USDMXN	dic-22	381,124	21.21	(8,081,743)
2021122903103	BO	USDMXN	dic-22	250,000	22.08	(5,520,859)
2022122303646	S	USDMXN	dic-22	(37,322)	19.43	725,160
2022122303714	S	USDMXN	dic-22	(37,322)	19.44	725,569
2022122303448	S	USDMXN	dic-22	(1,500,000)	19.40	29,095,500
2022121503286	SO	USDMXN	dic-22	(52,000)	19.87	1,033,241
2022121503105	BO	USDMXN	dic-22	52,000	19.71	(1,024,972)
2022121303326	SO	USDMXN	dic-22	(5,000,000)	19.68	98,397,531
2022121303327	SO	USDMXN	dic-22	(5,000,000)	19.68	98,409,531
2022121303328	SO	USDMXN	dic-22	(4,000,000)	19.68	78,720,425
2022121303615	S	USDMXN	dic-22	(202,640)	19.62	3,975,008
2022121303688	S	USDMXN	dic-22	(610,516)	19.60	11,963,568
2022121303547	BON	USDMXN	dic-22	14,813,156	19.68	(291,451,807)
2022120603389	S	USDMXN	dic-22	(5,931,114)	19.86	117,821,230
2022120603420	BON	USDMXN	dic-22	5,931,114	19.86	(117,791,933)
2022112303566	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.47	(1,947,028)
2022111603426	B	USDMXN	dic-22	634,141	19.46	(12,342,568)
2022111603452	SON	USDMXN	dic-22	(634,141)	19.45	12,334,550
2022111003409	B	USDMXN	dic-22	50,000	19.62	(980,771)
2022111003256	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.63	981,300
2022110803318	B	USDMXN	dic-22	1,385,140	19.66	(27,232,997)
2022110803420	SON	USDMXN	dic-22	(1,385,140)	19.66	27,237,118
2022110703279	B	USDMXN	dic-22	60,000	19.64	(1,178,200)
2022110703243	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	19.66	1,179,762
2022110403657	BO	USDMXN	dic-22	44,756	19.73	(882,814)
2022110403680	SO	USDMXN	dic-22	(44,756)	19.68	880,820
2022110303724	BO	USDMXN	dic-22	60,000	19.82	(1,189,260)
2022110303637	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	19.86	1,191,792
2022103103430	B	USDMXN	dic-22	60,000	20.02	(1,201,395)
2022103103559	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.04	1,202,136
2022102603150	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.09	(1,205,469)
2022102603056	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.12	1,206,984
2022102503622	BO	USDMXN	dic-22	66,200	20.12	(1,332,203)
2022102503648	B	USDMXN	dic-22	9,944,559	20.12	(200,099,603)
2022102503285	SO	USDMXN	dic-22	(66,200)	20.07	1,328,449

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022102503490	SO	USDMXN	dic-22	(9,944,559)	20.11	200,000,000
2022102103540	BO	USDMXN	dic-22	60,000	20.24	(1,214,135)
2022102103511	SO	USDMXN	dic-22	(60,000)	20.24	1,214,160
2022100403428	B	USDMXN	dic-22	3,413,274	20.30	(69,298,264)
2022100403466	SO	USDMXN	dic-22	(271,900)	20.29	5,518,013
2022100403487	SON	USDMXN	dic-22	(3,141,374)	20.30	63,782,467
2022082403553	BO	USDMXN	dic-22	222,000	20.40	(4,529,269)
2022071403329	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	21.55	2,155,371
2022032903093	B	USDMXN	dic-22	1,196,663	21.05	(25,194,382)
2022032903076	SO	USDMXN	dic-22	(1,196,663)	21.00	25,128,007
2021122903084	BO	USDMXN	dic-22	650,000	22.13	(14,383,418)
2022122303434	B	USDMXN	dic-22	36,336	19.39	(704,719)
2022122303406	SO	USDMXN	dic-22	(36,336)	19.48	707,723
2022121503287	SO	USDMXN	dic-22	(150,000)	19.87	2,980,935
2022121503103	BO	USDMXN	dic-22	98,000	19.71	(1,931,923)
2022121503104	BO	USDMXN	dic-22	52,000	19.71	(1,025,102)
2022120803456	S	USDMXN	dic-22	(500,000)	19.72	9,862,493
2022120503254	S	USDMXN	dic-22	(350,000)	19.87	6,952,895
2022120103232	B	USDMXN	dic-22	40,000,000	19.23	(769,285,608)
2022120103531	B	USDMXN	dic-22	350,000	19.27	(6,744,405)
2022120103566	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.26	(1,926,483)
2022120103218	S	USDMXN	dic-22	(40,000,000)	19.27	770,712,000
2022120103579	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	19.33	1,933,250
2022113003650	B	USDMXN	dic-22	533,500	19.39	(10,342,412)
2022113003611	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.47	10,388,152
2022112903284	B	USDMXN	dic-22	533,500	19.34	(10,320,183)
2022112903524	B	USDMXN	dic-22	533,500	19.36	(10,329,155)
2022112903205	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.24	10,262,619
2022112903599	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.33	10,309,888
2022112803319	B	USDMXN	dic-22	1,067,000	19.42	(20,717,045)
2022112803332	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.44	10,368,733
2022112803333	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.42	10,363,077
2022112503372	B	USDMXN	dic-22	1,067,000	19.44	(20,739,776)
2022112503379	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.47	10,389,272
2022112503380	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.46	10,382,017
2022112403208	BO	USDMXN	dic-22	533,500	19.48	(10,390,616)
2022112403308	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.48	10,395,194
2022112303546	BO	USDMXN	dic-22	1,067,000	19.49	(20,798,122)
2022112303514	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.50	10,404,317
2022112303515	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.50	10,403,090
2022112203323	B	USDMXN	dic-22	533,500	19.57	(10,439,002)
2022112203285	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.62	10,466,203
2022111803698	B	USDMXN	dic-22	1,067,000	19.56	(20,872,472)
2022111803332	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.62	10,465,029
2022111803333	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.62	10,467,270
2022111703532	B	USDMXN	dic-22	1,067,000	19.58	(20,887,035)
2022111703522	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.59	10,452,545
2022111703523	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.56	10,436,007
2022111603290	B	USDMXN	dic-22	533,500	19.47	(10,387,026)
2022111603491	BO	USDMXN	dic-22	533,500	19.46	(10,382,827)
2022111603276	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.46	10,383,350
2022111603503	SON	USDMXN	dic-22	(533,500)	19.47	10,387,085
2022111003652	B	USDMXN	dic-22	100,000	19.50	(1,950,425)
2022111003682	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.61	980,500
2022111003683	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	19.65	982,500
2022110403378	B	USDMXN	dic-22	500,000	19.73	(9,863,667)
2022110303428	B	USDMXN	dic-22	2,000,000	19.87	(39,740,166)
2022110103226	B	USDMXN	dic-22	2,000,000	19.95	(39,906,765)
2022102703008	B	USDMXN	dic-22	452,303	20.13	(9,105,356)
2022100403176	B	USDMXN	dic-22	250,000	20.29	(5,073,146)
2022100403104	SO	USDMXN	dic-22	(250,000)	20.38	5,095,000
2022082603033	BO	USDMXN	dic-22	2,000,000	20.39	(40,771,797)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022082603518	BO	USDMXN	dic-22	146,000	20.48	(2,990,361)
2022082603066	SO	USDMXN	dic-22	(2,452,303)	20.39	50,000,000
2022082603344	SO	USDMXN	dic-22	(146,000)	20.41	2,979,568
2022082403551	BO	USDMXN	dic-22	222,000	20.41	(4,530,135)
2022081003203	BO	USDMXN	dic-22	50,000	20.46	(1,023,198)
2022081003619	BO	USDMXN	dic-22	200,000	20.56	(4,112,062)
2022081003665	BO	USDMXN	dic-22	25,000	20.54	(513,590)
2022081003260	SO	USDMXN	dic-22	(50,000)	20.38	1,019,125
2022081003734	SO	USDMXN	dic-22	(200,000)	20.58	4,115,600
2022081003774	SO	USDMXN	dic-22	(25,000)	20.60	514,878
2022062403183	BO	USDMXN	dic-22	100,000	20.62	(2,061,674)
2022062403243	SO	USDMXN	dic-22	(100,000)	20.70	2,069,550
2022030703244	SO	USDMXN	dic-22	(75,000)	22.31	1,673,352
2022030703049	BO	USDMXN	dic-22	75,000	22.02	(1,651,433)
2022010303082	B	USDMXN	dic-22	108,000	22.02	(2,377,733)
2021122903523	SO	USDMXN	dic-22	(108,000)	22.12	2,389,176
2021112503076	SO	USDMXN	dic-22	(65,000)	23.09	1,501,106
2021112503156	BO	USDMXN	dic-22	65,000	22.52	(1,463,904)
2021092103441	S	USDMXN	dic-22	(105,000)	21.56	2,263,912
2021092103583	BO	USDMXN	dic-22	105,000	21.56	(2,264,115)

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2095893	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095894	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095919	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095921	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095922	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097591	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097593	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097594	FX	2,518	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097611	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097613	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097614	FX	2,518	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098615	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098624	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2090437	FX	1,100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090438	FX	1,100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090439	FX	80,326	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090569	FX	987,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090570	FX	987,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090571	FX	72,074	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090761	FX	103,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090762	FX	103,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090763	FX	7,521	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090953	FX	10,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090954	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090955	FX	730	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091733	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091734	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091735	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091817	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091818	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091819	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093810	FX	115,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093811	FX	115,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093812	FX	7,831	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093906	FX	125,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093907	FX	125,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093908	FX	8,512	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094002	FX	10,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094003	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094004	FX	681	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094354	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094355	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094356	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094442	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094443	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094444	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095213	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095214	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095215	FX	8,010	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095293	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095294	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095295	FX	8,010	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095720	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095721	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095722	FX	7,035	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095792	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095793	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095794	FX	7,035	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096474	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096475	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096476	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096582	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096583	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096584	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096953	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096954	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096955	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096977	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096978	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096979	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097002	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097003	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097004	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097074	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097075	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097076	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092927	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2092928	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092929	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093161	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093162	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093163	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095934	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095936	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095958	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095960	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096006	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096008	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096030	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096032	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096150	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096152	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096246	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096248	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096294	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096296	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096318	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096320	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096682	FX	450,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096683	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096706	FX	450,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096707	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096762	FX	150,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096763	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096798	FX	150,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096799	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089759	FX	800,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089760	FX	800,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089761	FX	39,332	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089783	FX	800,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089784	FX	800,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089785	FX	39,332	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089807	FX	150,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089808	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089809	FX	7,160	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089835	FX	150,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089836	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089837	FX	7,160	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091101	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091102	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091103	FX	9,855	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091137	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091138	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091139	FX	9,855	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091198	FX	400,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091199	FX	400,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091234	FX	400,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091235	FX	400,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092018	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092019	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092022	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092023	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092271	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092272	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092273	FX	12,651	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092295	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092296	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092297	FX	12,651	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092408	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092409	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092481	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2092482	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092483	FX	15,256	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092745	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092746	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092747	FX	15,256	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092882	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092883	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094218	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094219	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094220	FX	3,827	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094266	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094267	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094268	FX	3,827	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097868	FX	700,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097869	FX	700,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097870	FX	24,927	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097892	FX	700,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097893	FX	700,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097894	FX	24,927	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095061	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095062	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095063	FX	2,370	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095109	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095110	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095111	FX	2,370	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095403	FX	3,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095405	FX	3,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095406	FX	3,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095408	FX	3,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097378	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097379	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097380	FX	38,741	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097402	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097403	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097404	FX	38,741	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090441	FX	1,100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090442	FX	1,100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090443	FX	80,326	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090573	FX	987,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090574	FX	987,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090575	FX	72,074	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090765	FX	103,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090766	FX	103,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090767	FX	7,521	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090957	FX	10,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090958	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090959	FX	730	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091737	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091738	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091739	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091821	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091822	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091823	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094358	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094359	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094360	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094446	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094447	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094448	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095217	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095218	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095219	FX	8,010	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095297	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095298	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2095299	FX	8,010	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095724	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095725	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095726	FX	7,035	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095796	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095797	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095798	FX	7,035	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096478	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096479	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096480	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096586	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096587	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096588	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096926	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096927	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096928	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096935	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096936	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096937	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096956	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096957	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096958	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096980	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096981	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096982	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097006	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097007	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097008	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097078	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097079	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097080	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093814	FX	115,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093815	FX	115,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093816	FX	7,831	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093910	FX	125,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093911	FX	125,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093912	FX	8,512	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094006	FX	10,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094007	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094008	FX	681	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092930	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092931	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092932	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093164	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093165	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093166	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096685	FX	450,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096686	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096709	FX	450,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096710	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096765	FX	150,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096766	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096801	FX	150,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096802	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097945	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097946	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097947	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097978	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097979	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097980	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091497	FX	600,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091498	FX	600,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091499	FX	29,135	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091521	FX	600,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2091522	FX	600,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091523	FX	29,135	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092485	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092486	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092487	FX	15,256	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092749	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092750	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092751	FX	15,256	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095348	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095350	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095351	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095353	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095355	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095357	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095358	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095360	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095361	FX	600,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095363	FX	600,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095364	FX	600,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095366	FX	600,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095415	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095417	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095418	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095420	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096175	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096177	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096178	FX	4,965	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096211	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096213	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096214	FX	4,965	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096728	FX	1,500,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096729	FX	1,500,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096730	FX	56,068	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096744	FX	1,500,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096745	FX	1,500,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096746	FX	56,068	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096832	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096833	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096834	FX	2,198	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096856	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096857	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096858	FX	2,198	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096880	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096881	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096882	FX	2,332	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096904	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096905	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096906	FX	2,332	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086399	FX	102,940	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086421	FX	102,940	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086652	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086654	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086655	FX	2,183	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086692	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086694	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086695	FX	2,183	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088217	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088229	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092059	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092060	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092061	FX	2,110	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092083	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092084	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092085	FX	2,110	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2093339	FX	35,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093344	FX	35,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095064	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095066	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095067	FX	2,370	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095112	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095114	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095115	FX	2,370	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096426	FX	300,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096427	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096428	FX	13,846	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096534	FX	300,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096535	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096536	FX	13,846	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085712	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085752	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088755	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088757	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088758	FX	5,140	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088779	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088781	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088782	FX	5,140	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089855	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089856	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089873	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089874	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090482	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090483	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090500	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090501	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090445	FX	1,100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090446	FX	1,100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090447	FX	80,326	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090577	FX	987,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090578	FX	987,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090579	FX	72,074	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090769	FX	103,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090770	FX	103,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090771	FX	7,521	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090961	FX	10,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090962	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090963	FX	730	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091741	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091742	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091743	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091825	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091826	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091827	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093818	FX	115,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093819	FX	115,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093820	FX	7,831	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093914	FX	125,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093915	FX	125,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093916	FX	8,512	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094010	FX	10,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094011	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094012	FX	681	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094362	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094363	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094364	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094450	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094451	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094452	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095221	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2095222	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095223	FX	8,010	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095301	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095302	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095303	FX	8,010	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095728	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095729	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095730	FX	7,035	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095800	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095801	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095802	FX	7,035	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096482	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096483	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096484	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096590	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096591	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096592	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096959	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096960	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096961	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096983	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096984	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096985	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097010	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097011	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097012	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097082	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097083	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097084	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098102	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098103	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098104	FX	3,575	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098158	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098159	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098160	FX	3,575	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092933	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092934	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092935	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093167	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093168	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093169	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095937	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095939	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095961	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095963	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096009	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096011	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096033	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096035	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096153	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096155	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096249	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096251	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096297	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096299	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096321	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096323	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096688	FX	450,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096689	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096712	FX	450,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096713	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096768	FX	150,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096769	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096804	FX	150,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2096805	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097948	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097949	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097950	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097981	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097982	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097983	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092489	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092490	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092491	FX	15,256	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092753	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092754	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092755	FX	15,256	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096356	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096357	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096358	FX	44,231	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096380	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096381	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096382	FX	44,231	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076649	FX	190,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076650	FX	190,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076671	FX	190,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076672	FX	190,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093340	FX	35,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093345	FX	35,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095068	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095070	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095071	FX	2,370	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095116	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095118	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095119	FX	2,370	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086320	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086321	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086322	FX	10,949	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086347	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086348	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086349	FX	10,949	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086836	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086838	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086839	FX	8,920	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086876	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086878	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086879	FX	8,920	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087036	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087038	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087039	FX	2,230	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087076	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087078	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087079	FX	2,230	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087929	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087931	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087932	FX	10,952	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087961	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087963	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087964	FX	10,952	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089071	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089073	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089074	FX	9,976	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089099	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089101	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089102	FX	9,976	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089143	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089157	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090449	FX	1,100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2090450	FX	1,100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090451	FX	80,326	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090581	FX	987,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090582	FX	987,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090583	FX	72,074	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090773	FX	103,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090774	FX	103,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090775	FX	7,521	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090965	FX	10,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090966	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090967	FX	730	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091745	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091746	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091747	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091829	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091830	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091831	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092323	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092324	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092325	FX	4,567	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092347	FX	300,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092348	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092349	FX	13,702	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092371	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092372	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092373	FX	4,567	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092395	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092396	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092397	FX	4,567	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093822	FX	115,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093823	FX	115,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093824	FX	7,831	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093918	FX	125,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093919	FX	125,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093920	FX	8,512	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094014	FX	10,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094015	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094016	FX	681	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094366	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094367	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094368	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094454	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094455	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094456	FX	6,030	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095225	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095226	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095227	FX	8,010	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095305	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095306	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095307	FX	8,010	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095732	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095733	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095734	FX	7,035	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095804	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095805	FX	100,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095806	FX	7,035	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096485	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096487	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096488	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096593	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096595	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096596	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096962	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096963	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2096964	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096986	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096987	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096988	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097014	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097015	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097016	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097086	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097087	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097088	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098105	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098107	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098108	FX	3,575	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098161	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098163	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098164	FX	3,575	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084989	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085037	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085085	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085133	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087474	FX	800,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087476	FX	800,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087477	FX	39,437	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087514	FX	800,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087516	FX	800,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087517	FX	39,437	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092936	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092937	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092938	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093170	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093171	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093172	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096690	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096692	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096714	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096716	FX	450,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096770	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096772	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096806	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096808	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097951	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097952	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097953	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097984	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097985	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097986	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098213	FX	566,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098215	FX	566,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098216	FX	566,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098218	FX	566,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090110	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED
2092449	FX	300,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092450	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092451	FX	13,188	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092473	FX	300,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092474	FX	300,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092475	FX	13,188	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092493	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092494	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092495	FX	15,256	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092757	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092758	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092759	FX	15,256	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093213	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2093214	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093215	FX	11,220	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093237	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093238	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093239	FX	11,220	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094669	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094670	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094671	FX	43,246	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094693	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094694	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094695	FX	43,246	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094731	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094732	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094733	FX	11,529	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094755	FX	250,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094756	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094757	FX	11,529	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095354	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED
2096642	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096643	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096644	FX	8,792	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096658	FX	200,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096659	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096660	FX	8,792	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091872	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091874	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091875	FX	1,071	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091896	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091898	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091899	FX	1,071	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093341	FX	35,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093346	FX	35,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093523	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093525	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093526	FX	9,852	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093547	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093549	FX	250,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093550	FX	9,852	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094045	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094047	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094048	FX	924	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094069	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094071	FX	25,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094072	FX	924	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094173	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094175	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094176	FX	8,079	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094197	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094199	FX	200,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094200	FX	8,079	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094578	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094614	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095072	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095074	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095075	FX	2,370	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095120	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095122	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095123	FX	2,370	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095153	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095177	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097497	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097499	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097500	FX	6,145	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097521	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2097523	FX	150,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097524	FX	6,145	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097679	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097681	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097682	FX	4,327	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097703	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097705	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097706	FX	4,327	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098018	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098042	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089714	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089716	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089732	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089734	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093284	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093286	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093296	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093298	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093503	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093504	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093505	FX	1,000,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093506	FX	1,000,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090452	FX	1,100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090454	FX	1,100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090455	FX	80,326	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090584	FX	987,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090586	FX	987,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090587	FX	72,074	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090776	FX	103,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090778	FX	103,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090779	FX	7,521	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090968	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090970	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090971	FX	730	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090997	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090999	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091015	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091017	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091749	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091833	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093826	FX	115,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093827	FX	115,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093828	FX	7,831	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093922	FX	125,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093923	FX	125,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093924	FX	8,512	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094018	FX	10,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094019	FX	10,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094020	FX	681	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094370	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094458	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095229	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095309	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095940	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095942	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095964	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095966	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096012	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096014	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096036	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096038	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096156	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096158	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096252	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2096254	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096300	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096302	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096324	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096326	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096489	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096491	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096492	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096597	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096599	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096600	FX	1,812	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097017	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097019	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097020	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097089	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097091	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097092	FX	1,937	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097954	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097955	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097956	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097987	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097988	FX	50,000	oct-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097989	FX	50,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098109	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098111	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098112	FX	3,575	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098165	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098167	FX	100,000	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098168	FX	3,575	oct-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092496	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092498	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092499	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092760	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092762	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092763	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092939	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092941	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093173	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093175	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095736	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095808	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096693	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096695	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096717	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096719	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096773	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096775	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096809	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096811	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097871	FX	700,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097873	FX	700,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097874	FX	24,927	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097895	FX	700,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097897	FX	700,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097898	FX	24,927	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091104	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091106	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091107	FX	9,855	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091140	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091142	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091143	FX	9,855	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091200	FX	400,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091201	FX	400,000	nov-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091236	FX	400,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2091237	FX	400,000	nov-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092274	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092276	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092277	FX	12,651	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092298	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092300	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092301	FX	12,651	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092410	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092411	FX	250,000	nov-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092884	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092885	FX	250,000	nov-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095076	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095078	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095079	FX	2,370	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095124	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095126	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095127	FX	2,370	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096405	FX	35,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096413	FX	35,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085714	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085754	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090456	FX	1,100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090458	FX	1,100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090459	FX	80,326	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090588	FX	987,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090590	FX	987,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090591	FX	72,074	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090780	FX	103,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090782	FX	103,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090783	FX	7,521	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090972	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090974	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090975	FX	730	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094374	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094462	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095233	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095313	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095740	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095812	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096493	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096495	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096496	FX	1,812	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096601	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096603	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096604	FX	1,812	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097021	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097023	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097024	FX	1,937	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097093	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097095	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097096	FX	1,937	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097277	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097279	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097280	FX	2,512	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097309	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097311	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097312	FX	5,024	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097341	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097343	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097344	FX	2,512	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097421	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097423	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097445	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097447	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2097469	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097471	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097541	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097543	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097544	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097546	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098113	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098115	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098116	FX	3,575	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098169	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098171	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098172	FX	3,575	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099752	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099754	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099755	FX	82,374	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099784	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099786	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099787	FX	82,374	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099816	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099818	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099819	FX	6,315	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099848	FX	126,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099850	FX	126,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099851	FX	6,919	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099880	FX	11,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099882	FX	11,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099883	FX	604	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089810	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089812	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089813	FX	7,160	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089838	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089840	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089841	FX	7,160	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092942	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092944	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093176	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093178	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093829	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093831	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093832	FX	7,831	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093925	FX	125,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093927	FX	125,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093928	FX	8,512	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094021	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094023	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094024	FX	681	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094222	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094270	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095409	FX	3,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095411	FX	3,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095412	FX	3,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095414	FX	3,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096359	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096361	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096362	FX	44,231	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096383	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096385	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096386	FX	44,231	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096696	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096698	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096720	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096722	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096776	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096778	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2096812	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096814	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096929	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096931	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096938	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096940	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097957	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097959	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097990	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097992	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092500	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092502	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092503	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092764	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092766	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092767	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095080	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095082	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095083	FX	2,370	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095128	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095130	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095131	FX	2,370	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096406	FX	35,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096414	FX	35,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086400	FX	28,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086422	FX	28,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091560	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091562	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091566	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091568	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096179	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096181	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096182	FX	4,965	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096215	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096217	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096218	FX	4,965	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096429	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096431	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096432	FX	13,846	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096537	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096539	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096540	FX	13,846	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096835	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096837	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096838	FX	2,198	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096859	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096861	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096862	FX	2,198	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096883	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096885	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096886	FX	2,332	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096907	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096909	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096910	FX	2,332	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099632	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099644	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088219	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088231	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088759	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088761	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088762	FX	5,140	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088783	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088785	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088786	FX	5,140	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2089857	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089859	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089875	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089877	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090460	FX	1,100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090462	FX	1,100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090463	FX	80,326	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090592	FX	987,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090594	FX	987,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090595	FX	72,074	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090784	FX	103,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090786	FX	103,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090787	FX	7,521	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090976	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090978	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090979	FX	730	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092326	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092328	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092329	FX	4,567	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092350	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092352	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092353	FX	13,702	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092374	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092376	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092377	FX	4,567	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092398	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092400	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092401	FX	4,567	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094378	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094466	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095237	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095317	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095744	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095816	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096497	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096499	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096500	FX	1,812	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096605	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096607	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096608	FX	1,812	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097025	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097027	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097028	FX	1,937	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097097	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097099	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097100	FX	1,937	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098117	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098119	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098120	FX	3,575	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098173	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098175	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098176	FX	3,575	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099756	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099758	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099759	FX	82,374	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099788	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099790	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099791	FX	82,374	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099820	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099822	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099823	FX	6,315	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099852	FX	126,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099854	FX	126,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099855	FX	6,919	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2099884	FX	11,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099886	FX	11,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099887	FX	604	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084993	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085041	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085089	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085137	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086656	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086658	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086659	FX	2,183	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086696	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086698	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086699	FX	2,183	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092062	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092064	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092065	FX	2,110	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092086	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092088	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092089	FX	2,110	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092945	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092947	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093179	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093181	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093833	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093835	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093836	FX	7,831	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093929	FX	125,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093931	FX	125,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093932	FX	8,512	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094025	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094027	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094028	FX	681	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095943	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095945	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095967	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095969	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096015	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096017	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096039	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096041	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096159	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096161	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096255	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096257	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096303	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096305	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096327	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096329	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096779	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096781	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096815	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096817	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097960	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097962	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097993	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097995	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086352	FX	203,622	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086353	FX	203,622	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086356	FX	203,622	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086357	FX	203,622	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092504	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092506	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092507	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092768	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2092770	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092771	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096731	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096733	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096734	FX	56,068	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096747	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096749	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096750	FX	56,068	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085716	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085756	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095084	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095086	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095087	FX	2,370	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095132	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095134	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095135	FX	2,370	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096407	FX	35,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096415	FX	35,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076651	FX	190,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076652	FX	190,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076673	FX	190,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076674	FX	190,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090464	FX	1,100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090466	FX	1,100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090467	FX	80,326	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090596	FX	987,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090598	FX	987,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090599	FX	72,074	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090788	FX	103,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090790	FX	103,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090791	FX	7,521	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090980	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090982	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090983	FX	730	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094382	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094470	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095241	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095321	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095748	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095820	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096501	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096503	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096504	FX	1,812	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096609	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096611	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096612	FX	1,812	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097029	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097031	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097032	FX	1,937	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097101	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097103	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097104	FX	1,937	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097281	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097283	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097284	FX	2,512	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097313	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097315	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097316	FX	5,024	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097345	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097347	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097348	FX	2,512	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097424	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097426	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097448	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2097450	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097472	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097474	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098121	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098123	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098124	FX	3,575	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098177	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098179	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098180	FX	3,575	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099760	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099762	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099763	FX	82,374	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099792	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099794	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099795	FX	82,374	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099824	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099826	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099827	FX	6,315	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099856	FX	126,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099858	FX	126,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099859	FX	6,919	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099888	FX	11,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099890	FX	11,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099891	FX	604	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086840	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086842	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086843	FX	8,920	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086880	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086882	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086883	FX	8,920	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087040	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087042	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087043	FX	2,230	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087080	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087082	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087083	FX	2,230	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087478	FX	800,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087480	FX	800,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087481	FX	39,437	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087518	FX	800,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087520	FX	800,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087521	FX	39,437	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090484	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090486	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090502	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090504	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092452	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092454	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092455	FX	13,188	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092476	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092478	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092479	FX	13,188	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092508	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092510	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092511	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092772	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092774	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092775	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092948	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092950	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093182	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093184	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096782	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096784	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2096818	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096820	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097381	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097383	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097384	FX	38,741	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097405	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097407	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097408	FX	38,741	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097963	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097965	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097996	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097998	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095088	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095090	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095091	FX	2,370	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095136	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095138	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095139	FX	2,370	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096408	FX	35,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096416	FX	35,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098085	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098087	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098088	FX	46,711	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098093	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098095	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098096	FX	46,711	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093216	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093218	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093219	FX	11,220	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093240	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093242	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093243	FX	11,220	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094734	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094736	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094737	FX	11,529	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094758	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094760	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094761	FX	11,529	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096645	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096647	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096648	FX	8,792	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096661	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096663	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096664	FX	8,792	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090468	FX	1,100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090470	FX	1,100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090471	FX	80,326	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090600	FX	987,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090602	FX	987,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090603	FX	72,074	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090792	FX	103,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090794	FX	103,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090795	FX	7,521	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090984	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090986	FX	10,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090987	FX	730	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093527	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093529	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093530	FX	9,852	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093551	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093553	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093554	FX	9,852	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094049	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094051	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2094052	FX	924	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094073	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094075	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094076	FX	924	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094177	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094179	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094180	FX	8,079	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094201	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094203	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094204	FX	8,079	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094386	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094474	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094582	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094618	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094672	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094674	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094675	FX	43,246	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094696	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094698	FX	1,000,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094699	FX	43,246	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095157	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095181	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095245	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095325	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095752	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095824	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096505	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096507	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096508	FX	1,812	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096613	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096615	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096616	FX	1,812	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097033	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097035	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097036	FX	1,937	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097105	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097107	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097108	FX	1,937	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097133	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097135	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097136	FX	870	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097157	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097159	FX	25,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097160	FX	870	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097501	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097503	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097504	FX	6,145	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097525	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097527	FX	150,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097528	FX	6,145	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097683	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097685	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097686	FX	4,327	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097707	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097709	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097710	FX	4,327	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098022	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098046	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098125	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098127	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098128	FX	3,575	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098181	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098183	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098184	FX	3,575	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2098657	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098659	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098660	FX	13,478	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098677	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098679	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098680	FX	13,478	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098697	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098707	FX	300,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099764	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099766	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099767	FX	82,374	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099796	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099798	FX	1,500,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099799	FX	82,374	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099828	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099830	FX	115,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099831	FX	6,315	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099860	FX	126,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099862	FX	126,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099863	FX	6,919	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099892	FX	11,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099894	FX	11,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099895	FX	604	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089717	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089719	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089735	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089737	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092951	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092953	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093185	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093187	FX	250,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093287	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093289	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093299	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093301	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095946	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095948	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095970	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095972	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096018	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096020	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096042	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096044	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096162	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096164	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096258	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096260	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096306	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096308	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096330	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096332	FX	100,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096785	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096787	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096821	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096823	FX	450,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097966	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097968	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097999	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098001	FX	50,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092512	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092514	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092515	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092776	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092778	FX	200,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2092779	FX	15,256	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097875	FX	700,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097877	FX	700,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097878	FX	24,927	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097899	FX	700,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097901	FX	700,000	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097902	FX	24,927	nov-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095875	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095877	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095878	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095903	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095905	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095906	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096409	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096417	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099634	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099646	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088235	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088247	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098065	FX	1,800,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098069	FX	1,800,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091000	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091002	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091018	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091020	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091109	FX	200,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091110	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091111	FX	9,855	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091145	FX	200,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091146	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091147	FX	9,855	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091202	FX	400,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091238	FX	400,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092279	FX	250,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092280	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092281	FX	12,651	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092303	FX	250,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092304	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092305	FX	12,651	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092412	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092886	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095249	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095329	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095756	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095828	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096509	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096511	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096512	FX	1,812	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096617	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096619	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096620	FX	1,812	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097037	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097039	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097040	FX	1,937	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097109	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097111	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097112	FX	1,937	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097285	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097287	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097288	FX	2,512	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097317	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097319	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097320	FX	5,024	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097349	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2097351	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097352	FX	2,512	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097427	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097429	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097451	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097453	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097475	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097477	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097724	FX	110,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097725	FX	110,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097726	FX	6,914	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097772	FX	10,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097773	FX	10,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097774	FX	629	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097820	FX	120,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097821	FX	120,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097822	FX	7,543	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098129	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098131	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098132	FX	3,575	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098185	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098187	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098188	FX	3,575	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099769	FX	1,500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099770	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099771	FX	82,374	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099801	FX	1,500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099802	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099803	FX	82,374	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099833	FX	115,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099834	FX	115,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099835	FX	6,315	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099865	FX	126,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099866	FX	126,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099867	FX	6,919	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099897	FX	11,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099898	FX	11,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099899	FX	604	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100057	FX	13,000,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100058	FX	13,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100059	FX	841,905	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100065	FX	13,000,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100066	FX	13,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100067	FX	841,905	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092954	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092955	FX	250,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092956	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093188	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093189	FX	250,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093190	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096788	FX	450,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096790	FX	450,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096824	FX	450,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096826	FX	450,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097969	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097970	FX	50,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097971	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098002	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098003	FX	50,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098004	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092516	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092518	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092519	FX	15,256	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092780	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2092782	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092783	FX	15,256	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094226	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094227	FX	50,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094228	FX	3,827	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094274	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094275	FX	50,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094276	FX	3,827	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096339	FX	3,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096341	FX	3,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096342	FX	3,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096344	FX	3,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096363	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096365	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096366	FX	44,231	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096387	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096389	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096390	FX	44,231	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095879	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095881	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095882	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095907	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095909	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095910	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096410	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096418	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098067	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098068	FX	1,500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098071	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098072	FX	1,500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095253	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095333	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095760	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095832	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096513	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096515	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096516	FX	1,812	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096621	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096623	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096624	FX	1,812	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097041	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097043	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097044	FX	1,937	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097113	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097115	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097116	FX	1,937	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097728	FX	110,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097729	FX	110,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097730	FX	6,914	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097776	FX	10,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097777	FX	10,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097778	FX	629	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097824	FX	120,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097825	FX	120,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097826	FX	7,543	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098133	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098135	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098136	FX	3,575	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098189	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098191	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098192	FX	3,575	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099773	FX	1,500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099774	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099775	FX	82,374	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2099805	FX	1,500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099806	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099807	FX	82,374	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099837	FX	115,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099838	FX	115,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099839	FX	6,315	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099869	FX	126,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099870	FX	126,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099871	FX	6,919	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099901	FX	11,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099902	FX	11,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099903	FX	604	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086401	FX	33,160	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086423	FX	33,160	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090487	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090489	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090505	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090507	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091563	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091565	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091569	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091571	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092957	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092959	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093191	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093193	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095949	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095951	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095973	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095975	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096021	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096023	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096045	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096047	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096165	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096167	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096183	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096185	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096186	FX	4,965	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096219	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096221	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096222	FX	4,965	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096261	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096263	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096309	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096311	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096333	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096335	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096433	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096435	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096436	FX	13,846	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096541	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096543	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096544	FX	13,846	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096839	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096841	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096842	FX	2,198	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096863	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096865	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096866	FX	2,198	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096887	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096889	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096890	FX	2,332	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096911	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2096913	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096914	FX	2,332	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097137	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097139	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097140	FX	870	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097161	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097163	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097164	FX	870	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097972	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097974	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098005	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098007	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086660	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086662	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086663	FX	2,183	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086700	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086702	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086703	FX	2,183	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088221	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088233	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092520	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092522	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092523	FX	15,256	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092784	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092786	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092787	FX	15,256	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096735	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096737	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096738	FX	56,068	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096751	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096753	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096754	FX	56,068	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095883	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095885	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095886	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095911	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095913	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095914	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096411	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096419	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099636	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099648	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100244	FX	500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100245	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100295	FX	500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100296	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088237	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088249	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099657	FX	100,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099658	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099659	FX	3,951	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099669	FX	100,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099670	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099671	FX	3,951	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096517	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096519	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096520	FX	1,812	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096625	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096627	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096628	FX	1,812	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097045	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097047	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097048	FX	1,937	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097117	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2097119	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097120	FX	1,937	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097289	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097291	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097292	FX	2,512	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097321	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097323	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097324	FX	5,024	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097353	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097355	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097356	FX	2,512	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097430	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097432	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097454	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097456	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097478	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097480	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097732	FX	110,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097733	FX	110,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097734	FX	6,914	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097780	FX	10,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097781	FX	10,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097782	FX	629	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097828	FX	120,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097829	FX	120,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097830	FX	7,543	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098137	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098139	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098140	FX	3,575	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098193	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098195	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098196	FX	3,575	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099777	FX	1,500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099778	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099779	FX	82,374	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099809	FX	1,500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099810	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099811	FX	82,374	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099841	FX	115,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099842	FX	115,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099843	FX	6,315	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099873	FX	126,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099874	FX	126,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099875	FX	6,919	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099905	FX	11,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099906	FX	11,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099907	FX	604	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086844	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086846	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086847	FX	8,920	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086884	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086886	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086887	FX	8,920	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087044	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087046	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087047	FX	2,230	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087084	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087086	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087087	FX	2,230	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092960	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092961	FX	250,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092962	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093194	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093195	FX	250,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2093196	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097975	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097976	FX	50,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097977	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098008	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098009	FX	50,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098010	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076653	FX	190,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076654	FX	190,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076675	FX	190,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076676	FX	190,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092524	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092526	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092527	FX	15,256	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092788	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092790	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092791	FX	15,256	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097385	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097387	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097388	FX	38,741	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097409	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097411	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097412	FX	38,741	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100246	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100247	FX	500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100248	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100264	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100265	FX	500,000	dic-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2100266	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095887	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095889	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095890	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095915	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095917	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095918	FX	2,029	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096412	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096420	FX	35,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097587	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097589	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097590	FX	2,518	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097607	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097609	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097610	FX	2,518	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098089	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098091	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098092	FX	46,711	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098097	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098099	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098100	FX	46,711	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096521	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096523	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096524	FX	1,812	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096629	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096631	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096632	FX	1,812	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097049	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097051	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097052	FX	1,937	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097121	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097123	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097124	FX	1,937	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097735	FX	110,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097737	FX	110,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097738	FX	6,914	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2097783	FX	10,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097785	FX	10,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097786	FX	629	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097831	FX	120,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097833	FX	120,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097834	FX	7,543	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098141	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098143	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098144	FX	3,575	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098197	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098199	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098200	FX	3,575	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099780	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099782	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099783	FX	82,374	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099812	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099814	FX	1,500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099815	FX	82,374	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099844	FX	115,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099846	FX	115,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099847	FX	6,315	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099876	FX	126,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099878	FX	126,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099879	FX	6,919	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099908	FX	11,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099910	FX	11,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099911	FX	604	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087482	FX	800,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087484	FX	800,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087485	FX	39,437	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087522	FX	800,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087524	FX	800,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087525	FX	39,437	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092963	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092965	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093197	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093199	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093220	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093222	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093223	FX	11,220	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093244	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093246	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093247	FX	11,220	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094738	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094740	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094741	FX	11,529	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094762	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094764	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094765	FX	11,529	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095952	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095954	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095976	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095978	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096024	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096026	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096048	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096050	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096168	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096170	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096264	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096266	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096312	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096314	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096336	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2096338	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096649	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096651	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096652	FX	8,792	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096665	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096667	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2096668	FX	8,792	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097141	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097143	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097144	FX	870	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097165	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097167	FX	25,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097168	FX	870	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092528	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092530	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092531	FX	15,256	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092792	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092794	FX	200,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092795	FX	15,256	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094586	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094622	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094676	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094678	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094679	FX	43,246	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094700	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094702	FX	1,000,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094703	FX	43,246	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095161	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095185	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097505	FX	150,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097507	FX	150,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097508	FX	6,145	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097529	FX	150,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097531	FX	150,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097532	FX	6,145	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097687	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097689	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097690	FX	4,327	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097711	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097713	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2097714	FX	4,327	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098026	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098050	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098073	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098075	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098076	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098078	FX	500,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098661	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098663	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098664	FX	13,478	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098681	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098683	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098684	FX	13,478	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098699	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2098709	FX	300,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099638	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2099650	FX	100,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093555	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093557	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093558	FX	21,163	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093643	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093645	FX	250,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093646	FX	21,163	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2095891	FX	50,000	dic-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

## Liquidados anticipadamente

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlD	Option Notional
E81344	Eq Option	oct-22	Buy	U	mxn					20,500,000
E81383	Eq Option	oct-22	Sell	U	mxn					20,500,000
E81338	Eq Option	nov-22	Buy	U	mxn					65,820,000
E81363	Eq Option	nov-22	Buy	U	mxn					65,820,000
E81364	Eq Option	nov-22	Sell	U	mxn					65,820,000
E81365	Eq Option	nov-22	Sell	U	mxn					65,820,000
SDT217	SC Swap	dic-22	Buy	U	mxn	69,180,000	mxn	69,180,000	mxn	
SDT225	SC Swap	dic-22	Buy	U	mxn	68,364,000	mxn	68,364,000	mxn	
SDT233	SC Swap	dic-22	Buy	U	mxn	16,622,000	mxn	16,622,000	mxn	
E81355	Eq Option	dic-22	Buy	U	mxn					62,480,000
E81411	Eq Option	dic-22	Sell	U	mxn					62,480,000
SDU820	SC Swap	dic-22	Buy	U	mxn	63,916,667	mxn	63,916,667	mxn	
SDU848	SC Swap	dic-22	Buy	U	mxn	63,916,667	mxn	63,916,667	mxn	
SDV595	SC Swap	dic-22	Buy	U	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SDV991	SC Swap	dic-22	Buy	U	mxn	5,390,000,000	mxn	5,390,000,000	mxn	
SHM546	SC Swap	ene-23	Buy	U	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
C67387	SC Swap	ene-23	Buy	U	usd	2,120,139	usd	51,413,371	mxn	
C67391	CC Swap	ene-23	Buy	U	usd	51,413,371	mxn	2,120,139	usd	
E81362	Eq Option	feb-23	Buy	U	mxn					7,230,000
E81422	Eq Option	feb-23	Sell	U	mxn					7,230,000
SER797	SC Swap	feb-23	Buy	U	mxn	116,073,413	mxn	116,073,413	mxn	
SDT565	SC Swap	mar-23	Buy	U	mxn	570,000,000	mxn	570,000,000	mxn	
SDW052	SC Swap	mar-23	Buy	U	mxn	570,000,000	mxn	570,000,000	mxn	
E81369	Eq Option	mar-23	Buy	U	mxn					646,391,000
E81370	Eq Option	mar-23	Sell	U	mxn					646,391,000
E81371	Eq Option	mar-23	Sell	U	mxn					646,391,000
SDW511	SC Swap	abr-23	Buy	U	mxn	24,606,766	mxn	24,606,766	mxn	
SDV306	SC Swap	abr-23	Buy	U	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
E81499	Eq Option	may-23	Buy	U	mxn					730,470,000
E81500	Eq Option	may-23	Sell	U	mxn					730,470,000
E81501	Eq Option	may-23	Sell	U	mxn					730,470,000
E81502	Eq Option	may-23	Buy	U	mxn					730,470,000
SGX752	SC Swap	dic-23	Buy	U	mxn	3,470,590	mxn	3,470,590	mxn	
SGX797	SC Swap	dic-23	Buy	U	mxn	3,470,590	mxn	3,470,590	mxn	
E81820	Eq Option	abr-24	Buy	U	mxn					491,650,000
E81821	Eq Option	abr-24	Sell	U	mxn					491,650,000
E81822	Eq Option	abr-24	Sell	U	mxn					491,650,000
E81823	Eq Option	abr-24	Buy	U	mxn					491,650,000
SDT297	SC Swap	may-24	Buy	U	mxn	16,500,000	mxn	16,500,000	mxn	
MNF422	Term Deposit	oct-24	Buy	U	mxn			54,671,489	mxn	
SDS642	SC Swap	oct-24	Buy	U	mxn	54,671,489	mxn	54,671,489	mxn	

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
SDS643	SC Swap	oct-24	Buy	U	mxn	54,671,489	mxn	54,671,489	mxn	
SDS656	SC Swap	oct-24	Buy	U	mxn	54,671,489	mxn	54,671,489	mxn	
SDT175	SC Swap	nov-24	Buy	U	mxn	25,237,510	mxn	25,237,510	mxn	
SDS115	SC Swap	nov-24	Buy	U	mxn	9,333,344	mxn	9,333,344	mxn	
MNF431	Term Deposit	dic-24	Buy	U	usd			15,000,000	usd	
SDT337	SC Swap	dic-24	Buy	U	usd	15,000,000	usd	15,000,000	usd	
SDT342	SC Swap	dic-24	Buy	U	usd	15,000,000	usd	15,000,000	usd	
SDT352	SC Swap	dic-24	Buy	U	usd	15,000,000	usd	15,000,000	usd	
E81357	Eq Option	jun-25	Buy	U	mxn					183,800,000
E81415	Eq Option	jun-25	Sell	U	mxn					183,800,000
SDT370	SC Swap	jun-25	Buy	U	mxn	750,000,000	mxn	750,000,000	mxn	
SDT373	SC Swap	jun-25	Buy	U	mxn	750,000,000	mxn	750,000,000	mxn	
SDT597	SC Swap	jun-25	Buy	U	mxn	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	mxn	
C72551	CC Swap	sep-25	Buy	U	usd	18,300,000	usd	16,424,340	eur	
C72552	CC Swap	sep-25	Buy	U	usd	16,424,340	eur	18,300,000	usd	
SEG639	SC Swap	sep-25	Buy	U	usd	5,490,000	usd	5,490,000	usd	
SEG649	SC Swap	sep-25	Buy	U	usd	5,490,000	usd	5,490,000	usd	
P18373	Cap	sep-25	Buy	U	mxn					39,000,000
SDU367	SC Swap	oct-25	Buy	U	mxn	1,194,749,924	mxn	1,194,749,924	mxn	
SDU065	SC Swap	dic-25	Buy	U	mxn	253,000,000	mxn	253,000,000	mxn	
P18338	Cap	dic-25	Buy	U	mxn					26,000,000
SDU851	SC Swap	ene-26	Buy	U	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SDU856	SC Swap	ene-26	Buy	U	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SDV037	SC Swap	ene-26	Buy	U	mxn	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	mxn	
P17882	Cap	oct-26	Sell	U	mxn					500,000,000
P17883	Cap	oct-26	Buy	U	mxn					500,000,000
SFF690	SC Swap	oct-26	Buy	U	mxn	750,000,000	mxn	750,000,000	mxn	
SFF691	SC Swap	oct-26	Buy	U	mxn	750,000,000	mxn	750,000,000	mxn	
SDT892	SC Swap	dic-26	Buy	U	mxn	120,726,667	mxn	120,726,667	mxn	
SED497	SC Swap	dic-26	Buy	U	mxn	58,333,333	mxn	58,333,333	mxn	
SEX242	SC Swap	dic-26	Buy	U	mxn	77,777,778	mxn	77,777,778	mxn	
SGF676	SC Swap	dic-26	Buy	U	mxn	89,280,432	mxn	89,280,432	mxn	
SDS020	SC Swap	feb-27	Buy	U	usd	8,366,833	usd	8,366,833	usd	
SDS023	SC Swap	feb-27	Buy	U	usd	8,366,833	usd	8,366,833	usd	
SFF622	SC Swap	jun-27	Buy	U	mxn	2,250,000,000	mxn	2,250,000,000	mxn	
SHK585	SC Swap	jun-27	Buy	U	mxn	2,250,000,000	mxn	2,250,000,000	mxn	
SHK586	SC Swap	jun-27	Buy	U	mxn	2,250,000,000	mxn	2,250,000,000	mxn	
SHQ826	SC Swap	oct-27	Buy	U	mxn	70,000,000	mxn	70,000,000	mxn	
C79291	CC Swap	dic-27	Buy	U	usd	1,000,000,000	mxn	50,415,931	usd	
C79292	CC Swap	dic-27	Buy	U	usd	50,415,931	usd	1,000,000,000	mxn	
SHH637	SC Swap	jul-28	Buy	U	usd	171,911	usd	171,911	usd	
SHH640	SC Swap	jul-28	Buy	U	usd	171,911	usd	171,911	usd	
SFS547	SC Swap	dic-28	Buy	U	usd	6,150,000	usd	6,150,000	usd	
SFS548	SC Swap	dic-28	Buy	U	usd	6,150,000	usd	6,150,000	usd	

## 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
Caps & Floors	oct-22	Cliente 1	USD	1,406	Discrepancia Liquidación
Forwards FX	oct-22	Cliente 2	USD	135,000	No fondeo su cuenta
Forwards FX	oct-22	Cliente 3	USD	142,000	No fondeo su cuenta
Interest Rate Swap	oct-22	Cliente 4	MXN	151,278	No envio los fondos
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 5	MXN	(22,318)	No se liquida
Forwards FX	oct-22	Cliente 6	MXN	830,333	Problemas orden de pago
LLAMADA DE MARGEN	oct-22	Cliente 7	MXN	1,800,000	No envio los fondos
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 8	MXN	(15,237)	No se liquida
Interest Rate Swap		Cliente 9	MXN	(130,018)	No se liquida
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 10	MXN	(9,563)	No se liquida
Forwards FX	nov-22	Cliente 11	USD	40,000,000	No envio los fondos
Forwards FX	nov-22	Cliente 12	MXN	20,198,411	No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 13	MXN	1,623,351	No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 14	MXN	548,712	No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 15	MXN	540,556	No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 16	MXN	137,667	No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 17	MXN	131,250	No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 18	MXN	64,904	No envio los fondos
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 19	MXN	54,115	No envio los fondos
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 20	MXN	50,063	No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 21	MXN	46,823	No envio los fondos
Interest Rate Swap		Cliente 22	MXN	(408,398)	No se liquida
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 23	MXN	2,172,412	No envio los fondos
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 24	MXN	100,268	No envio los fondos
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 25	MXN	2,250,550	No envio los fondos
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 26	MXN	195,700	No envio los fondos
Forwards FX	nov-22	Cliente 27	MXN	20,272,000	No fondeo su cuenta
Equity Options		Cliente 28	MXN	31,000	No envio los fondos
Interest Rate Swap		Cliente 29	MXN	(319,098)	No se liquida
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 30	MXN	(12,627)	No se liquida
Interest Rate Swap		Cliente 31	MXN	(592,016)	No se liquida
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 32	MXN	2,172,412	No fondeo su cuenta
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 33	MXN	72,775	No fondeo su cuenta
Equity Options	dic-22	Cliente 34	MXN	5,737,346	No envio los fondos
Caps & Floors	dic-22	Cliente 35	MXN	7,150	No envio los fondos
Forwards FX	dic-22	Cliente 36	MXN	251,097	No envio los fondos
Forwards FX	dic-22	Cliente 37	MXN	93,408	No envio los fondos
Forwards FX	dic-22	Cliente 38	MXN	17,665	No envio los fondos
Caps & Floors	dic-22	Cliente 39	USD	12,008	No envio los fondos

## Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte

### Tabla I: Resumen de los 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	3,176,055,220	Compra	Divisas	Divisas	121,443,120,731	116,808,619,802	2,833,247,881	342,807,339	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	3,186,791,916	Venta	Divisas	Divisas	(121,289,567,723)	(116,581,458,142)	2,816,764,887	370,027,029	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	848,928,000	Compra	Acción	Acción	104,978,103	58,405,399	334,600,000	514,328,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	356,502,000	Venta	Acción	Acción	(97,687,145)	(52,945,984)	334,600,000	21,902,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	7,015,643,186	Compra	Divisas	Divisas	161,059,228	134,993,415	6,763,303,803	252,339,383	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	7,015,643,186	Venta	Divisas	Divisas	(150,386,353)	(127,098,631)	6,763,303,803	252,339,383	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	4,277,331,000	Compra	Índice	Índice	227,415,315	147,668,967	-	4,277,331,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Índice	Índice	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	50,273,816,882	Compra	Tasas	Tasas	1,473,790,929	1,309,831,443	3,137,695,985	44,177,765,749	2,958,355,148	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	49,518,416,078	Venta	Tasas	Tasas	(1,434,207,077)	(1,276,082,749)	3,137,695,985	43,587,557,157	2,793,162,936	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	283,188,000	Compra	Acción NE	Acción NE	11,254,486	7,226,177	-	283,188,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	283,188,000	Venta	Acción NE	Acción NE	(8,545,445)	(12,685,592)	-	283,188,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Índice NE	Índice NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	4,274,681,000	Venta	Índice NE	Índice NE	(227,391,732)	(147,667,784)	-	4,274,681,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	230,126,115	Compra	Divisas NE	Divisas NE	12,459,798	6,585,369	-	230,126,115	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	230,126,115	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(23,132,766)	(14,480,153)	-	230,126,115	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	9,737,044,042	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	656,819,876	590,517,483	-	6,607,867,762	3,129,176,279	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	4,492,603,248	CCIRS / IRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	(188,313)	447,476	3,901,780,000	450,231,073	140,592,175	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	45,181,542,925	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	2,241,577,059	1,483,043,756	-	26,559,741,946	18,621,800,979	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	42,220,000	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD	TASA DE INTERES / LIBOR USD	-	47,278,617	42,220,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	215,175,408	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	373,301,123	366,472,527	-	215,175,408	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	20,234,954,763	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	1,038,636,255	1,136,216,353	716,869,920	6,676,231,328	12,841,853,516	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	315,762,326,374	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	16,473,748,094	13,175,007,985	57,075,000,000	127,932,172,369	130,755,154,005	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	25,066,346,054	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	(1,362,669,940)	(1,122,572,783)	72,078,568	13,734,966,658	11,259,300,828	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	314,653,616,255	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	(16,711,184,384)	(13,593,278,754)	54,907,921,432	125,518,399,816	134,227,295,007	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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 2022 Y 2021

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>	750,079,867,041	0
100200001001			<b>Efectivo y equivalentes de efectivo</b>	63,880,972,463	0
100400001001			<b>Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)</b>	2,207,893,382	0
100600001001			<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>	127,270,704,159	0
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	58,582,072,631	0
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	63,972,167,551	0
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	4,716,463,977	0
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	4,716,997,382	0
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-533,405	0
101000001001			<b>Deudores por reporte</b>	3,224,493,008	0
101200001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	0	0
101400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	36,251,898,604	0
	101400102001		Con fines de negociación	30,643,914,183	0
	101400102002		Con fines de cobertura	5,607,984,421	0
101600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS</b>	-1,379,612,713	0
	101800104001		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1</b>	473,436,304,471	0
	101800105001		Créditos comerciales	254,285,978,278	0
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	221,131,990,145	0
		101800107002	Entidades financieras	17,425,787,043	0
		101800107003	Entidades gubernamentales	15,728,201,090	0
	101800105002		Créditos de consumo	32,612,124,689	0
	101800105003		Créditos a la vivienda	186,538,201,504	0
		101800507023	Media y residencial	181,032,783,419	0
		101800507024	De interés social	4,610,492	0
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	5,500,807,593	0
		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>	3,339,504,934	0
	101800205005		Créditos comerciales	160,367,568	0
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	160,367,568	0
		101800506008	Entidades financieras	0	0
		101800506009	Entidades gubernamentales	0	0
	101800205006		Créditos de consumo	646,972,424	0
	101800205007		Créditos a la vivienda	2,532,164,942	0
		101800706018	Media y residencial	2,415,942,278	0
		101800706019	De interés social	245,693	0
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	115,976,971	0
		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>	18,540,701,562	0
	101800305008		Créditos comerciales	9,651,456,853	0
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	9,559,977,328	0
		101800806024	Entidades financieras	91,479,525	0
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	0
	101800305009		Créditos de consumo	832,239,681	0
	101800305010		Créditos a la vivienda	8,057,005,028	0
		101801006034	Media y residencial	7,763,733,254	0
		101801006035	De interés social	10,406,505	0
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	282,865,269	0
		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: 2022

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 2022 Y 2021

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	495,316,510,967	0
	131800103002		Partidas diferidas	2,745,947,710	0
	101800103003		<b>ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS</b>	-16,804,764,446	0
	131800102001		<b>Cartera de crédito (neto)</b>	481,257,694,231	0
	131800102002		<b>Derechos de cobro adquiridos (neto)</b>	0	0
131800001001			<b>Total de cartera de crédito (neto)</b>	481,257,694,231	0
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>	15,353,581,685	0
132600001001			<b>Bienes adjudicados (neto)</b>	291,993,633	0
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	13,941,494	0
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	3,116,077,724	0
133400001001			<b>Propiedades, mobiliario y equipo (neto)</b>	4,773,303,604	0
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,684,307,039	0
103800001001			<b>INVERSIONES PERMANENTES</b>	52,955,983	0
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	6,491,779,686	0
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,587,883,059	0
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>	674,799,834,814	0
200200001001			<b>CAPTACIÓN TRADICIONAL</b>	485,465,653,800	0
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	231,774,831,329	0
	200200102002		Depósitos a plazo	240,867,260,225	0
		200200203003	Del público en general	209,629,358,526	0
		200200203004	Mercado de dinero	31,237,901,699	0
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	11,844,856,020	0
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	978,706,226	0
200400001001			<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>	49,517,945,530	0
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	29,868,880,151	0
	200400102003		De largo plazo	19,649,065,379	0
230600001001			<b>VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR</b>	5,236,891,311	0
200800001001			<b>ACREEDORES POR REPORTO</b>	55,760,905,600	0
201000001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	60,896	0
201200001001			<b>COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA</b>	3,965,324,425	0
	201200102001		Reportos	2,000,940,482	0
	201200102002		Préstamo de valores	1,964,383,943	0
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	33,707,618,530	0
	201400102001		Con fines de negociación	30,220,330,658	0
	201400102002		Con fines de cobertura	3,487,287,872	0
201600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS</b>	2,420,358	0
201800001001			<b>OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
202000001001			<b>Pasivo por arrendamiento</b>	2,810,706,933	0
202200001001			<b>Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal</b>	0	0
202400001001			<b>OTRAS CUENTAS POR PAGAR</b>	20,613,290,510	0
	202400102001		Acreedores por liquidación de operaciones	5,799,682,017	0
	202400102002		Acreedores por cuentas de margen	1,919,538,173	0
	202400102003		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	4,135,175,287	0
	202400102004		Contribuciones por pagar	429,793,533	0
	202400102005		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	8,329,101,500	0
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: 2022

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 2022 Y 2021

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	9,056,914,915	0
	203000102001		<b>OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN</b>	9,056,914,915	0
	203000102002		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	203000102003		Otros	0	0
20320001001			<b>Obligaciones asociadas con el retiro de componentes de propiedades, mobiliario y equipo</b>	0	0
20340001001			<b>Pasivo por impuestos a la utilidad</b>	1,967,203,346	0
20360001001			<b>Pasivo por beneficios a los empleados</b>	5,638,000,758	0
20380001001			<b>Créditos diferidos y cobros anticipados</b>	1,056,897,902	0
400000000000			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	75,280,032,227	0
44020001001			<b>Participación controladora</b>	75,278,792,411	0
	400200102001		<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	13,468,335,561	0
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	0
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	0
		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	0
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	0
		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>	61,810,456,850	0
		400200203010	Reservas de capital	7,839,163,707	0
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	0
		400200203012	Resultados acumulados	53,797,569,992	0
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	42,695,738,190	0
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	11,101,831,802	0
	400200203013		Otros resultados integrales	13,509,930	0
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-356,411,059	0
		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	851,988,920	0
		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	-482,067,931	0
		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	-2,104,073	0
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
44040001001			<b>PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA</b>	1,239,816	0
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	121,181	0
	440400102002		Otra participación no controladora	1,118,635	0
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			<b>CUENTAS DE ORDEN</b>	3,002,581,782,876	0
70020001001			Avales otorgados	0	0
70040001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
70060001001			Compromisos crediticios	264,565,231,096	0
70080001001			Bienes en fideicomiso o mandato	447,011,007,183	0
	700800102001		Fideicomisos	417,732,711,937	0
	700800102002		Mandatos	29,278,295,246	0
70100001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
70120001001			Bienes en custodia o en administración	605,231,886,406	0
70140001001			Colaterales recibidos por la entidad	11,013,636,844	0
70160001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	3,964,844,011	0
70180001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,333,372,123	0
70200001001			Otras cuentas de registro	1,669,461,805,213	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04

AÑO: 2022

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 2022 Y 2021

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	57,270,188,990	0
600400101002	Gastos por intereses	31,711,153,413	0
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	<b>MARGEN FINANCIERO</b>	25,559,035,577	0
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	1,739,040,369	0
330000000002	<b>MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS</b>	23,819,995,208	0
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	5,015,565,027	0
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	624,101,725	0
501400301007	Resultado por intermediación	1,548,475,559	0
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	676,146,640	0
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	16,703,653,977	0
330000000003	<b>RESULTADO DE LA OPERACIÓN</b>	13,732,426,732	0
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	59,067,750	0
330000000004	<b>RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD</b>	13,791,494,482	0
602400501012	Impuestos a la utilidad	2,689,541,499	0
330000000005	<b>RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS</b>	11,101,952,983	0
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	<b>RESULTADO NETO</b>	11,101,952,983	0
502800701014	Otros Resultados Integrales	-127,435,672	0
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-245,373,166	0
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	472,698,144	0
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remediación de beneficios definidos a los empleados	-354,760,650	0
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	-2,104,073	0
330000000007	<b>RESULTADO INTEGRAL</b>	10,972,413,238	0
543200601016	<b>Resultado neto atribuible a:</b>	11,101,952,983	0
543201602158	Participación controladora	11,101,831,802	0
543201602159	Participación no controladora	121,181	0
543400701017	<b>Resultado integral atribuible a:</b>	10,972,413,238	0
543401702160	Participación controladora	10,972,413,238	0
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: 2022

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 2022 Y 2021

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	AÑO ACTUAL IMPORTE	AÑO ANTERIOR IMPORTE
		<b>Actividades de operación</b>		
851000102001		<b>Resultado antes de impuestos a la utilidad</b>	13,791,494,482	0
851000102002		<b>Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:</b>	2,858,012,309	0
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	1,041,925,328	0
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	812,608,370	0
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	-34,878,453	0
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-59,067,750	0
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	1,097,424,814	0
	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	978,111,166	0
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	978,111,166	0
	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>	-6,747,846,177	0
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	481,304,783	0
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	-2,766,931,734	0
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	563,633,634	0
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	10,223,160,843	0
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-12,461,681,176	0
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	-62,155,081,862	0
	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)	-1,279,719,546	0
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-182,720,245	0
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	4,143,841,887	0
	851000403014	Cambio en captación tradicional	43,410,537,357	0
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	-1,884,779,690	0
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	23,774	0
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	1,207,667,183	0
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	12,827,464,033	0
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	2,664,632	0
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	-2,172,730,150	0
	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	-148,771,530	0
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	3,833,035,746	0
	851000403024	Cambio en otras provisiones	0	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-388,764,116	0
851000001001		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de operación</b>	10,879,771,780	0
		<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	-1,000,650,882	0
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	12,313,068	0
	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	57,687,998	0
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-740,340,609	0
	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: **2022**

**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 2022 Y 2021

**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	1,788,070,981	0
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	<b>Flujos netos de efectivo de actividades de inversión</b>	117,080,556	0
		<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	-734,694,368	0
	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	-4,399,991,759	0
	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	-978,111,166	0
	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>	-6,112,797,293	0
	851000000000	<b>Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo</b>	4,884,055,043	0
	851200000000	<b>Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo</b>	0	0
	851400000000	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo</b>	58,996,917,420	0
	100200001001	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo</b>	63,880,972,463	0

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: **2022**

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

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2022 Y 2021

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 Organismo 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>	10,457,688.673	0	1,117,363.364	0	7,059,716.497	48,574,357.437	-111,037.893	379,290.776	0	-127,307.281	0	0	0	67,350,071.573	1,118.635	67,351,190.208
<b>Ajustes retrospectivos por cambios contables</b>	0	0	0	0	0	-536,854.743	0	0	0	0	0	0	0	-536,854.743	0	-536,854.743
<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>	10,457,688.673	0	1,117,363.364	0	7,059,716.497	48,037,502.694	-111,037.893	379,290.776	0	-127,307.281	0	0	0	66,813,216.830	1,118.635	66,814,335.465
<b>MOVIMIENTOS DE PROPIETARIOS</b>																
Aportaciones de capital	213,277,129	0	1,680,006,395	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,893,283,524	0	1,893,283,524
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	-4,400,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-4,400,000,000	0	-4,400,000,000
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
<b>Total</b>	213,277,129	0	1,680,006,395	0	0	-4,400,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-2,506,716,476	0	-2,506,716,476
<b>MOVIMIENTOS DE RESERVAS</b>																
Reservas de capital	0	0	0	0	941,764.504	-941,764.504	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>RESULTADO INTEGRAL</b>																
Resultado neto	0	0	0	0	0	11,101,831,802	0	0	0	0	0	0	0	11,101,831,802	121,181	11,101,952,983
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	-245,373,166	472,698,144	0	-354,760,650	0	0	0	-127,435,672	0	-127,435,672
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	-245,373,166	0	0	0	0	0	0	-245,373,166	0	-245,373,166
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	472,698,144	0	0	0	0	0	472,698,144	0	472,698,144
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
Remediación de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-354,760,650	0	0	0	-354,760,650	0	-354,760,650
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	-2,104,073	-2,104,073	0	-2,104,073
<b>Total</b>	0	0	0	0	0	11,101,831,802	-245,373,166	472,698,144	0	-354,760,650	0	0	0	10,972,292,057	121,181	10,972,413,238
<b>Saldo al final 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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 1 / 86  
CONSOLIDADO  
Impresión Final

Scotiabank Inverlat  
Cifras Auditadas

Scotiabank-Indicadores FinancierosT1 2022T2 2022T3 2022T4 2022

ROE

(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)20.0%15.7%15.1%  
10.1%

ROA

(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)2.1%1.7%1.6%1.0%

MIN

(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos  
productivos promedio)4.7%3.6%3.5%2.8%

Eficiencia Operativa

(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

promedio) 2.7% 2.3% 2.3% 2.4%

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) 3.7% 3.6% 3.8% 3.7%

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.) 96.4% 95.2%

85.8% 90.6%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito 19.87% 20.70% 20.99% 19.78%\*

Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales

(crédito, mercado y operacional) 16.41% 16.50% 16.41% 15.50%\*

Liquidez

(Activos líquidos / Pasivos líquidos) 42.0% 42.5% 40.6% 45.5%

\* Sujeto a aprobación del Banco Central.

3 meses 12 meses

Scotiabank- Información Financiera

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 sep

2022 31 dic

2022T/T

Δ% 31 dic

2022

Ingresos por intereses 15,146 16,950 12% 57,270

Gastos por intereses (8,471) (10,211) -21% (31,711)

Margen Financiero 6,675 6,739 1% 25,559

Comisiones 1,170 1,197 2% 4,392

Resultado por Intermediación 372 333 -10% 1,548

OI OE 89 274 > +100% 676

Ingresos no Financieros 1,631 1,804 11% 6,616

Total Ingresos 8,306 8,543 3% 32,175

Gastos de Administración y Promoción (4,050) (4,310) -6% (16,704)

PTPP 4,256 4,233 -1% 15,471

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (772) (2,006) > -100% (1,739)

Resultado de la Operación 3,484 2,227 -36% 13,732

Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora 1 - -100% 59

Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 3,485 2,227 -36% 13,791

Impuestos a la Utilidad (614) (307) 50% (2,689)

Resultado Neto 2,871 1,920 -33% 11,102

Otros Resultados Integrales

Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender (326) 238 > +100% (245)

Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo 52 (137) > -100% 473

Remediación de beneficios definidos a los empleados 1 (366) > -100% (355)

Participación en ORI de otras entidades - (2) 0% (2)

Resultado Integral 2,598 1,653 -36% 10,973

\* PTPP: "Pre-Tax, Pre-Provision", resultado antes de impuestos y reservas.

La utilidad neta acumulada al cierre de diciembre de 2022 se ubicó en \$11,102 millones; la cual se integra principalmente por ingresos provenientes de margen financiero, comisiones y tarifas netas; compensados parcialmente por gastos de administración y promoción, así como reservas crediticias.

La utilidad neta del cuarto trimestre de 2022 se ubicó en \$1,920 millones, una disminución de \$951 millones o 33% respecto al trimestre anterior, debido



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

principalmente a mayores requerimientos de reservas crediticias; compensados parcialmente por menores impuestos a la utilidad.

Ingresos no Financieros

3 meses12 meses

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 sep

202231 dic

2022T/T

Δ%31 dic

2022

Aceptaciones por Cuenta de Terceros 1 - -100% 1

Actividades Fiduciarias 58 54 -7% 230

Apertura de Cuenta 5 6 20% 19

Cartas de Crédito sin Refinanciamiento 59 82 39% 248

Cheques Certificados 1 1 0% 3

Cheques de caja - 1 0% 2

Compraventa de instrumentos financieros - - 0% 1

Manejo de Cuenta 97 86 -11% 355

Operaciones de Crédito 476 487 2% 1,745

Otras Comisiones y Tarifas 399 401 1% 1,491

Servicios de Banca Electrónica 47 50 6% 186

Transferencia de Fondos 27 29 7% 111

Total de Comisiones y Tarifas (netas) 1,170 1,197 2% 4,392

3 meses12 meses

Scotiabank -Otros Ingresos/Egresos de la Operación

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 sep

202231 dic

2022T/T

Δ%31 dic

2022

Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas(51) 20 > +100%(62)

Aportaciones al IPAB(505) (521)-3%(2,020)

Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo 60 25 -58% 217

Donativos(9) (11)-22%(20)

Estimación por Pérdida de Valor de Bienes Adjudicados(7) (8)-14%(23)

Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito - 52 0% 53

Ingresos por Arrendamiento 3 3 0% 17

Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados 39 45 15% 145

Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación 603 639 6%2,823

Quebrantos(81) (34)58%(591)

Recuperaciones 2 11 > +100% 19

Resultado en Venta de Bienes Adjudicados 24 22 -8% 76

Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo 11 1 -91% 12

Utilidad por venta de cartera de crédito - 30 0% 30

Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación 89 274> +100% 676

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

3 meses12 meses

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 sep

202231 dic

2022T/T

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Δ%31 dic

2022

Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(772) (2,006) > -100%(1,739)

La Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios acumulada al cierre de diciembre 2022 se mostró en \$1,739 millones, integrado por mayores requerimientos de reservas en la cartera hipotecaria, tarjeta de crédito, automotriz, cartera comercial y consumo.

En el cuarto trimestre de 2022, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en \$2,006 millones, un incremento de \$1,234 millones o 160% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores requerimientos de reservas en el trimestre.

Gastos de Administración y Promoción

3 meses12 meses

Gastos de Administración y Promoción

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 sep

202231 dic

2022T/T

Δ%31 dic

2022

Gastos de Personal(1,696) (1,555) 8%(7,426)

Gastos de Operación(2,354) (2,755) -17%(9,278)

Total de Gastos de Administración y Promoción(4,050) (4,310) -6%(16,704)

Impuestos a la Utilidad

3 meses12 meses

Scotiabank-Impuestos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 sep

202231 dic

2022T/T

Δ%31 dic

2022

Impuesto a la Utilidad Causado(813) (682) 16%(2,924)

Impuesto a la Utilidad Diferido 199 375 88% 235

Total de Impuestos a la Utilidad(614) (307) 50%(2,689)

Los impuestos netos acumulados al cierre de diciembre 2022 se ubicaron en \$2,689 millones, con una tasa efectiva del periodo de 19.5%. Generada principalmente por la inflación deducida en el periodo.

En el cuarto trimestre de 2022, el total de impuestos netos se ubicaron en \$307, una disminución de \$307 millones o 50%. Generada principalmente por una menor utilidad en el periodo.

Balance General

Scotiabank - Cifras relevantes del Balance General

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 sep

202231 dic

2022T/T

Δ%

Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores 219,145 231,456 6%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 452,361 476,776 5%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 18,102 18,541 2%

Partidas diferidas- 2,746 0%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(15,530) (16,805) -8%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Otros Activos	41,850	37,366	-11%
Total Activo	715,928	750,080	5%
Depósitos	446,817	485,466	9%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	44,084	49,518	12%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,099	9,057	0%
Otros Pasivos	138,439	130,759	-6%
Capital	77,489	75,280	-3%
Total Pasivo y Capital	715,928	750,080	5%

Al 31 de diciembre de 2022, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$750,080 millones, un incremento de \$34,152 millones o 5% respecto al trimestre anterior. Debido principalmente a mayores volúmenes de efectivo y equivalentes de efectivo en depósitos en Banxico, otras entidades financieras y préstamos interbancarios - call money, así como mayores volúmenes de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1, 2 y 3 de comercial, vivienda, entidades gubernamentales y financieras; compensados parcialmente por menores volúmenes en inversiones en instrumentos financieros de valores gubernamentales (negociables y para cobrar o vender).

El total del pasivo se ubicó en \$674,800 millones al 31 de diciembre de 2022, un incremento de \$36,361 millones o 6% respecto al trimestre anterior. Debido principalmente a mayores volúmenes en depósitos y préstamos bancarios y de otros organismos; compensados parcialmente por menores volúmenes en acreedores por liquidación de operaciones e instrumentos financieros derivados con fines de negociación (en Otros Pasivos).

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) 30 sep

202231 dic

2022T/T

Δ%

Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales 33,608 33,259 -1%

Créditos a la Vivienda 182,640 189,071 4%

Total Préstamos de Menudeo 216,248 222,330 3%

Actividad Empresarial o Comercial 207,847 221,292 6%

Entidades Financieras 15,446 17,426 13%

Entidades Gubernamentales 12,820 15,728 23%

Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales 236,113 254,446 8%

Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 452,361 476,776 5%

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de diciembre de 2022 se ubicaron en \$254,446 millones, un incremento de \$18,333 millones u 8% respecto al trimestre anterior, debido a mayores créditos de actividad empresarial o comercial; entidades gubernamentales y financieras.

El total de préstamos de menudeo al 31 de diciembre de 2022 se ubicó en \$222,330 millones, un incremento de \$6,082 millones o 3% respecto al trimestre anterior, principalmente por créditos a la vivienda

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) 30 sep

202231 dic

2022T/T

Δ%

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 18,102 18,541 2%  
 Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (15,530) (16,805) -8%  
 Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta 2,572 1,736 -33%  
 Índice de morosidad 3.8% 3.7% -11 pb

Al 31 de diciembre de 2022 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 se ubicó en \$18,541 millones, un incremento de \$439 millones o 2% respecto al trimestre anterior.

Al 31 de diciembre de 2022 la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$16,805 millones, un incremento de \$1,275 millones u 8% respecto al trimestre anterior. La estimación preventiva para riesgos crediticios representa el 3.4% de la cartera total al 31 de diciembre de 2022, un incremento de 9pb respecto al trimestre anterior.

Al 31 de diciembre de 2022, el índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 90.6%, mayor al 85.8% respecto al cierre del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 31 de diciembre de 2022 fue de 3.7%, una disminución de 11pb respecto al trimestre anterior.

## Depósitos

Scotiabank - Depósitos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 sep

2022 31 dic

2022 T/T

Δ%

Total Depósitos Vista y Ahorro 230,036 231,775 1%

    Público en General 191,459 209,629 9%

    Mercado de Dinero 2,306 31,238 > +100%

Total Depósitos a Plazo 193,765 240,867 24%

Títulos de Crédito Emitidos 22,033 11,845 -46%

Cuenta global de captación sin movimientos 983 979 0%

Total de Depósitos 446,817 485,466 9%

Al 31 de diciembre de 2022, el total de depósitos se ubica en \$485,466 millones, un incremento de \$38,649 millones o 9% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores depósitos a plazo por \$47,102 millones o 24%; compensados parcialmente por menores títulos de crédito emitidos por \$10,188 o 46%.

Scotiabank

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

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Emisor Títulos Tasa Plazo Importe

I-BANSAN-23025 14,960,262,178 10.39% 1414,904

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022 valor razonable)

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

Instrumentos financieros negociables 56,913 1,548 17 104 58,582

Sin restricción: - - 13 - 13

Restringidos: 56,913 1,548 4 104 58,569

    En operaciones de reporto 51,397 1,548 - 104 53,049

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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 7 / 86  
 CONSOLIDADO  
 Impresión Final

Préstamos de valores	2,184	-	-	-	2,184				
Otros	3,332	-	4	-	3,336				
Instrumentos financieros para cobrar o vender	43,894	18,850	-	1,228	63,972				
Sin restricción:	35,117	18,850	-	1,228	55,195				
Restringidos:	8,777	-	-	-	8,777				
En operaciones de reporto	7,221	-	-	-	7,221				
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-				
Otros	1,556	-	-	-	1,556				
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	4,717	-	-	-	4,717				
Sin restricción	4,717	-	-	-	4,717				
Total	105,524	20,398	171,332	127,271					

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022; valor razonable)

Contratos Adelantados Futuros Opciones Operaciones Estructuradas Swaps Paquetes de Instrumentos Derivados

Total activo Total

pasivo

Posición Posición Posición Posición Posición Posición

Con fines de: Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva

Negociación 1,976 1,750 - - 1,597 1,400 322 298 26,749 26,773 - - 30,644 30,221

Cobertura - - - - - - - - 5,608 3,487 - - 5,608 3,487

Scotiabank-Montos nomenclaturales en operaciones derivadas

(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de diciembre de 2022)

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

Con fines de negociación

Posición USD 3,171 3,182

Posición EUR 55

Posición GBP 11

Posición CAD

Divisas USD 121 235 535

Divisas EUR

Divisas MXN 8686

Acciones MXN 283 283 849 357

Índices MXN 4,275 4,277

Tasa de interés

Pesos 37,433 36,696 323,184 325,359

Dólares 658 657 1,424 1,778

Euros 23

Pesos Colombianos 177,500

Con fines de cobertura

Tasa de interés

Pesos 45,182 200

Dólares 499 230

Euros

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022) Pesos Dólares Udis Total

Actividad empresarial o comercial 174,521 46,611 221,132

Créditos a entidades financieras 17,417 9 17,426

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Créditos a entidades gubernamentales 11,8203,908-15,728  
Créditos al consumo 32,612--32,612  
Créditos a la vivienda 186,462 1859186,539  
Total 422,83250,54659473,437

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022) Pesos Dólares Udis Total  
Actividad empresarial o comercial 160 - -160  
Créditos al consumo 647 - -647  
Créditos a la vivienda 2,526 2 42,532  
Total 3,333 2 43,339

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022) Pesos Dólares Udis Total  
Actividad empresarial o comercial 17,846 1,714 -9,560  
Créditos a entidades financieras 91 - -91  
Créditos al consumo 832 - -832  
Créditos a la vivienda 8,013 37 88,058  
Total 16,782 1,751 818,541

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3  
(millones de pesos)  
Saldo al 30 de septiembre de 2022 18,102  
Reestructuras 59  
Recuperaciones (1,145)  
Castigos y quitas (738)  
Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 22,316  
Fluctuación Tipo Cambio (53)  
Saldo al 31 de diciembre de 2022 18,541

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios  
(millones de pesos)  
Saldo al 30 de septiembre de 2022 15,530  
Más: Creación de reservas 724  
Calificación 1,352  
Menos: Adjudicaciones y otros 160  
Castigos y quitas 590  
Comercial 20  
Hipotecario 94  
Consumo 476  
Desliz cambiario 51  
Saldo al 30 de diciembre de 2022 16,805

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito 30 sep  
2022 31 dic  
2022  
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2  
Metropolitano 60.0% 62.2%  
Noroeste - Centro 11.0% 10.7%  
Norte 14.6% 13.7%  
Bajío 8.6% 7.9%  
Sur 5.8% 5.5%  
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Metropolitano 44.9% 41.5%  
Noroeste - Centro 17.0% 19.6%  
Norte 7.3% 7.3%  
Bajío 15.1% 15.7%  
Sur 15.7% 15.9%

Scotiabank-Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

No. Acreditados / Grupos Monto % Capital Básico

110,192 14.45%

29,036 12.81%

38,275 11.73%

Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos 27,503

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia

Al 31 de diciembre de 2022 (millones de pesos)

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 1427,474 989 1025 783 041,973

Riesgo A 253,259 522 291 841 575 0

Riesgo B 113,542 170 376 115 283

Riesgo B 29,687 734 639 592 17

Riesgo B 35,666 841 942 531 98

Riesgo C 13,080 412 984 472 01

Riesgo C 23,106 626 170 196 398

Riesgo D 7,546 772 473 341,149 2,302

Riesgo E 11,905 6,116 619 419 1,662 8,816

Total 535,265 8,773 954 1,911 3,500 15,138

Exceso 1,667

Reservas Constituidas 16,805

## 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 2022.

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.



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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	\$	
-			
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)			
28			
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos			7
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores			1,632
Total	\$		1,667

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 2022 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 especiales (millones de pesos)

Títulos	Importe	Vencimiento
B4	27070111,209,6861,	61901-jul-27
BV	2707016-01-	jul-27
Total	15,209,6921,	619

Tasa Promedio

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional	(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)	Pesos	Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	3.56%	0.69%	-	
Depósitos a plazo	6.95%	0.00%	-	

Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Vencimiento	Préstamos	Financiamiento	Total
Banca			
Múltiple	Banco de		
México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos
Pesos			
Inmediato	-----		

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Mediano -	1,237	7,511	3,556	-	12,304
Largo -	-	14,500	4,980	-	19,480
Total -	1,237	22,011	8,536	-	31,784

Tasa Promedio 0.00% 6.47% 11.62% 9.87% 0.00%

Otros

Inmediato-----

Mediano	14,768	-	25	786	1,986	17,565
---------	--------	---	----	-----	-------	--------

Largo -	-	-	169	-	169
---------	---	---	-----	---	-----

Total	14,768	-	25	955	1,986	17,734
-------	--------	---	----	-----	-------	--------

Tasa Promedio 4.52% 0.00% 5.68% 4.75% 3.66%

Total Préstamos Interbancarios 14,768 1,237 22,036 9,491 1,986 49,518

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 2022.

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

30 sep

2022 31 dic

2022

Depósitos a la Vista 54.4% 49.1%

Metropolitano 24.3% 22.3%

Noroeste - Centro 11.2% 9.1%

Norte 7.3% 7.0%

Bajío 5.9% 5.2%

Sur 5.7% 5.5%

Depósitos Ventanilla 45.1% 44.3%

Metropolitano 18.1% 21.4%

Noroeste - Centro 6.1% 4.8%

Norte 8.3% 8.6%

Bajío 6.6% 5.1%

Sur 6.0% 4.4%

Total de Captación del Público 99.5% 93.4%

Fondeo Profesional 0.5% 6.6%

Scotiabank-ISR Diferido

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Provisión por perdidas de crédito 5,042

Compensación diferida (1,188)

Ingresos diferidos 536

Instalaciones y equipos / depreciación 695

Beneficios a los empleados 968

Provisiones 904

Otros (465)

Efecto Neto en Diferido 6,492

Scotiabank-PTU Diferido

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

Valuación de instrumentos financieros:

Instrumentos financieros negociables 5

Operaciones financieras derivados 11

Instrumentos financieros para cobrar o vender 46

Swaps de cobertura de flujos de efectivo (110)

Pagos anticipados (315)

Arrendamiento 2

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Provisiones y otros 368  
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo (62)  
Comisiones cobradas por anticipado 134  
Plan de pensiones 255  
Remediciones por beneficios definidos a los empleados 63  
Bienes adjudicados 93  
Futuros castigos de crédito 1,326  
Efectos de fusión Crédito Familiar 15  
Efecto Neto en Diferido 1,831  
Al 31 de diciembre de 2022, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank-Resultados por Intermediación  
(millones de pesos) 31 dic  
2022

Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable (538)  
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos  
financieros (12)  
Resultado por valuación de divisas (458)  
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros  
derivados 828  
Resultado por compraventa de divisas 1,733  
Costos de transacción (5)  
Total 1,548

Emisión de Certificados Bursátiles

Al cierre de diciembre de 2022, las principales características de las emisiones de  
Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las  
siguientes:

Quinta\* Tercera\*\*\*  
Clave de Pizarra SCOTIAB 13-2 SCOTIAB 19-2  
Monto de la Emisión \$1,150 millones \$6,000 millones  
Fecha de Emisión y Colocación 28 junio  
2013 6 diciembre 2019  
Plazo de Vigencia de la Emisión 3,640 días, 20 períodos  
182 días, aprox.  
10 años 1,207 días, aprox.  
3.3 años  
Garantía Quirografaria Quirografaria  
Tasa de interés 7.30% Fijo TIIE 28 + 0.15%  
Pago de Intereses Cada 182 días durante la vigencia de la emisión Cada 28 días  
Calificaciones otorgadas Fitch/S&PAAA(mex) / "mxAAA" AAA(mex) / "mxAAA"  
Amortización del principal Un sólo pago al vencimiento Un sólo pago al vencimiento

\* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

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

Emisión de Obligaciones Subordinadas

Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo
(días)	Importe (\$)	Tasa (%)	
18-diciembre-1405	-diciembre-24	MX0QSC1N00163	6402,093,000,000 7.4
28-junio-1809	-junio-33	MX0QSC1N00245	4603,360,000,000 12.3
11-septiembre-18	Perpetua	MX0QSC1N0032	-3,455,000,000 11.3
Total de Obligaciones Subordinadas 8,908,000,000			

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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	05-20	1,930,500	19-feb-2017-feb-23	1,094	MSFDVTIG IDEX	193,050,000
99-SCOTIAB	06-20	6,460,410	27-mar-2027-mar-23	1,095	MSFDVTIG IDEX	646,041,000
99-SCOTIAB	07-20	7,299,300	14-may-2012-may-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	729,930,000
99-SCOTIAB	08-20	405,850	11-jun-2009-jun-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	40,585,000
99-SCOTIAB	04-21	120,000	24-mar-2108-mar-24	1,080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99-SCOTIAB	05-21	4,866,500	29-abr-2126-abr-24	1,093	Index (IDBTVER)	486,650,000
99-SCOTIAB	06-21	572,300	03-jun-2131-may-24	1,093	Index (IDBTVER)	57,230,000
99-SCOTIAB	08-21	809,300	12-ago-2110-ago-23	728	Index (IDBTVER)	80,930,000
99-SCOTIAB	09-21	3,940,200	25-nov-2122-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	394,020,000
99-SCOTIAB	10-21	3,843,100	25-nov-2122-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	384,310,000
99-SCOTIAB	11-21	1,105,530	07-dic-2101-jun-23	541	MSCI ETF (EZU)	110,553,000
99-SCOTIAB	01-22	543,200	28-feb-2225-feb-25	1,093	MSFDVTHY Index	54,320,000
99-SCOTIAB	02-22	545,100	28-feb-2227-feb-24	729	Invesco QQQ Series 1	54,510,000
99-SCOTIAB	03-22	369,750	08-mar-2205-sep-23	546	iShares MSCI China ETF	36,975,000
99-SCOTIAB	04-22	571,500	12-may-2210-nov-23	547	SPDR Gold Shares (GLD)	57,150,000
99-SCOTIAB	05-22	1,255,860	15-jun-2213-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	125,586,000
99-SCOTIAB	06-22	1,829,000	15-jun-2213-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	182,900,000
99-SCOTIAB	07-22	793,540	16-jun-2213-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99-SCOTIAB	08-22	1,030,150	16-jun-2213-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	103,015,000
99-SCOTIAB	09-22	495,000	23-jun-2222-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	49,500,000
99-SCOTIAB	10-22	720,100	30-jun-2229-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	72,010,000
99-SCOTIAB	11-22	5,791,750	17-nov-2214-nov-25	1,093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	579,175,000
99-SCOTIAB	12-22	457,550	18-nov-2214-nov-25	1,092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99-SCOTIAB	13-22	104,500	23-nov-2221-nov-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99-SCOTIAB	14-22	813,800	19-dic-2217-dic-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	81,380,000
Total Bonos Bancarios al 31 de diciembre de 2022						4,665,579,000

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 2022)

ReferenciaCapital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservasMonto

1Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente 13,468

2Resultado de ejercicios anteriores 42,696

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

3Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 19,117  
4Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1  
(solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones) No aplica  
5Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros  
(monto permitido en el capital común de nivel 1)No aplica  
6Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios 75,281  
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) 1,833  
11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo -  
12 Reservas 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) 8  
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 nacionales 8,805  
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 8,160  
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 -

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

N del cual: Plan de pensiones por beneficios definidos -  
OSe Deroga -  
P del cual: Inversiones en cámaras de compensación 645  
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 10,646  
29Capital común de nivel 1 (CET1) 64,635  
Capital adicional de nivel 1: instrumentos  
30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1,  
más su prima 3,582  
31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables  
3,582  
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 3,582  
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 la 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) 3,582  
45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) 68,217  
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas  
46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su  
prima 3,792  
47Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del  
capital de nivel 2 -  
48Instrumentos 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 1,619  
51Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios 5,411  
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 16 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 -  
57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2 -  
58Capital de nivel 2 (T2) 5,411  
59Capital total (TC = T1 + T2) 73,628  
60Activos ponderados por riesgo totales 475,012  
Razones de capital y suplementos  
61Capital Común de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)13.61%  
62Capital de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)14.36%  
63Capital Total  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)15.50%  
64Suplemento 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)16.71%  
65 del cual: Suplemento de conservación de capital2.50%  
66 del cual: Suplemento contracíclico bancario específico0.00%  
67 del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)0.60%  
68Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)6.61%  
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)  
69Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica  
70Razón mínima nacional de T1  
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)No aplica  
71Razón 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)  
72Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras No 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) 1,619  
77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada 4,368  
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) -

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

79 Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas -  
Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)  
80 Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual No aplica  
81 Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) No aplica  
82 Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual -  
83 Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) -  
84 Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual -  
85 Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) -

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 conservador Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.  
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 conservador 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 conservador El monto de la inversión en cualquier acción propia que la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de los fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.

Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido.

17 conservador Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del Grupo Financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.

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 conservador Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.

19 conservador

Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

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 conservador 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.

21 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.

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

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

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

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

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

AA. 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.

BB. 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.

CC. 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.

DD. 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.

EE. 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

de las inversiones en fondos de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

FF. 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.

GG. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de fondos de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable del citado fondo de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.

HH. 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.

II. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

JJ. 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.

KK. 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.

LL. 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.

MM. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso s) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

NN. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.

OO. 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.

PP. 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.

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 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.

51Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.

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

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

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

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

56Ajustes 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.

57Suma de los renglones 52 a 56.

58Renglón 51, menos renglón 57.

59Renglón 45, más renglón 58.

60Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.

61Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).

62Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).

63Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).

64Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61,65, 66 y 67.

65Reportar 2.5%

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

- 66Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
- 67La 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.
- 68Renglón 61 menos 7%.
- 69No 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.
- 70No 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.
- 71No 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.
- 72No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
- 73No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
- 74No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
- 75El 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.
- 76Estimaciones 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.
- 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 2022)

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 23 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

## Activo

BG1Efectivo y equivalentes de Efectivo 66,324  
BG2Cuentas de Margen 764  
BG3Inversiones en Instrumentos Financieros 127,271  
BG4Deudores por reporto 3,224  
BG5Préstamo de valores -  
BG6Instrumentos Financieros Derivados 36,252  
BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros(1,380)  
BG8Total de cartera de crédito (neto) 481,258  
BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización -  
BG10Otras cuentas por cobrar (neto) 15,177  
BG11Bienes adjudicados (neto) 292  
BG12Propiedades, mobiliario y equipo (neto) 2,437  
BG13Inversiones permanentes 3,713  
BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios 14  
BG15Activo por impuestos a la utilidad diferidos 6,472  
BG16Pagos Anticipados y Otros activos (neto) 3,111  
Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto) 1,970  
Activos Intangibles (neto) 4,588

## Pasivo

BG17Captación tradicional 485,702  
BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos 49,518  
Valores asignados por liquidar 5,237  
BG19Acreedores por reporto 60,291  
BG20Préstamo de valores -  
BG21Colaterales vendidos o dados en garantía 3,965  
BG22Instrumentos Financieros Derivados 33,708  
BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros 2  
BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización -  
BG25Otras cuentas por pagar 18,007  
BG26Obligaciones subordinadas en circulación -  
BG27Pasivo por impuesto a la utilidad 1,959  
BG28Créditos diferidos y cobros anticipados 1,057  
Pasivos por arrendamiento 2,094  
Instrumentos Financieros que califican como pasivo 9,057  
Pasivos por Beneficio a los Empleados 5,611

## Capital contable

BG29Capital contribuido 13,468  
BG30Capital ganado 61,811

## Cuentas de orden

BG31Avales otorgados -  
BG32Activos y pasivos contingentes -  
BG33Compromisos crediticios 264,565  
BG34Bienes en fideicomisos o mandato 447,011  
BG35Agente financiero del gobierno federal -  
BG36Bienes en custodia o en administración 67,950  
BG37Colaterales recibidos por la entidad 11,013  
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad 3,965  
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 1,333  
BG41Otras cuentas de registro 1,662,101

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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 24 / 86

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital neto (millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

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 mercantil18-

2Otros Intangibles9-

3Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales 10 1,833 BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,833

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-

11Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido19-

12Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales21 8 BG 15 Impuestos y PTU diferidos (neto) \$8

13Reservas reconocidas como capital complementario50 1,619 BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$1,619

14Inversiones en deuda subordinada26-B -

15Inversiones en organismos multilaterales26-D -

16Inversiones en empresas relacionadas26-E -

17Inversiones en capital de riesgo26-F -

18Inversiones en sociedades de inversión26-G - BG 13 Inversiones Permanentes \$ 0

19Financiamiento para la adquisición de acciones propias26-H -

20Cargos diferidos y pagos anticipados26-J 8,160 BG 16 Activos Intangibles \$4,588 más Gastos de Instalación \$3,572

21Participación de los trabajadores en la utilidades (neta)26-L -

22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos26-N -

23Inversiones en cámara de compensación26-P 645 BG 13 Inversiones Permanentes \$ 645

## PASIVO

24Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil18 -

25Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles9 -

26Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado15 -

27Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por beneficios definidos15

28Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los anteriores21 -

29Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R31 3,582 BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,582

30Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental133 -

31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S46 3,792 BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,792

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

complementario47 -

33Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados26-J -

CAPITAL CONTABLE

34Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q1 13,468 BG 29 Capital Social \$10,671 más Prima en Venta de Acciones \$2,797

35Resultado de ejercicios anteriores2 42,696 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$42,696

36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable3 852 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$852

37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores3 18,265 BG 30 Reservas de Capital \$8,001 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$356) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$482) más Resultado Neto \$11,102

38Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R31 -

39Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S46 -

40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable3, 11 -

41Efecto acumulado por conversión3, 26-A -

42Resultado por tenencia de activos no monetarios3, 26-A -

CUENTAS DE ORDEN

43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas26 - K -

CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERALIdentificador

44Reservas pendientes de constituir12 -

45Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)26-C - Estado de Resultados

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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.

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 2022)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo

Importe de posiciones equivalentesRequerimiento de capital

Operaciones en moneda nacional con tasa nominal 59,445 4,756

Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable 1,051 84

Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's 3,590 287

Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General - -

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC 82 7  
 Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General - -  
 Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal 1,992 159  
 Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio 1,995 160  
 Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones 66 5  
 Posiciones en Mercancía - -  
 Requerimiento de capital por impacto Gamma - -  
 Requerimiento de capital por impacto Vega 14 1  
 Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo Activos ponderados por riesgo  
 Requerimiento de capital

Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	23	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%)	995	80
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	5,900	472
Grupo III (ponderados al 25%)	1	-
Grupo III (ponderados al 50%)	360	29
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%)	2,551	204
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	218	17
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	19	2
Grupo VI (ponderados al 20%)	2,382	191
Grupo VI (ponderados al 25%)	1,662	133
Grupo VI (ponderados al 30%)	6,518	521
Grupo VI (ponderados al 40%)	7,076	566
Grupo VI (ponderados al 50%)	38,136	3,051
Grupo VI (ponderados al 70%)	29	2
Grupo VI (ponderados al 75%)	21,016	1,681
Grupo VI (ponderados al 85%)	11,448	916
Grupo VI (ponderados al 100%)	60,315	4,825
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Grupo VII_A (ponderados al 10%)	160	13
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	17,046	1,364
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	18	1
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	12,361	989
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	141,670	11,334
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	25	2
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,663	133
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%)	1,176	94
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%)	7,188	575
Grupo VIII (ponderados al 150%)	2,924	234
Grupo IX (ponderados al 100%)	25,948	2,076
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)	36	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, 6 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	3,324	266
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	16	1
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	10	1
Activos ponderados sujetos a riesgo operacional		
Método empleado Activos ponderados por riesgo Requerimiento de capital		
Estándar Alternativo	34,563	2,765
Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses		
	31,904	

Categoría Capitalización

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Al 31 de diciembre del 2022, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 12.73% (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.

Rendimientos / dividendos

17 Tipo de rendimiento / dividendo Fijo o Variable

18 Tasa de Interés / Dividendo La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.

19 Cláusula de cancelación anticipada Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.

20 Discrecionalidad en el pago Parcialmente discrecional.

21 Cláusula de aumento de intereses No

22 Rendimientos / dividendos No Acumulable

23 Convertibilidad del instrumento N.A.

24 Condiciones de convertibilidad N.A.

25 Grado de convertibilidad N.A.

26 Tasa de conversión N.A.

27 Tipo de convertibilidad del instrumento N.A.

28 Tipo de instrumento financiero de la convertibilidad N.A.

29 Emisor del instrumento Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.

30 Cláusula de disminución de valor

(Write-Down) No

31 Condiciones para disminución de valor N.A.

32 Grado de baja de valor N.A.

33 Temporalidad de la baja de valor N.A.

34 Mecanismos de disminución de valor temporal N.A.



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

35 Posición de subordinación en caso de liquidación Los títulos de las acciones están sujetos a las disposiciones que en su caso emite la Secretaría de Hacienda y Crédito Público y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, así como lo que al efecto dispongan los Estatutos Sociales.

36 Características de incumplimiento No

37 Descripción de características de incumplimiento No

Scotiabank- Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio

Referencia Descripción

1 Institución de crédito que emite el título que forma parte del Capital Neto.

2 Identificador o clave del título que forma parte del Capital Neto, (ISIN, CUSIP o número identificador de valor internacional).

3 Marco legal con el que el título deberá de cumplir, así como las leyes sobre a las cuales se sujetará.

4 Nivel de capital al que corresponde el título que está sujeto a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.

5 Nivel de capital al que corresponde el título que cumple con el anexo 1-Q, 1-R, o 1-S de las presentes disposiciones.

6 Nivel dentro del grupo al cual se incluye el título.

7 Tipo de Instrumento de Capital o título representativo del capital social que se incluye como parte del Capital Neto. En caso de los títulos sujetos a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, establecido en la Resolución 50a, se refiere a las obligaciones subordinadas descritas en el Artículo 64 de la Ley de Instituciones de Crédito.

8 Monto del Instrumento de Capital o título representativo del capital social, que se reconoce en el Capital Neto conforme al Artículo 2 bis 6 de las presentes disposiciones, en caso de que la referencia 5 sea Fundamental o Básico no Fundamental; y conforme al Artículo 2 bis 7 de las presentes disposiciones en caso de que dicha referencia sea Complementario. En cualquier otro caso, será el monto que corresponda de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.

9 Valor nominal del título en pesos mexicanos.

9A Moneda utilizada para expresar el valor nominal del título en pesos mexicanos conforme al estándar internacional ISO 4217

10 Clasificación contable del título que forma parte del Capital Neto.

11 Fecha de emisión del título que forma parte del Capital Neto.

12 Especificar si el título tiene vencimiento o es a perpetuidad.

13 Fecha de vencimiento del título, sin considerar las fechas de pago anticipado.

14 Especificar si el título incluye una cláusula de pago anticipado por el emisor donde se ejerza el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

15 Fecha en la que el emisor puede, por primera vez, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

15A Especificar si la cláusula de pago anticipado considera eventos regulatorios o fiscales.

15B Especificar el precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado.

16 Fechas en la que el emisor puede, posterior a la especificada en la referencia 15, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

17 Especificar el tipo de rendimiento/dividendo que se mantendrá durante todo el plazo del título.

18 Tasa de interés o índice al que hace referencia el rendimiento/dividendo del título

19 Especificar si el título incluye cláusulas que prohíban el pago de dividendos a los poseedores de títulos representativos del capital social cuando se incumple con el pago de un cupón o dividendo en algún instrumento de capital.

20 Discrecionalidad del emisor para el pago de los intereses o dividendos del título. Si

la Institución en cualquier momento puede cancelar el pago de los rendimientos o dividendos deberá seleccionarse (Completamente discrecional); si solo puede cancelarlo en algunas situaciones (Parcialmente discrecional) o si la institución de crédito no puede cancelar el pago (Obligatorio).

21Especificar 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".

22Especificar si los rendimientos o dividendos del título son acumulables o no.

23Especificar si el título es convertible o no en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.

24Condiciones bajo las cuales el título es convertible en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.

25Especificar si el título se convierte en su totalidad o solo una parte cuando se satisfacen las condiciones contractuales para convertir.

26Monto 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.

27Especificar si la conversión es obligatoria u opcional.

28Tipo de acciones en las que se convierte el título.

29Emisor del instrumento en el que se convierte el título.

30Especificar si el título tiene una característica de cancelación de principal.

31Condiciones bajo las cuales el título disminuye su valor.

32Especificar 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.

33Especificar 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.

34Explicar el mecanismo de disminución de valor temporal.

35Posición más subordinada a la que está subordinado el instrumento de capital que corresponde al tipo de instrumento en liquidación.

36Especificar 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.

37Especificar 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

JurisdicciónPonderadorJurisdicciónPonderadorJurisdicciónPonderador

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-

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 2022 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 25 de mayo de 2022 como Institución de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local a Scotiabank Inverlat, S.A., mediante oficio Núm. 141-5/1899/2022 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 al nuevo requerimiento de capacidad total de absorción de pérdidas la institución deberá al menos tener el 6.5% de los activos ponderados sujetos a riesgos totales el cual deberá de constituirse durante los próximos cuatro años, por lo que el capital mínimo regulatorio que debe mantener Scotiabank, es de 12.73% al 31 de diciembre de 2022.

FechaSuplemento al Capital Neto  
31 de diciembre de 2022  
31 de diciembre de 2023  
31 de diciembre de 2024  
31 de diciembre de 2025

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)  
ReferenciaRubroDic-22\*  
1Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones 7,719

1aNo aplica

2Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo 475,012

3Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)1.63%

3aNo aplica

4Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-0 Bis de estas disposiciones 807,899

5"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)0.94%

5a"

6aNo aplicaNo

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 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

6c"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?0%

\*El Banco al considerarse una institución de Importancia Sistémica 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 2022)

ReferenciaRubroDic-22

Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes

1Capital Fundamental 64,635

2Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto 3,582

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 3,582

6Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto 5,411

7Porción amortizada de instrumentos de capital complementario, donde el vencimiento remanente > 1 año -

8Capital 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 5,411

11Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio 73,628

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 -

13Instrumentos 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 -  
Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes  
18Suplemento al Capital Neto antes de deducciones 73,628  
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 deducciones 73,628  
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 Neto 4 475,012  
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 807,899  
Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos  
25Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)15.50%  
26Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)9.11%  
27Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto13.61%  
28Requerimientos 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)2.23%  
29Del cual: Requerimiento por suplemento de conservación de capital0.60%  
30Del cual: Requerimiento por suplemento de capital contracíclico específico de banco 0.00%  
31Del cual: Requerimiento por suplemento al capital neto1.63%

Scotiabank-Composición del Suplemento al Capital Neto  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2022)

ReferenciaRubro

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 esparcialmente del capital regulatorio vía el requerimiento para amortizar el instrumento en cinco años previo al vencimiento.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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 / 86

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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.

8Instrumentos 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

9Otros elementos de capital complementario que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.

10Instrumentos 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.

11Suplemento 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

12Instrumentos 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.

13Instrumentos 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.

14El 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

15Instrumentos 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.

16Compromisos 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.

17Elementos 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

18Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 11 + línea 17.

19Deducciones 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).

20Deducciones de inversiones en otros pasivos de TLAC propios, monto para ser deducido de recursos de TLAC. No aplica

21Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto.

22El 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

23APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.

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 bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.

Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos

25Indicador 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

dividido entre línea 23.

26Indicador Suplemento al Capital Neto (como porcentaje de Exposiciones totales 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.

29El 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.

## 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 la Dirección Corporativa de Riesgos, la cual a su vez está organizada en 8 áreas encaminadas a monitorear y mitigar los riesgos a los que está expuesto el Banco; lo anterior para garantizar una gestión adecuada de riesgos tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

Finalmente, la gestión de riesgos está en función de mejores prácticas internacionales



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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 / 86

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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 periodo de tiempo.

El VaR global de un día para el Banco al cierre del 31 de diciembre de 2022 fue de \$9.75 millones y su promedio durante el cuarto trimestre de 2022 fue de \$10.12 millones mismo que corresponde a un 0.013% del capital neto (\$75,058 millones a noviembre 2022, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del cuarto trimestre de 2022 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos) Cierre diciembre 2022 Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés

Derivados 883,315 889,397

Mercado de Dinero 50,863 55,585

Tipo de cambio

Cash 5,204,924

Derivados 151,412 180,677

Capitales

Derivados 19,754 19,336

VaR 1 día (millones de pesos) Cierre diciembre 2022 (Promedio)

Factor de Riesgo

Tasas de interés 10.759.71

Tipo de cambio 0.901.42

Capitales 0.000.00

VaR Global 9.7510.12

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 2022 muestra una pérdida máxima de \$11.243 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 2022, 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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de diciembre 2022 así como el promedio del cuarto de 2022 se muestran a continuación:

Scotiabank Posición	Posición
(millones de pesos)	(Cierre) (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	60,08056,798
Liquidity Buffer	
(bajo métrica CCL)	88,81685,281

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 2022 de 129% y 111% 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 2022 y en promedio para el cuarto trimestre de 2022 es la siguiente:

Scotiabank Posición	Posición
(millones de pesos)	CierrePromedio
Valor Económico (+100 pbs)	(1,066) (1,147)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(277) (282)

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 Posición Posición

(millones de pesos) Cierre Promedio

Instrumentos financieros para cobrar o vender 163,97266,507

Derivados de Cobertura 58,82051,112

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 2022 y el promedio del cuarto trimestre del 2022 fueron \$3,435 millones y \$3,259 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.

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

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

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

Concentraciones de riesgo crediticio- El Banco ha implementado políticas y

---

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

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

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

Se utilizan las siguientes Agencias Calificadoras en el método estándar: S&P, MOODY'S, FITCH, HR RATINGS, 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 \$51; 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 2022, el Banco mantiene \$915 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

Adicionalmente, durante el cuarto trimestre de 2022, el Banco informó a la Comisión sobre la decisión de constituir reservas adicionales por \$704 millones para reservar al 100% al acreditado Unifin.

#### 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 Crédito1

(Cifras al 31 de diciembre 2022) Pérdida Esperada Pérdida no Esperada

Hipotecas 0.3% 3.1%

Consumo 4.7% 12.0%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Cartera Comercial 0.6% 3.9%

Total 0.8% 4.2%

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 1

(Cifras en millones de pesos al 31 de diciembre 2022) EI 2 PISP

Hipotecas 189,071 1.61% 18.20%

Consumo 50,572 5.83% 72.25%

Cartera Comercial 304,881 1.68% 44.70%

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 2022.

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 2022 y en promedio durante el cuarto trimestre de 2022, 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 0.64% y 0.69% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

estadístico de severidad y ocurrencia, se determina la probabilidad de pérdida de los asuntos legales en curso.

Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de octubre - diciembre 2022, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$53.8 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de diciembre 2022 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$251.8 millones, donde \$8.1 millones corresponden a riesgo operacional y \$243.7 millones a 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 2022 - diciembre 2022 (T4 2022)

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

Calculo Individual T4 2022 Calculo Consolidado T4 2022  
(Cifras en millones de pesos) Importe sin ponderar (promedio) Importe ponderado  
(promedio) Importe sin ponderar (promedio) Importe ponderado (promedio)

ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES

1 Total de Activos Líquidos Computables No aplica 93,424.80 No aplica 93,424.80

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 49 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

## SALIDAS DE EFECTIVO

2Financiamiento minorista no garantizado	175,084.8614,	110.35175,	084.8614,	110.35
3Financiamiento estable	99,354.076,	537.2799,	354.076,	537.27
4Financiamiento menos estable	75,730.797,	573.0875,	730.797,	573.08
5Financiamiento mayorista no garantizado	226,138.5183,	637.43226,	138.5183,	637.43
6Depósitos operacionales	101,259.5624,	615.01101,	259.5624,	615.01
7Depósitos no operacionales	122,610.4456,	753.92122,	610.4456,	753.92
8Deuda no garantizada	2268.5014182268.	5014182268.	5014182268.	501418
9Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	36.06932692	No aplica	36.06932692
10Requerimientos adicionales:	254,735.8419,	772.14254,	735.8419,	772.14
11Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	8,289.896,	143.078,	289.896,	143.07
12Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	0000			
13Líneas de crédito y liquidez	246,445.9513,	629.06246,	445.9513,	629.06
14Otras obligaciones de financiamiento contractuales	257.1055604257.	1055604257.	1055604257.	1055604
257.1055604				
15Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,407.612,	407.612,	407.612,	407.61
16TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	120,220.71	No aplica	120,220.71
ENTRADAS DE EFECTIVO				
17Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	1,851.79334.	28471431,	851.79	
334.2847143				
18Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	44,842.2931,	201.3144,	842.29	
31,201.31				
19Otras entradas de efectivo	16,763.1616,	763.1616,	763.1616,	763.16
20TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	63,457.2448,	298.7563,	457.2448,	298.75
Importe ajustado				
21TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	93,424.80	No aplica	93,424.80
22TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	71,921.95	No aplica	71,921.95
23COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]	No aplica	129.07	No aplica	129.07

Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando.

92 días naturales

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

Durante diciembre 2022, 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 \$50,131 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$41,833 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 \$1,699 millones y \$3,435 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$15,185 millones.

### Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$18,129 millones y por operaciones de call money de \$18,227 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$15,274 millones.

### Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$88,816 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1;

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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 50 / 86

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

\$42,605 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$36,943 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 \$7,946 millones y \$1,323 millones en títulos de nivel 2.

Los cambios de los principales componentes dentro del trimestre que se reporte; Promedio de tercer trimestre 2022: 140% - promedio del cuarto trimestre 2022: 129% El coeficiente de cobertura de liquidez disminuyó 1,100 pb respecto del tercer trimestre del 2022, esto debido principalmente a:

En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$23,010 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN \$8,202 millones.

Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de \$5,811 millones.

Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en \$19,949 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en \$21,860 millones.

La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables ;

Evolución de Activos Líquidos T4-2022

Octubre 9%9%9%

Reservas en el Banco Central 17%42%42%

Nivel 1 73%47%48%

Nivel 2<sup>a</sup> 1%2%1%

Nivel 2B -%-%-%

Total de Activos Líquidos Ponderados 100%100%100%

La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento

Octubre 9%9%9%

Noviembre 9%9%9%

Diciembre 9%9%9%

CAPTACION TRADICIONAL

Depósitos de exigibilidad inmediata 45%45%43%

Depósitos a plazo

Del público en general 42%42%40%

Mercado de dinero 1%1%5%

Títulos de crédito emitidos 3%2%2%

Cuenta global de captación sin movimientos -%-%-%

Concentración de fuentes de Financiamiento

Julio 9%9%9%

Agosto 9%9%9%

Septiembre 9%9%9%

PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS

De exigibilidad inmediata -%-%-%

De corto plazo 5%6%6%

De largo plazo 4%4%4%

Total 100%100%100%

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.

(Cifras en millones de pesos)

#### Exposición Potencial Futura (diciembre 2022)

Con contrato de compensación 3,249

Sin contrato de compensación 5,017

Posibles llamadas de margen (diciembre 2022)

Colateral en Tránsito 582

Downgrade (diciembre 2022)

Baja calificación 3 niveles 3,435

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de diciembre 2022 es la siguiente:

Posición Cierre

Scotiabank-Exposición en Derivados

(cifras en millones de pesos)

Factor de Riesgo

Tasas de interés 883,315

Tipo de cambio 151,411

Capitales 19,753

Total 1,054,479

El descalce en divisas;

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

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 fondeo de corto, mediano y largo plazo, a fin de que la misma programe su estructura de fondeo para hacer frente a dichos compromisos.

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.

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 2022, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -5.60% al cierre de diciembre del 2022 y en promedio durante cuarto trimestre del 2022 fue de -5.24%

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:

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

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

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

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

Concentración de Depósitos

Concepto Límite MM

Concentración de Depósitos (MXN) 9,000 MXN

Concentración de Depósitos (USD) 150 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.

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 2022.

Descripción Promedio T4 2022 Diciembre 2022

Cash GAP 30 d - Grupo - estresado (MXN MM) 6,0669,465

Cash GAP 90 d - Grupo - estresado (MXN MM) 38,35251,899

Horizonte de Supervivencia - Banco (días) 4240

Horizonte de Supervivencia - Banco - estresado (días) 3538

Horizonte de Supervivencia - Grupo (días) 4240

Horizonte de Supervivencia - Grupo - estresado (días) 3539

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 2022 y el promedio del cuarto trimestre de 2022 son:

Scotiabank Posición

(Cierre) Posición (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 60,08056,798

Liquidity Buffer

(bajo métrica CCL) 88,81685,281

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

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.

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.

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.

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.

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 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:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

(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 2022, 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 2022, 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 2022

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

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

Durante diciembre 2022, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:

Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$166,274 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$140,540 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$82,671 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$24,827 millones y \$7,975 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$8,385 millones.

Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$337,606 y por operaciones mercado de dinero de \$14,757 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$15,825 millones, deducciones de capital por \$10,479 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$6,442 millones.

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

Promedio del tercer trimestre del 2022: 111.70% % - Promedio del cuarto trimestre del 2022: 110.84% (decremento: 86pb). El coeficiente de financiamiento neto disminuyó 86pb respecto al tercer trimestre del 2022, esto debido principalmente a:

El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 17,254 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 5,160 millones.

El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas crecieron \$16,476 millones.

La evolución de la composición del Monto de Financiamiento Estable Disponible y del Monto de Financiamiento Estable Requerido.

Monto Computable (MXN MM) Septiembre Diciembre

Financiamiento Estable Disponible 415,063,433,648

Financiamiento Estable Requerido 383,918,396,282

Coeficiente de Fondeo Estable Neto 108.11% 109.43%

El impacto en el Coeficiente de Financiamiento Estable Neto de la incorporación de las entidades objeto de consolidación.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 2022 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$16.63 millones de pesos, con una minusvalía de \$(0.20) millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe	Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
-------------	--------------------	---------	---------	---------	---------	-------	--------------------------

ScotiabankPública	1-AMX-L	250,000	4.42	4.47	(0.05)	
-------------------	---------	---------	------	------	--------	--

ScotiabankPública	1E-FRES-*	2,741	0.48	0.51	(0.03)	
-------------------	-----------	-------	------	------	--------	--

ScotiabankPública	1-GMEXICO-B	65,000	4.45	4.65	(0.20)	
-------------------	-------------	--------	------	------	--------	--

ScotiabankPública	1I-SHV-*	3,400	7.28	7.21	0.07	
-------------------	----------	-------	------	------	------	--

ScotiabankPública	1-TLEVISA-CPO	-	-	(0.01)	0.01	
-------------------	---------------	---	---	--------	------	--

<b>Total</b>		<b>321,141</b>	<b>16.63</b>	<b>16.83</b>	<b>(0.20)</b>	
--------------	--	----------------	--------------	--------------	---------------	--

Al cierre del cuarto trimestre del año 2022, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$2.39 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
-------------	--------------------	---------	---------	----------	---------	----------------------

ScotiabankPública	1-GMEXICO-B	35,000	-	(0.04)	(0.04)	
-------------------	-------------	--------	---	--------	--------	--

ScotiabankPública	1-ALFA-A	224,461	0.06	(0.02)	0.04	
-------------------	----------	---------	------	--------	------	--

ScotiabankPública	1-CEMEX-CPO	1,367,791	0.24	(0.10)	0.14	
-------------------	-------------	-----------	------	--------	------	--

ScotiabankPública	1-GMEXICO-B	180,509	0.18	(0.06)	0.12	
-------------------	-------------	---------	------	--------	------	--

ScotiabankPública	1-FEMSA-UBD	7,374	-	-	-	
-------------------	-------------	-------	---	---	---	--

ScotiabankPública	1-BACHOCO-B	75,443	0.13	(0.01)	0.12	
-------------------	-------------	--------	------	--------	------	--

ScotiabankPública	1-VOLAR-A	178,033	0.13	-	0.13	
-------------------	-----------	---------	------	---	------	--

ScotiabankPública	41-BSMX-B	35,466	0.04	-	0.04	
-------------------	-----------	--------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1-LASITE-B-1	696,220	0.15	(0.06)	0.09	
-------------------	--------------	---------	------	--------	------	--

ScotiabankPública	1E-FRES-*	100	-	(0.01)	(0.01)	
-------------------	-----------	-----	---	--------	--------	--

ScotiabankPública	1I-EWG-*	8,528	0.03	(0.12)	(0.09)	
-------------------	----------	-------	------	--------	--------	--

ScotiabankPública	1I-GDX-*	4,500	0.20	-	0.20	
-------------------	----------	-------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1I-SHV-*	1,300	0.02	-	0.02	
-------------------	----------	-------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1I-MCHI-*	7,871	0.06	(0.60)	(0.54)	
-------------------	-----------	-------	------	--------	--------	--

ScotiabankPública	1I-XLC-*	9,100	0.15	(0.10)	0.05	
-------------------	----------	-------	------	--------	------	--

ScotiabankPública	1-ALFA-A	260,000	0.45	-	0.45	
-------------------	----------	---------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1-CEMEX-CPO	251,214	0.25	-	0.25	
-------------------	-------------	---------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1-GMEXICO-B	35,000	0.18	-	0.18	
-------------------	-------------	--------	------	---	------	--

ScotiabankPública	41-BSMX-B	107,700	0.21	-	0.21	
-------------------	-----------	---------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1A-PBR-N	5,000	0.06	-	0.06	
-------------------	----------	-------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1A-BABA-N	400	0.06	-	0.06	
-------------------	-----------	-----	------	---	------	--

ScotiabankPública	1I-EWG-*	8,500	0.41	-	0.41	
-------------------	----------	-------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1I-SHV-*	1,000	-	(0.04)	(0.04)	
-------------------	----------	-------	---	--------	--------	--

ScotiabankPública	1I-MCHI-*	4,928	0.12	(0.04)	0.08	
-------------------	-----------	-------	------	--------	------	--

ScotiabankPública	1I-XLC-*	4,800	0.13	-	0.13	
-------------------	----------	-------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1-ALFA-A	120,000	0.07	-	0.07	
-------------------	----------	---------	------	---	------	--

ScotiabankPública	1-GMEXICO-B	40,176	0.05	(0.01)	0.04	
-------------------	-------------	--------	------	--------	------	--

ScotiabankPública	41-BSMX-B	73,138	0.08	-	0.08	
-------------------	-----------	--------	------	---	------	--

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 58 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

ScotiabankPública1B-NAFTRAC-ISHRS	128,335	-	(0.01)	(0.01)
ScotiabankPública1I-EWZ-*	5,500	0.18	-	0.18
ScotiabankPública1I-SHV-*	2,122	0.02	(0.05)	(0.03)
ScotiabankPública1I-IB01-N	160	-	-	-
ScotiabankPública1-MEGA-CPO	257	-	-	-
Total	3,879,926	3.66	(1.27)	2.39

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	---			
Total			9,317	---			

Al 31 de diciembre de 2022, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$5.30 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$3.90 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.40 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	P O S I C I O N E S	Coeficiente de Riesgo de mercado
Requerimiento de capital		
Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición
Por Riesgo General de Mercado	17.54-17.54	22.23% 3.90
Por riesgo específico		
Canasta de acciones,	16.63-16.63	8.00% 1.32
Índices accionarios	0.92-0.92	4.00% 0.04
Requerimiento por riesgos específico	0.92-0.92	4.00% 0.04
Total Requerimiento de capital		5.30

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

REFERENCIARUBROsep-22dic-22

Exposiciones dentro del balance

1Partidas 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) 677,236 712,010

2(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) (10,414) (10,616)

3Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) 666,822 701,395

Exposiciones a instrumentos financieros derivados

4Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible) 8,682 7,019

5Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados 3,997 3,819

6Incremento 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) (1,942) (1,941)

8(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 59 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)

9Importe nominal efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos

10(Compensaciones realizadas al nominal efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)

11Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)  
10,737 8,897

Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores

12Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas 795 3,224

13(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) (294) (1,223)

14Exposición Riesgo de Contraparte por SFT - -

15Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros - -

16Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) 501 2,001

Otras exposiciones fuera de balance

17Exposición fuera de balance (importe nominal bruto) 256,309 264,565

18(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) (167,625) (168,959)

19Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) 88,684 95,606

Capital y exposiciones totales

20Capital de Nivel 1 70,556 68,247

21Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) 766,745 807,899

Coeficiente de apalancamiento

22Coeficiente de apalancamiento de Basilea III 9.20% 8.45%

Cifras en millones de pesos

## TABLA II.1

### COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIA DESCRIPCIÓN sep-22 dic-22

1 Activos totales 717,947 751,487

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 (808) (612)

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 (29,178) (27,355)

5 Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores (294) (1,223)

6 Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden 88,684 95,606

7 Otros ajustes (9,606) (10,003)

8 Exposición del coeficiente de apalancamiento 766,745 807,898.7

## TABLA III.1

### CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIA DESCRIPCIÓN sep-22 dic-22

1 Activos totales 717,947 751,487

2 Operaciones en instrumentos financieros derivados (39,915) (36,252)

3 Operaciones en reporto y prestamos de valores (795) (3,224)

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 677,237 712,010

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

## TABLA IV.1

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

CONCEPTO/PERIODOsep-22dic-22Variación

Capital Básico 1/ 70,556 68,247 -3.3%

Activos Ajustados 2/ 766,745 807,899 5.4%

Razón de Apalancamiento 3/9.20%8.45%-75pb

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 2022.

El indicador se ubicó en 8.45%, 75pb inferior respecto al trimestre anterior, debido principalmente al incremento en las exposiciones totales por \$41,154 millones (-45 pb) y por la disminución en el capital de nivel 1 por \$2,308 millones (-30 pb).

La variación de -45pb se debe principalmente al incremento en las exposiciones dentro del balance (netas) por \$34,572 millones (-39pb) y en las exposiciones fuera del balance por \$6,922 millones (-7pb).

El Capital de Nivel 1 mostró una disminución trimestral de \$2,308 millones (-30pb), debido principalmente por decretos de dividendos en oct-22 y dic-22 por \$2,400 y \$2,000 millones respectivamente.

## TABLA I.2

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

REFERENCIAEXPLICACIÓN

1Total 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.

2Monto 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.

3Suma de las líneas 1 y 2

4Costo 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:

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.

La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.

El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.

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.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 61 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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)

de operaciones de reporto y préstamo de valores. El importe no deberá considerar ninguna compensación conforme a los Criterios Contables.

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:

Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.

Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.

Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.

Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 62 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 DESCRIPCIÓN

1 Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2 Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos b), d), e), f), g), h), i), j) y l) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

El monto se debe registrar con signo negativo.

3 No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

4 Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 11 de la Tabla I.1 y la cifra presentada en operaciones con instrumentos financieros derivados contenidos en el balance de la Institución.

El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.

5 Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 16 de la Tabla I.1 y la cifra presentada por operaciones de reporto y préstamo de valores contenidos en el balance de la Institución.

El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.

6 Importe registrado en la fila 19 de la Tabla I.1. El monto se debe registrar con signo positivo.

7 Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos c), k), m), n), p), q) y r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.

8 Suma de las líneas 1 a 7, la cual debe coincidir con la línea 21 de la Tabla I.1.

## TABLA III.2

NOTAS A LA CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIA DESCRIPCIÓN

1 Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2 El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados presentadas en el activo de los últimos estados financieros.

El monto se debe registrar con signo negativo.

3 El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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'smxAAAmxA-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"

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 64 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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".

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de diciembre del 2022, 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\$60,974 millones de pesos.  
Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$66,325 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 2022, 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:

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 en los siguientes rubros:

Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

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.

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.

Manual de Operación de Derivados.

Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

Política de Riesgo de Contraparte

Política de Sobregiros

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con

derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados. Durante el cuarto trimestre de 2022, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a 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
1.	Flujos de Efectivo	Pagarés con rendimiento	liquidable al vencimiento	tasa fija	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés
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
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)

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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.

\*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.

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 2022 y en promedio para el cuarto trimestre de 2022 es de:

Scotiabank Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 60,08056,798

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 88,81685,281

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

Inventario de modelos de derivados

Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration - Grupo Financiero Scotiabank (México).

El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los aplicativos desarrollados en casa matriz (K2 & Wall Street).

Clase de activo Derivado Tipo Breve descripción

Tasas de interés Opciones Europea Caps, Floors:



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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 / 86

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets.

$$\text{Cap} = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$$

Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet.

$$\text{Floor} = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$$

Binaria La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:

Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap).

Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).

IRSEL intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).

CCIRS Intercambio de intereses en moneda

nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.

Tipo de cambio Opciones Europea En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.

Americana El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)

Binaria Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción.

A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.

Barrera Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento  $S_T$ , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento  $S_{(t < T)}$ , son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria.

Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente  $S_T$  alcance un umbral preestablecido  $H$  llamado barrera de la opción.

Forward Forward OTC Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

Instrumentos a Valor Razonable

Clase de activo Derivado Tipo Breve descripción

Índices, capitales y metales Opciones

Europea Opción Europea Call / Put: Este tipo de contratos utiliza la fórmula de Black-Scholes.

Opción Europea Quanto: Una opción tipo Quanto es un derivado en el cual el subyacente se denomina en una moneda, pero el instrumento en sí se liquida en otra moneda a una tasa determinada. Tales productos son atractivos para los inversionistas que desean estar expuestos a un activo extranjero, pero sin el riesgo de tipo de cambio equivalente.

Binaria Tipo de opción la cual al vencimiento solo tiene dos eventos pagar o no pagar un monto previamente definido.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Derivados listados Mexder Futures IRLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre Contrato de Intercambio de Flujos de Tasas son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

FXLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre el tipo de cambio son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

Instrumentos valuados a costo

Clase de activo Nombre de producto Metodología Notas

FI Security Bonos Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

EQ Cash Acciones Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Fondos de inversión ETFs Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Notas Estructuradas listadas Bonos Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Políticas 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

Tesorería: Call Money

Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

Cambios: FOREX

Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 75 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

un cambio de 1 (0.01%) y 100 puntos básicos en las tasas de interés (1%).

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

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

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

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios 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 2022 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 2022 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 77 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 2022 y promedio del cuarto trimestre 2022 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank PosiciónPosición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 88,81685,281

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 NormalEscenario PosibleEscenario ProbableEscenario de Estrés

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

(millones de pesos)

Gap 30d Gap Acum60,08056,64556,64556,645

Cambios en el Gap respecto al escenario normal(3,435) (3,435) (3,435)

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.



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 79 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

## 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 continúa 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

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa.

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a diciembre 31, 2022:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total	Today
Swaps	(17,639.15)	(5,530.18)	(246,330.40)	130,512.45	38,481.49	(60,128.23)	(160,634.02)	
CCS	24,720.66	(2,255.17)	(1,493.87)	344.74	258.56	(28.73)	21,546.19	
Caps&Floors	158.01	(57.46)	158.01	57.45	--	--	316.01	
Binary Caps&Floors	-----							
TIIE Futures	-----							
Mbonds Futures	-----							
Total DERIVATIVES	7,239.52	(7,842.81)	(247,666.26)	130,914.64	38,740.05	(60,156.96)		

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

(138,771.82)

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 las 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 (173.82) Millones de pesos.
- b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (347.65) Millones de pesos.
- c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (862.18) 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 (0.14) 91.9250.00 (6.94) 100.00 (13.88) 200.00 (27.75)

Volatilidad al 1% Caps & Floors - (0.13) 0.10-0.40-1.00-

a FX %Forwards 85.541,668.850.10 (166.88) 0.20 (333.77) 0.50 (834.43)

a FX %Opciones Divisa --0.10-0.20-0.50-

Total (173.82) (347.65) (862.18)

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 2022 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Delta Vega Gamma

Options AMD.OQ ---

Options BNPUI5.INDX 56,450.00 2,076.00 12,747.00

Options DIS.N ---

Options ENHFO5.INDX ---

Options ENHGE5.INDX ---

Options EZU.P ---

Options FXI.P ---

Options GLD.P ---

Options ICLN.OQ ---

Options IDBTV1.INDX ---

Options MCHI.OQ ---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Options MSFDV1.INDX---  
Options MSFDVG.INDX14,727.00238.003,444.00  
Options NVDA.OQ---  
Options QQQ.OQ---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPXSR5.INDX---  
TOTAL71,177.002,314.0016,191.00

## Análisis de Stress

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

### Escenarios a la Baja

(0.1) (0.3) (0.5)  
Options AMD.OQ---  
Options BNPUI5.INDX(5,645.00) (16,935.00) (28,225.00)  
Options DIS.N---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options EZU.P---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options ICLN.OQ---  
Options MEXIBX.INDX---  
Options MXSXAE.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM(1,472.70) (4,418.10) (7,363.50)  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
TOTAL(7,117.70) (21,353.10) (35,588.50)

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

### Escenarios a la Alza

0.050.150.2  
Options AMD.OQ---  
Options BNPUI5.INDX2,822.508,467.5011,290.00  
Options DIS.N---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options EZU.P---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options ICLN.OQ---  
Options MEXIBX.INDX---  
Options MXSXAE.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM736.352,209.052,945.40  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

TOTAL3,558.8510,676.5514,235.40

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del EscenarioMonto  
Probable(7,117.70)  
Poco Probable(21,353.10)  
Muy poco Probable(35,588.50)

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 2022 se tienen los siguientes saldos:

Cifras expresadas en pesos

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado

CLIENTE 1MXN16,500,000(30,200,000)  
CLIENTE 2MXN407,000,000(512,000,000)  
CLIENTE 3MXN308,600,000(50,500,000)  
CLIENTE 4MXN43,400,000(46,000,000)  
CLIENTE 5MXN373,000,213(1,252,945,689)  
CLIENTE 6USD49,090,000(45,260,000)  
CLIENTE 7USD23,030,000(7,640,000)  
CLIENTE 8USD96,400,000(316,000,000)  
CLIENTE 9USD960,000-  
CLIENTE 10USD5,740,000(4,690,000)  
CLIENTE 11USD17,290,000(13,400,000)  
CLIENTE 12USD5,500,000(2,740,000)  
CLIENTE 13MXN240,700,000(541,300,000)  
CLIENTE 14MXN102,700,000(219,600,000)  
CLIENTE 15MXN221,700,000(137,800,000)  
CLIENTE 16MXN552,700,000(5,848,700,000)  
CLIENTE 17MXN48,878,224(4,495,200,000)  
CLIENTE 18MXN5,300,000(1,100,000)  
CLIENTE 19USD4,990,000(9,500,000)  
CLIENTE 20USD3,840,000(1,070,000)  
CLIENTE 21MXN6,600,000-  
CLIENTE 22USD4,140,000(3,250,000)  
TOTAL2,538,058,437(13,538,895,689)

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: **2022**

**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 83 / 86

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 84 / 86

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Liquidados anticipadamente

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 85 / 86

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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		
Caps & Floors	oct-22	Cliente 1USD1,406
Discrepancia		Liquidación
Forwards FX	oct-22	Cliente 2USD135,000
No fondeo su cuenta		
Forwards FX	oct-22	Cliente 3USD142,000
No fondeo su cuenta		
Interest Rate Swap	oct-22	Cliente 4MXN151,278
No envío los fondos		
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 5MXN(22,318)
No se liquida		
Forwards FX	oct-22	Cliente 6MXN830,333
Problemas orden de pago		
LLAMADA DE MARGEN	oct-22	Cliente 7MXN1,800,000
No envío los fondos		
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 8MXN(15,237)
No se liquida		
Interest Rate Swap		Cliente 9MXN(130,018)
No se liquida		
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 10MXN(9,563)
No se liquida		
Forwards FX	nov-22	Cliente 11USD40,000,000
No envío los fondos		
Forwards FX	nov-22	Cliente 12MXN20,198,411
No envío los fondos		
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 13MXN1,623,351
No envío los fondos		
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 14MXN548,712
No envío los fondos		
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 15MXN540,556
No envío los fondos		
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 16MXN137,667
No envío los fondos		
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 17MXN131,250
No envío los fondos		
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 18MXN64,904
No envío los fondos		
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 19MXN54,115
No envío los fondos		
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 20MXN50,063
No envío los fondos		
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 21MXN46,823
No envío los fondos		
Interest Rate Swap		Cliente 22MXN(408,398)
No se liquida		
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 23MXN2,172,412
No envío los fondos		
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 24MXN100,268
No envío los fondos		
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 25MXN2,250,550
No envío los fondos		
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 26MXN195,700
No envío los fondos		
Forwards FX	nov-22	Cliente 27MXN20,272,000
No fondeo su cuenta		
Equity Options		Cliente 28MXN31,000
No envío los fondos		
Interest Rate Swap		Cliente 29MXN(319,098)
No se liquida		
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 30MXN(12,627)
No se liquida		
Interest Rate Swap		Cliente 31MXN(592,016)
No se liquida		

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

**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 86 / 86  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

Cross Currency Swapsdic-22Cliente 32MXN2,172,412No fondeo su cuenta  
Cross Currency Swapsdic-22Cliente 33MXN72,775No fondeo su cuenta  
Equity Optionsdic-22Cliente 34MXN5,737,346No envio los fondos  
Caps & Floorsdic-22Cliente 35MXN7,150No envio los fondos  
Forwards FXdic-22Cliente 36MXN251,097No envio los fondos  
Forwards FXdic-22Cliente 37MXN93,408No envio los fondos  
Forwards FXdic-22Cliente 38MXN17,665No envio los fondos  
Caps & Floorsdic-22Cliente 39USD12,008No envio los fondos

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte  
Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(1) Autorización y bases de presentación-

## Autorización

El 29 de marzo de 2023, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y Berenice Martínez Mendoza (Director Finanzas) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

Los estados financieros consolidados del Banco incluyen los de las subsidiarias en las que ejerce control: la Inmobiliaria, Scotia Servicios y Scotia Derivados. Los saldos y operaciones importantes con estas compañías se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2022.

De conformidad con la Ley General de Sociedades Mercantiles (LGSM), los estatutos del Banco 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 2022 adjuntos se someterán a la aprobación de los Accionistas.

(  
Bases de presentación

## a) Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados están preparados con fundamento en la legislación bancaria y de acuerdo con los criterios de contabilidad para instituciones de crédito en México (los Criterios de Contabilidad) establecidos en el Anexo 33 de las Disposiciones, y las reglas de operación aplicables, establecidos por la Comisión, quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las instituciones de crédito y realiza la revisión de su información financiera.

Los Criterios de Contabilidad establecen que la contabilidad de las instituciones de crédito 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 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, 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP) 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.

## b) Información financiera comparativa

El 13 de marzo de 2020 se publicó en el Diario Oficial de la Federación la resolución que modifica las Disposiciones, la cual establece que las instituciones de crédito reconozcan el efecto de los cambios contables que surgen de dicha resolución en utilidades retenidas, sin reformular los estados financieros de ejercicios anteriores al 1 de enero de 2022, y que los estados financieros básicos consolidados al y por el año terminado el 31 de diciembre de 2021, no se presenten.

## c) 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 - Derivados: 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 - Arrendamientos: determinación de si un acuerdo contiene un arrendamiento.

## 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 7 - Inversiones en instrumentos financieros: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.

-Nota 3 - Valuación de instrumentos financieros derivados: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo.

-Nota 10 - 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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 3 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

-Nota 20 - Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves.

Determinación del valor razonable

Algunas de las políticas y revelaciones contables del Banco requieren la medición de los valores razonables tanto de los activos y pasivos financieros como de los no financieros.

El Banco 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 Banco 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 Banco 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 Banco.

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 Banco 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, correspondiente a precios obtenidos exclusivamente con datos de entrada de Nivel 1.

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) que corresponde a precios obtenidos con datos de entrada nivel 2.

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, para aquellos previos obtenidos con datos de entrada nivel 3.

Los instrumentos financieros que son valuados mediante el uso de un modelo de valuación

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 4 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

interno del Banco 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.

Conforme a lo establecido en las Disposiciones, el Banco 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 Banco el precio actualizado para valuación proporcionado por un proveedor de precios:

I. Valores inscritos en el registro nacional de valores o autorizados, inscritos o regulados en mercados reconocidos por la Comisión.

II. Instrumentos financieros derivados que cotizan en bolsas de derivados nacionales o que pertenecen a mercados reconocidos por el Banco Central.

III. 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 Banco 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 el año terminado el 31 de diciembre de 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 Banco, su baja complejidad y por la disminución de la volatilidad en los mercados financieros en 2022.

Al 31 de diciembre de 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 Banco, 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 Banco 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 7 - Inversión en instrumentos financieros; y
- Nota 9 - Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura.

d) 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,

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

cuando se hace referencia a pesos o "\$", se trata de millones de pesos mexicanos, y cuando se hace referencia a dólares o USD, se trata de millones de dólares de los Estados Unidos de América.

## e) Presentación del resultado integral

En cumplimiento con el criterio contable D-2 "Estado de resultado integral" establecido por la Comisión, el Banco 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".

## f) 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.

## (2) 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 presentan, excepto por lo que se indica en la nota 4 que incluye los cambios contables reconocidos durante el ejercicio.

### (a) 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 Banco 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	UDIDel añoAcumulada
2022	7.64687.58%19.50%
2021	7.10827.61%14.16%
2020	6.60563.23%11.31%

### (b) Bases de consolidación

Los estados financieros consolidados incluyen los del Banco, S. A. 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 2022, los que se prepararon de acuerdo con los

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 6 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Criterios de Contabilidad establecidos por la Comisión.

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2022, se detallan a continuación:

Subsidiaria	Participación	Ubicación	Actividad
Inmobiliaria	99.99%	Ciudad de México	Administración de activo fijo
Scotia Servicios	99.99%	Ciudad de México	Apoya la administración del negocio adquirente de tarjeta de crédito
Scotia Derivados	100%	Ciudad de México	Operador de contratos de futuros y opciones en Mexder

(c) Operaciones en moneda extranjera

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio 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 periodo en que se originan.

(d) 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 Banco 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.

(e) 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 compra 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 correspondientes, documentos de cobro inmediato, metales preciosos amonedados e inversiones disponibles a la vista.

La valuación de los equivalentes de efectivo representados por metales preciosos amonedados se realiza a su valor razonable, considerándose como tal a la cotización

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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; en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de efectivo y equivalentes de efectivo. 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".

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.

## (f) Cuentas de margen

Las cuentas de margen están asociadas a transacciones con instrumentos financieros derivados celebrados en mercados o bolsas reconocidos, 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 Banco 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.

## (g) 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 8 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 Banco 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.

Los instrumentos financieros no se reclasifican después de su reconocimiento inicial, excepto si el Banco 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 Banco

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 9/ 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 Banco.

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2022, el Banco no llevó a cabo transferencias entre categorías.

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:

-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 como se menciona en la hoja siguiente.

-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 Banco realiza una evaluación del objetivo del modelo de negocio en el que se mantiene un instrumento financiero a nivel del portafolio, ya que esto es lo que mejor refleja la manera en que se administra el negocio y se entrega la información a la Administración. La información considerada incluye lo que se muestra a continuación:

-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 Banco;

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

–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 periodos 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 Banco.

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 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 SPPI, el Banco 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 Banco 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;

–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 Banco 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 11 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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 compra venta dentro de dicho rubro.

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

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio neto a favor 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.

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 Banco 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 12 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

la propiedad del instrumento financiero, o en la cual el Banco no transfiere ni retiene sustancialmente todos los riesgos y beneficios relacionados con la propiedad y no retiene el control sobre los instrumentos financieros.

El Banco participa en transacciones en las que transfiere los instrumentos reconocidos en su estado de situación financiera, 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 Banco 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 Banco 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.

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 Banco 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 Banco y en una evaluación de crédito informada e incluyendo información prospectiva.

El Banco 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.

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 periodo en que ocurren dichos cambios, contra la utilidad o pérdida neta del periodo, 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".

#### (h) 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 13 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

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 Banco 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 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.

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 que se recibidos como colateral, se registran en cuentas de orden y se valúan a valor razonable.

En caso de que el Banco 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, 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.

(i) 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.

Actuando como prestamista-

A la fecha de la contratación del préstamo de valores actuando como prestamista, el Banco 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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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-

Actuando como prestatario, a la fecha de la contratación del préstamo de valores, el Banco 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 Banco. 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.

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".

(j) Instrumentos financieros derivados y operaciones de cobertura (IFD)

El Banco 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 Banco 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 Banco 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 Banco 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".

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.

Operaciones con fines de negociación-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 15/ 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

-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.

-Contratos adelantados ("forwards") y 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. 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.

-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.

-Swaps:

Su saldo representa la diferencia entre el valor razonable de la parte activa y de la parte pasiva.

Operaciones con fines de cobertura-

El Banco utiliza instrumentos financieros derivados con el objetivo de manejar adecuadamente los riesgos de tasas de interés y de tipos de cambio inherentes a las 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 Banco, 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 Banco documenta el objetivo y estrategia de gestión de riesgos para llevar a cabo la cobertura. El Banco 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, 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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 16 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 descontinuarse 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 Banco.

Derivados implícitos-

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

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que por medio de 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 "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, neto", 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.



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 financieros OTC por el riesgo asociado a la exposición crediticia asumida con cada contraparte.

Actualmente el Banco 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 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 Banco asumido por sus contrapartes en derivados financieros OTC.

Todos los valores razonables de los instrumentos financieros se calculan diariamente.

## (k) 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 "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.

La estimación de pérdidas crediticias esperadas correspondiente a los montos por cobrar antes mencionados, deberá determinarse de conformidad con lo establecido en la NIF C-16 "Deterioro de instrumentos financieros por cobrar".

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, o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

## (l) Cartera de crédito

La cartera de crédito se compone de financiamientos otorgados a clientes por el Banco a través de contratos de crédito, operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito financiero, los cuales se reconocen cuando son originados y, en caso de

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 18 / 11  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

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.

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

La cartera de crédito se presenta en las categorías de comercial, hipotecaria de vivienda y consumo, conforme a lo descrito a continuación.

Créditos comerciales. Incluye los créditos mencionados a continuación:

- a) los otorgados a personas morales o personas físicas con actividad empresarial y destinados a su giro comercial o financiero;
  - b) créditos otorgados a entidades financieras distintos de los préstamos interbancarios con un plazo menor a 3 días hábiles;
  - c) créditos por operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito;
  - d) 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;
  - e) los créditos concedidos al Gobierno Federal, entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados y los créditos a empresas productivas del estado, y
  - f) aquellos con garantía expresa de la Federación registrados ante la SHCP y el Banco Central, así como los garantizados expresamente por las entidades federativas,
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 19/ 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 Banco. 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).

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 créditos.

Las obligaciones y derechos que el INFONAVIT tienen sobre los créditos adquiridos son las siguientes:

-El Banco 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 Banco 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 Banco 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 Banco, 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 Banco 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 Banco la titularidad de derechos de crédito, siendo distintas de las adquisiciones de cartera de crédito.

Para cualquiera de las operaciones mencionadas anteriormente, el Banco 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 Banco, 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 3r.

#### 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 Banco la administra. El Banco considera lo siguiente:

- a) La forma en cómo se determina e informa el desempeño de la cartera de crédito.
- b) Los riesgos que afectan el desempeño del modelo de negocio y de la cartera de crédito y cómo son administrados esos riesgos.
- c) 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 Banco 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 Banco 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, VSM, UMA o UDI);
- concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito;
- 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.

No obstante lo anterior, el Banco 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 Banco 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 Banco considera que existe un nuevo crédito, por

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 Banco, 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.

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco 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 períodos 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 3o).

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco 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 períodos 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.
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 23 / 11  
**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

---

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:

1. Aquéllos por los que el Banco tiene conocimiento de que el acreditado ha sido declarado en concurso mercantil.

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 incurren en los supuestos previstos por el numeral 2 siguiente.

2. 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:

a. Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b. 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.

3. 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 se muestra a continuación:

a. Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b. 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.

c. Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

4. Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de "Efectivo y equivalentes de efectivo", al momento en que no han sido cobrados.

5. 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 24 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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:

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

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 Banco considera las siguientes equivalencias:

Periodicidad de pago	contractual	Equivalencia
30 días	90 días	
Quincenal	2 quincenas	Más de 6 quincenas
Catorcenal	2 catorcenas	Más de 6 catorcenas
Decenal	3 decenas	Más de 9 decenas
Semanal	4 semanas	Más de 13 semanas

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 3:

- 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 períodos consecutivos inmediatos anteriores.
- Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda. Cuando presentan atrasos de 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 período 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, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a Etapa 1.

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

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 11  
**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

---

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.

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:

- a) se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y
- b) 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.

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:

- a) el acreditado ha cubierto la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración, y
- b) el acreditado ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o 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:

- a) se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración
- b) se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto, y
- c) se ha cubierto el 60% del monto original del crédito.

Si no se cumplen todas las condiciones descritas en los dos párrafos anteriores, según

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 26 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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.

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 periodo 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 Banco 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 Banco a un mismo acreditado mediante una reestructura o renovación, se analiza cada uno de los créditos consolidados como si se reestructuraran o renovar 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.

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:

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 27 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

- a) 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.
- b) Para créditos con periodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.
- c) En el caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 90 días naturales, se realiza el pago de una amortización.

Cuando los periodos de amortización pactados en la reestructura o renovación no son homogéneos, se considera el número de periodos que representan el plazo más extenso, conforme a lo descrito previamente.

Para reestructuras en las que se modifica la periodicidad del pago a periodos 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 Banco 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.

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

- a) El acreditado ha cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,
- b) 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:

- a) El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura o renovación;
- b) 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
- c) 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.

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 hasta acreditar pago sostenido 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 Banco 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:

- a) probabilidad de incumplimiento intrínseca del acreditado,
- b) las garantías otorgadas al crédito reestructurado o renovado,
- c) la prelación de pago frente a otros acreedores y,
- d) la liquidez del acreditado ante la nueva estructura financiera del financiamiento.

#### Reconocimiento de ingresos, costos y gastos

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 Banco realiza lo siguiente:

1. 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 Banco documenta la evidencia correspondiente.
2. 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.
3. Determinar la tasa de interés efectiva. Representa la relación entre el interés efectivo y el monto neto financiado.

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; sin embargo, en aquellos casos en que no

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PÁGINA 29 / 11  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

sea posible estimar confiablemente los flujos de efectivo futuros o la vida estimada del o de los créditos, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales, previa autorización del Comité de Crédito.

El Banco considera que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito son confiablemente estimados en la mayoría de las circunstancias, sin embargo, en aquellos casos en que no es posible estimarlos confiablemente, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales, documentando las circunstancias y hechos que llevaron a dicha conclusión, lo cual es autorizado por el 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".

(m) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

Con base al párrafo 3 del criterio A-4 "Aplicación Supletoria a los Criterios de Contabilidad" emitido por la Comisión, el Banco había adoptado la NIIF 15 "Ingresos provenientes de contratos con clientes" el cual incorpora el reconocimiento de ingresos derivados de programas de fidelización con clientes, y por lo tanto la IFRIC 13 "Programa de fidelidad de clientes" queda sin efecto. De acuerdo con la NIIF 15, una porción de los ingresos por cuota de intercambio se difiere en el momento en que se identifican las obligaciones de cumplir, es decir, de entregar los premios a los que los clientes tienen derecho y se amortizan contra resultados una vez que se satisface dicha obligación de cumplir.

(n) Partidas diferidas

Se integra por el monto neto entre costos de transacción y comisiones por otorgamiento de crédito.

(o) 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).

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 30 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tratándose de líneas de crédito comprometidas no dispuestas, el Banco reconoce la estimación correspondiente al saldo no dispuesto conforme a las Disposiciones, lo cual también es aplicable a las cartas de crédito que el Banco 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.

a) 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).

b) Se considera probable que el deudor no abone la totalidad de sus obligaciones crediticias frente al Banco.

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 determina conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

En su caso, el Banco determina o reconoce las estimaciones adicionales ordenadas por la Comisión, 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 Banco informa a la Comisión sobre lo siguiente:

- a) origen de las estimaciones;
- b) metodología para su determinación;
- c) monto de estimaciones por constituir, y
- d) tiempo que se estima serán necesarias.

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 Banco 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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 31 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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:

a) Con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

b) 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 Banco 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 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 medida, el cálculo de la SP considera dicha cobertura.

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 Banco, 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, ix) prórroga.

En caso de que los créditos cuenten con seguros de crédito, éstos son considerados en

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 32 / 11  
CONSOLIDADO  
Impresión Final

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 Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia; así como, viii) antigüedad del acreditado en el Banco 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.

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 Banco, (v) antigüedad del acreditado con instituciones, (vi) monto a pagar al Banco, (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 Banco son clasificadas conforme a su grado de riesgo, de acuerdo con la tabla que se muestra a continuación:

Rangos de porcentaje de estimación preventiva

GradoConsumo

de riesgoNo RevolventeTarjeta de crédito y otros créditos revolventesHipotecario y de vivienda Comercial

DeADeADeADeA

A-10%2.0%0%3.0%0%0.50%0%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%



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 33 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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 y recuperaciones de cartera de crédito

El Banco 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 Banco reconoce una estimación hasta por el monto de la diferencia.

En todo caso, el Banco 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.

Cualquier recuperación derivada de créditos previamente es reconocida en los resultados consolidados del ejercicio dentro del rubro de "Estimación 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 3r.

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 Banco 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 Banco previamente constituye estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

La cancelación de la estimación preventiva 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.

(p)Otras cuentas por cobrar, neto

Se integra 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 34 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

adeudos del personal, amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas y otros deudores.

Estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro-

El Banco constituye una estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro por las cuentas por cobrar conforme a lo que se muestra a continuación:

Origen de la cuenta por cobrar Criterio de reconocimiento de la estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro

Cuentas liquidadoras. Se clasifican como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Otras cuentas por cobrar directamente relacionadas con la cartera de crédito, tales como gastos de juicio. Se aplica el mismo porcentaje de riesgo asignado para el crédito asociado para la constitución de la estimación.

Documentos de cobro inmediato no cobrados con 15 o más días naturales de haber sido registrados como "Otras cuentas por cobrar, neto". Se clasifican como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

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.

Préstamos a funcionarios y empleados, derechos de cobro y otras cuentas por cobrar diversas pactadas desde su origen. El Banco determina un grado de irrecuperabilidad con base en su experiencia de pérdidas crediticias pasadas, cambios actuales en el comportamiento de sus clientes y provisiones económicas futuras, para lo cual clasifica sus cuentas por cobrar por grado de atraso en pago y asigna diferentes montos de PCE a cada uno de los segmentos de sus cuentas por cobrar.

Amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas en 30 días naturales posteriores a su vencimiento. Se constituye una estimación por el importe total.

Otras cuentas por cobrar distintas a las anteriores de deudores no identificados con 60 días o más de haber sido registrados. Se constituye una estimación por el importe total.

No se reconoce estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro sobre los saldos de impuestos a favor ni por el Impuesto al Valor Agregado (IVA) acreditable.

(q) Arrendamientos

Actuando como arrendador

Clasificación de los arrendamientos

El Banco 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 Banco 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 Banco 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 periodo de tiempo a cambio de una contraprestación. El Banco 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 Banco asigna la contraprestación en el contrato a cada componente de arrendamiento o servicio sobre la base de sus precios independientes relativos.

El Banco 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 dismantelar 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 Banco al final del plazo del arrendamiento o el costo del activo por derecho de uso refleja que el Banco 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.

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 Banco o la tasa libre de riesgo determinada con referencia al plazo del arrendamiento. Generalmente, el Banco usa su tasa de interés incremental como tasa de descuento.

El Banco 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:

- 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 Banco está razonablemente seguro de ejercer, los pagos de arrendamiento en un período de renovación opcional si el Banco está razonablemente seguro de ejercer una opción de extensión y las sanciones por la terminación anticipada de un arrendamiento a menos que el Banco esté razonablemente seguro de no terminar antes de tiempo.
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 36 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

El pasivo por arrendamiento se valúa al costo amortizado utilizando el método de interés efectivo. Se vuelve a valuar cuando hay un cambio en los pagos de arrendamiento futuros que surgen de un cambio en un índice o tasa, si hay un cambio en la estimación del Banco, del monto que se espera pagar bajo una garantía de valor residual, si el Banco cambia su evaluación de si ejercerá una opción de compra, extensión o terminación o si hay un pago en sustancia fijo de arrendamiento modificado.

Cuando el pasivo por arrendamiento se vuelve a valuar 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 Banco 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.

Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

El Banco 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 Banco reconoce los pagos de arrendamiento asociados con estos arrendamientos como un gasto en línea recta durante el plazo del arrendamiento.

(r) Bienes adjudicados

Los bienes adjudicados o recibidos mediante dación en pago que no son destinados para uso del Banco, 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:

- a) 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, cuando la intención de la entidad es vender dichos activos para recuperar el monto a cobrar; o
- b) 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 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 37 / 11  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

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 Banco 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 a continuación:

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%

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 Banco

Cuando el Banco 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 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.

(s) Propiedades, mobiliario y equipo

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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 38 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

La depreciación se calcula usando el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del Banco de los activos correspondientes.

El monto a depreciar de 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 Banco evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichas propiedades, mobiliario y equipo.

El Banco 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 Banco reconoce el deterioro con cargo a los resultados del ejercicio para reducirlos a este último monto. Los gastos de mantenimiento y reparaciones menores se registran en los resultados cuando se incurren.

## (t) Inversiones permanentes

Las inversiones permanentes en las que el Banco 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 consolidados a la misma fecha y por el mismo periodo que el Banco. Se considera que una empresa es subsidiaria del Banco, 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 periodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

Al 31 de diciembre de 2022, no se reconocieron pérdidas por deterioro en las otras inversiones permanentes.

## (u) Activos de larga duración disponibles para su venta

Los activos de larga duración se clasifican como disponibles para su venta si cumplen todos los requisitos que se muestran a continuación:

- a) El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.
- b) Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.
- c) Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 39 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

identificado el mercado potencial.

d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que 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.

e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.

f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

(v) 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 "Otros activos", en tanto que la PTU causada se reconoce en el rubro de "Beneficios a 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.

(w) Otros activos

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 40 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la administración del Banco.

Ante la presencia de algún indicio de deterioro del valor de un activo, se determina la posible pérdida por deterioro, y en caso de que el valor de recuperación sea menor al valor neto en libros se reduce el valor del activo y se reconoce la pérdida por deterioro en los resultados del ejercicio.

(x) 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:

a) 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 Banco, 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 Banco constituye simultáneamente a dicha clasificación una estimación de irrecuperabilidad por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

b) 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.

c) Títulos de crédito. Se integran de, entre otros, los bonos bancarios y los certificados bursátiles.

d) 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 Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto 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 Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva con base en lo establecido en la NIF C-19 "Instrumentos Financieros por pagar" 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

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 41 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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".

Los gastos de emisión, así como el descuento o premio en la colocación se reconocen como un cargo o crédito diferido, 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.

(y) Obligaciones subordinadas en circulación

Por las obligaciones subordinadas en circulación reúnen las características establecidas por la NIF

C-12 "Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital", el principal del 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.

(z) 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 Banco 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 Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva, para el cálculo el Banco 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 Banco 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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 42 / 11  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

(aa) 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.

Los pasivos del Banco 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 vencimiento se encuentran claramente establecidos.

El Banco 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.

(bb) 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 Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Banco en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida- ver inciso (v) de esa nota y que se espera que el Banco 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 Banco 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 Banco correspondiente a los planes de beneficios definidos por

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 43 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 Banco 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 20).

Planes de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos se realiza anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el período, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del período.

Las 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.

(cc) 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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 44 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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.

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 en un período de 12 a 360 meses, 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.

(dd) Concentración de negocio y crédito

Los productos del Banco se comercializan con un gran número de clientes, sin que exista concentración importante en algún cliente específico.

(ee) 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 Banco 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 45 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

de los saldos diarios de sus operaciones pasivas del mes de que se trate.

(ff) Cuentas de orden

En las cuentas de orden se registran activos o compromisos que no forman parte del estado de situación financiera consolidado del Banco 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 Banco 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 Banco 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 Banco.

Las pérdidas a cargo del Banco 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.

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 Banco 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 Banco 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 Banco.

El reconocimiento de los ingresos por manejo de los fideicomisos se reconoce con base

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 46 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 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 Banco 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 Banco actúe como reportadora o prestataria.

-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, el monto de los intereses devengados no cobrados derivados de los créditos que se mantengan en cartera con riesgo de crédito Etapa 3.

-Otras cuentas de registro:

Al 31 de diciembre de 2022, las otras cuentas de registro presentan un saldo de \$1,669,462 que se integran principalmente por guardavalores por el Banco.

(gg)Contingencias

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos, utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

---

(3) Cambios Contables

i. Criterios contables emitidos por la Comisión

Modificaciones a las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, incluyendo aquellas relacionadas a la determinación de las reservas crediticias y a la contabilidad

Mediante publicación en Diario Oficial de fecha 4 de diciembre de 2020, la Comisión dio a conocer la obligatoriedad a partir del 1 de enero de 2022, para la adopción de las siguientes NIF emitidas por el CINIF:

- NIF B-5, Información financiera por segmentos
- NIF B-12, Compensación de activos y pasivos financieros
- NIF B-17, Determinación del valor razonable
- NIF C-2, Inversión en instrumentos financieros
- NIF C-3, Cuentas por cobrar
- NIF C-9, Provisiones, contingencias y compromisos
- NIF C-13, Partes relacionadas
- NIF C-14, Transferencia y baja de activos financieros
- NIF C-10, Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura
- NIF C-16, Deterioro de instrumentos financieros por cobrar
- NIF C-19, Instrumentos financieros por pagar
- NIF C-20, Instrumentos financieros para cobrar principal e interés
- NIF D-1, Ingresos por contratos con clientes
- NIF D-2, Costos por contratos con clientes y
- NIF D-5, Arrendamientos

Principales cambios en la normatividad contable que afecten o pudieran afectar significativamente los estados financieros.

Entre otros cambios relevantes y que entraron en vigor el 1 de enero de 2022 fueron aquellos a los Criterios Contables del Anexo 33 de las Disposiciones:

- Criterio Contable B-1 Efectivo y equivalentes de efectivo (antes Disponibilidades).
- Criterio Contable B-3 Reportos
- Criterio Contable B-6 Cartera de Crédito
- Criterio Contable B-7 Bienes adjudicados
- Se derogan los criterios contables B-2 Inversiones en valores, B-5 Derivados y operaciones de cobertura, B-11 Derechos de cobro, C-1 Reconocimiento y baja de activos financieros, C-3 Partes relacionadas y C-4 Información por segmentos.

De acuerdo con los artículos transitorios mencionados en las Disposiciones, y como una solución práctica, las instituciones de crédito en la aplicación de los Criterios Contables contenidos en el Anexo 33 que se modifican, podrán reconocer en la fecha de aplicación inicial, es decir, el 1 de enero de 2022, el efecto acumulado de los cambios contables.

El detalle de los cambios que modifican los criterios contables se muestran a continuación:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 48 / 11

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Serie A. Criterios relativos al esquema general de la contabilidad para instituciones de crédito

A-1 Esquema básico del conjunto de criterios de contabilidad aplicables a instituciones de créditoA-1 Esquema básico del conjunto de criterios de contabilidad aplicables a instituciones de créditoSin cambios.

A-2 Aplicación de normas particularesA-2 Aplicación de normas particularesSe adicionan las siguientes NIF emitidas por el CINIF como aplicables, estableciendo particularidades en algunas de ellas:

NIF B-5 "Información financiera por segmentos". El impacto no es material.

NIF B-11 "Disposición de activos de larga duración y operaciones discontinuadas" Sin impacto.

NIF B-12 "Compensación de activos financieros y pasivos financieros" El impacto no es material.

NIF B-17 "Determinación del valor razonable". Impacto en la valuación de los instrumentos que no sean valuados por un proveedor de precios. Sin impacto.

NIF C-2 "Inversión en instrumentos financieros". Impacto en presentación dada la clasificación de las inversiones en instrumentos financieros conforme al modelo de negocio y su valuación atendiendo a dicho modelo.

NIF C-9 "Provisiones, contingencias y compromisos". Sin impacto.

NIF C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura". Sin impacto

NIF C-12 "Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital" Sin impacto.

NIF C-13 "Partes relacionadas". El impacto no es material.

NIF C-14 "Transferencia y baja de activos financieros". El impacto no es material.

NIF C-16 "Deterioro de instrumentos financieros por cobrar". Tiene Impacto en la determinación de deterioro de instrumentos financieros por cobrar principal e interés, conforme a Etapas de riesgo 1 a 3.

NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar". Se considera su aplicación a la captación, los préstamos interbancarios y de otros organismos.

NIF C-20 "Instrumentos financieros para cobrar principal e interés". Impacto en la valuación de los instrumentos que sean considerados bajo este modelo de negocio y que anteriormente aplicaban una valuación distinta a costo amortizado.

NIF C-22 "Criptomonedas". Sin efectos.

NIF D-1 Ingresos por contratos con clientes. Sin impacto.

NIF D-2 Costos por contratos con clientes. Sin efectos. Sin impacto.

NIF D-5 Arrendamientos. Impacto en arrendamientos donde el Banco es arrendatario, debido a que reconoce el activo por derecho de uso de los bienes arrendados y reconoce el pasivo. En resultados el activo por derecho de uso se deprecia atendiendo a la vida útil, mientras que el pasivo genera intereses a la tasa de interés efectiva del arrendamiento o de mercado y le liquida conforme se paga.

A-1 Esquema básico del conjunto de criterios de contabilidad aplicables a instituciones de créditoA-1 Esquema básico del conjunto de criterios de contabilidad aplicables a instituciones de créditoSin cambios.

A-3 Aplicación de normas generalesA-3 Aplicación de normas generales Sin cambios

A-4 Aplicación supletoria a los criterios de contabilidadA-4 Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad Sin cambios

Serie B. Criterios relativos a los conceptos que integran los estados financieros

B-1 DisponibilidadesB-1 Efectivo y equivalentes de efectivoSe cambia el nombre del



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 49/ 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

rubro y el criterio contable.

Se adiciona la definición de las Inversiones disponibles para la vista, considerando un plazo de vencimiento de 48 horas a partir de su adquisición.

B-2 Inversiones en valoresB-2 DerogadoSe deroga, pero en el nuevo criterio contable A-2 establece la aplicación de la NIF C-2 "Inversión en instrumentos financieros", NIF C-20 "Instrumentos financieros para cobrar principal e interés" y NIF C-16 "Deterioro de instrumentos financieros por cobrar.

Se elimina la clasificación de los instrumentos financieros con base en la intención de la administración y se establece una nueva clasificación de los instrumentos financieros conforme al modelo de negocio que aplica el Banco, que puede ser para negociación, para cobrar principal e intereses, o para cobrar y vender.

B-4 Préstamo de valoresB-4 Préstamo de valores Se modifica la definición de costo amortizado.

Serie A. Criterios relativos al esquema general de la contabilidad para instituciones de crédito

B-5 Derivados y operaciones de coberturaB-5 DerogadoSe deroga, pero en el nuevo criterio contable A-2 establece la aplicación de la NIF C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura"

B-6 Cartera de créditoB-6 Cartera de créditoSe modifica sustancialmente el criterio contable:

Se establece que la valuación de la cartera de crédito se realiza conforme al modelo de negocio.

Se establecen como modelos de negocio: para cobrar principal e interés, para cobrar vender, para negociación.

Se elimina la clasificación de la cartera vigente y se establece una clasificación por etapa de riesgo en Etapa 1, Etapa 2 y Etapa 3.

Se modifica la forma de amortización de las comisiones cobradas y costos de transacción relacionados al otorgamiento del crédito.

Se incorpora la metodología para la determinación de la tasa de interés efectiva para la valuación de la cartera de crédito con base en el modelo de negocio aplicable.

B-7 Bienes adjudicadosB-7 Bienes adjudicadosSe modifica el valor del reconocimiento inicial de los bienes adjudicados en cual dependerá de la intención que tenga el Banco con estos activos. El impacto es no material.

B-8 AvalessB-8 AvalessSin cambios

B-9 Custodia y administración de bienesB-9 Custodia y administración de bienesSe adicionan los activos virtuales como bienes que son sujetos de custodia y administración. El impacto es no material.

B-10 FideicomisosB-10 FideicomisosSin cambios

B-11 Derechos de cobroB-11 DerogadoSe deroga. El impacto es no material.

C-1 Reconocimiento y baja de activos financierosC-1 DerogadoSe deroga, pero en el nuevo criterio contable A-2 se establece la aplicación de la NIF C-14 "Transferencia y baja de activos financieros". El impacto es no material.

C-3 Partes relacionadasC-3 DerogadoSe deroga, pero en el nuevo criterio contable A-2 se establece la aplicación de la NIF C-13 "Partes relacionadas". El impacto es no material.

C-4 Información por segmentosC-4 DerogadoSe deroga, pero en el nuevo criterio contable A-2 se establece la aplicación de la NIF B-5 "Información financiera por segmentos",

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 50 / 11  
CONSOLIDADO  
Impresión Final

estableciendo como mínimo los segmentos operativos que ya estaban definidos en el criterio contable C-4 anterior. El impacto es no material.

Serie D. Criterios relativos a los estados financieros básicos

D-1 Balance generalD-1 Estado de situación financieraCambio del nombre del estado financiero y la presentación, incluyendo los cambios en los nombres de los rubros conforme a los nuevos criterios contables.

D-2 Estado de resultadosD-2 Estado de resultado integralCambio del nombre del estado financiero y la presentación, incluyendo los cambios en los nombres de los rubros conforme a los nuevos criterios contables.

D-3 Estado de variaciones en el capital contableD-3 Estado de cambios en el capital contableCambio del nombre del estado financiero y la presentación, incluyendo los cambios en los nombres de los rubros conforme a los nuevos criterios contables.

D-4 Estado de flujos de efectivoD-4 Estado de flujos de efectivoCambio del nombre del estado financiero y la presentación, incluyendo los cambios en los nombres de los rubros conforme a los nuevos criterios contables.

ii. Ajustes llevados a cabo en la determinación de los efectos iniciales de la aplicación de los criterios contables

Derivado de la adopción inicial de los Criterios Contables que entraron en vigor a partir del 1 de enero de 2022 referidos en el punto anterior, los efectos reconocidos en el capital contable del Banco, dentro del resultado de ejercicios anteriores se muestran en la tabla siguiente:

Concepto Importe

Estimación preventiva de riesgos crediticios derivada de la calificación de cartera de crédito\$ 821

Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo1,618

Pasivo por arrendamiento(1,618)

Impuestos ISR y PTU diferidos(283)

Efecto neto en resultados acumulados\$538

El ajuste neto total (neto de ISR y PTU diferidos) a los saldos iniciales del capital contable del Banco al 1 de enero de 2022 es \$538 y corresponde al ajuste por cambio en las metodologías para determinación de estimación preventiva de riesgos crediticios.

Mediante oficio de respuesta de confirmación de criterio No. DGDR-15556/2021 de fecha 30 de septiembre de 2021, la Comisión comunicó a las instituciones de crédito que, en la adopción del método de interés efectivo de la cartera de crédito para determinar el efecto acumulado inicial, en la aplicación del método retrospectivo o retrospectiva parcial de acuerdo con la NIF B-1, "Cambios contables y correcciones de errores", pudiera haber Instituciones que concluyan que es impráctico obtener información histórica detallada por las distintas carteras, tal como, costos de transacción, comisiones cobradas identificados crédito a crédito, etc., por lo que su adopción sería de aplicación prospectiva.

Basado en lo anterior, el Banco al encontrarse ante una situación impráctica y habiendo ejecutado los esfuerzos razonables y justificables realizó la implementación de costo amortizado utilizando el método de interés efectivo de aplicación prospectiva, debido que la adopción del nuevo criterio contable B-6 "Cartera de crédito", representó cambios sustanciales en los sistemas core y complejidad para la identificación de información histórica y su extracción de las fuentes de datos de respaldo.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 51 / 11  
**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

iii.Mecánica de adopción de los cambios en la normatividad contable

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 Banco, 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 no consolidados, es decir que no se encuentra en los supuestos para considerarse en las Etapas 2 y 3 que se mencionan posteriormente.

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco 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 períodos 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 no consolidados conforme a los modelos de cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios.

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco 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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 52 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

- 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:

1. Aquéllos por los que el Banco tiene conocimiento de que el acreditado ha sido declarado en concurso mercantil.

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 incurren en los supuestos previstos por el numeral 2 siguiente.

2. Tratándose de créditos de consumo no revolventes, créditos a la vivienda, que han sido pagados parcialmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

a. Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b. 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.

3. 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:

a. 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: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 53 / 11  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b. 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.

c. Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

4. Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de "Efectivo y equivalentes de efectivo", al momento en que no han sido cobrados.

5. 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:

a) los recursos del crédito son dispuestos para el fin con que fueron otorgados;

b) el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o

c) el Banco haya recibido el pago parcial de la amortización correspondiente. La excepción contenida en el presente inciso será aplicable siempre y cuando se trate de créditos bajo el esquema ROA, y cada uno de los pagos realizados durante dicho período representen, al menos, el 5% de la amortización pactada.

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 Banco considera las siguientes equivalencias:

Periodicidad de pago contractual Equivalencia 30 días 90 días

Quincenal 2 quincenas Más de 6 quincenas

Catorcenal 2 catorcenas Más de 6 catorcenas

Decenal 3 decenas Más de 9 decenas

Semanal 4 semanas Más de 13 semanas

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 54 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 3:

- 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 de 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, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a Etapa 1.

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.

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:

- a) se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y
- b) 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.

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:

- a) el acreditado ha cubierto la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración, y
- b) el acreditado ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o 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:

- a) se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración
- b) se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto, y
- c) 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.

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 periodo 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 Banco 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 Banco 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 56 / 11  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

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.

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:

a) 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.

b) Para créditos con periodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.

c) En el caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 90 días naturales, se realiza el pago de una amortización.

Cuando los periodos de amortización pactados en la reestructura o renovación no son homogéneos, se considera el número de periodos que representan el plazo más extenso, conforme a lo descrito previamente.

Para reestructuras en las que se modifica la periodicidad del pago a periodos 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 Banco está obligado a respetar

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 57 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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.

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

- a) El acreditado ha cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,
- b) 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:

- a) El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura o renovación;
- b) 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
- c) 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.

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 hasta acreditar pago sostenido 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 Banco demuestre que existe pago sostenido, además de

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 59 / 11  
 CONSOLIDADO  
 Impresión Final

FIJA USD FIXED 1,470,334,667.49

TOTAL - - - - - 16,753,890,506.70 - - - -

Otros bancarios

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLO No29/08/201823/08/20238.89 FIJA  
 MXN FIXED 1,548,154,166.67

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLO No19/03/202003/03/202310.7472 +  
 0.14 Spread / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,503,780,277.78

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLO No19/03/202002/02/202310.7472 +  
 0.14 Spread / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,503,780,277.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202020/02/202410.2875 + 0.43 Spread / VARIABLE MXN  
 TIIE 28D EOM 2,523,849,513.89

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202020/03/202410.2875 + 0.43 Spread / VARIABLE MXN  
 TIIE 28D EOM 2,523,849,513.89

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/11/202410.2875 + 0.35 Spread / VARIABLE MXN  
 TIIE 28D EOM 2,523,671,736.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/09/202410.2875 + 0.35 Spread / VARIABLE MXN  
 TIIE 28D EOM 2,523,671,736.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/201925/07/202410.2875 + 0.35 Spread / VARIABLE MXN  
 TIIE 28D EOM 2,523,671,736.11

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLO No14/12/201702/12/20278.48 FIJA  
 MXN FIXED 1,005,653,333.33

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLO No23/04/201814/04/20258.41 FIJA  
 MXN FIXED 1,017,754,444.44

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/201828/12/202310.8545  
 Tasa Fija 8,009,648.44

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201817/02/202310.8125  
 Tasa Fija 4,527,488.40

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201817/02/202310.8125  
 Tasa Fija 1,974,345.53

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202105/07/20245.33 Tasa  
 Fija 5,884,938.31

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202026/03/20256.76 Tasa  
 Fija 3,106,495.69

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/01/202105/01/202410.4249  
 Tasa Fija 1,819,613.80

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202015/11/202310.4612  
 Tasa Fija 839,850.58

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/04/202128/04/202610.8545  
 Tasa Fija 1,793,683.04

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa  
 Fija 177,721.93

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa  
 Fija 1,375,751.80

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202109/09/202610.4471  
 Tasa Fija 142,150,180.15

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202126/05/202610.8472  
 Tasa Fija 7,516,564.42

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/01/202126/01/202410.8545  
 Tasa Fija 5,426,405.83

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202130/04/20245.87 Tasa  
 Fija 137,437,382.29

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202021/08/20235.69 Tasa  
 Fija 2,005,136.78

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202029/09/20235.78 Tasa  
 Fija 2,040,640.98

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 60 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202029/09/20235.78 Tasa Fija 7,533,328.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202029/09/20235.59 Tasa Fija 8,880,699.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202128/02/202511.0205 Tasa Fija 3,106,790.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/202610.8472 Tasa Fija 9,976,682.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/201930/09/202310.3875 Tasa Fija 6,303,879.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202107/04/202510.4249 Tasa Fija 12,091,224.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/201715/03/20226.3256 Tasa Fija 2,359.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/201826/06/202310.8472 Tasa Fija 146,937.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202021/04/202310.4162 Tasa Fija 1,494,442.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202014/03/202310.4535 Tasa Fija 683,275.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202014/03/202310.4535 Tasa Fija 75,944.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202008/01/202410.4287 Tasa Fija 3,309,364.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201817/10/202310.3875 Tasa Fija 10,717,125.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/201926/06/202310.8472 Tasa Fija 214,705.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/201826/06/202310.8472 Tasa Fija 270,288.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/201817/08/202310.6049 Tasa Fija 810,604.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202006/09/202410.4162 Tasa Fija 396,149.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202030/05/20235.38 Tasa Fija 1,940,514.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202030/05/20235.38 Tasa Fija 2,540,959.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202007/05/202510.4249 Tasa Fija 3,651,243.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202114/09/20267.17 Tasa Fija 5,540,313.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201830/01/20234.85357 Tasa Fija 11,615,576.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201830/01/20234.85357 Tasa Fija 17,423,352.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/02/201830/01/20234.89357 Tasa Fija 40,654,594.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54 Tasa Fija 14,046,419.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/07/202109/07/20267.04 Tasa Fija 3,510,985.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202025/09/202410.8472 Tasa Fija 1,511,367.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202125/09/202410.8472 Tasa Fija 2,744,371.07

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 61 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201809/02/202310.4343	
Tasa Fija 236,881.65	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202104/05/202310.3875	
Tasa Fija 10,092,333.35	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202115/05/202510.4612	
Tasa Fija 578,615.19	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202107/07/202310.3875	
Tasa Fija 11,101,566.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26	Tasa
Fija 12,183,823.38	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202114/09/20266.57	Tasa
Fija 10,492,013.82	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/04/201928/04/202310.862	
Tasa Fija 942,435.71	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202129/06/202610.8605	
Tasa Fija 95,257,439.98	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201927/09/202410.3875	
Tasa Fija 4,440,626.64	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202115/07/202610.4612	
Tasa Fija 272,364,368.98	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202106/09/202410.4162	
Tasa Fija 610,041.52	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202118/02/202610.8125	
Tasa Fija 36,876,759.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201928/06/202410.3875	
Tasa Fija 2,619,549.93	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202026/11/202410.8472	
Tasa Fija 1,591,963.74	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202120/05/202610.815	
Tasa Fija 205,739,025.10	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202027/03/20255.66	Tasa
Fija 3,671,102.05	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202021/03/202310.822	
Tasa Fija 12,336,505.60	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202021/03/202310.822	
Tasa Fija 1,230,110.13	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/202610.3875	
Tasa Fija 62,417,200.03	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/201917/10/202410.8125	
Tasa Fija 4,862,772.51	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/10/202030/10/202510.8605	
Tasa Fija 69,089,279.73	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202130/04/20266.28	Tasa
Fija 8,014,729.73	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/201830/11/202310.3875	
Tasa Fija 30,640,324.04	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202004/11/202510.409	
Tasa Fija 57,485,005.77	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4	Tasa
Fija 12,888,857.13	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4	Tasa
Fija 34,634,936.95	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/07/202115/07/202510.4612	
Tasa Fija 2,596,095.13	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38	Tasa
Fija 1,328,775.22	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 62 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa Fija 2,048,605.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202102/09/202610.3987 Tasa Fija 13,616,985.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/201823/05/202310.3875 Tasa Fija 22,076,997.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/201824/05/202310.8472 Tasa Fija 1,186,351.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/201913/10/202310.4612 Tasa Fija 285,361.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202810.4287 Tasa Fija 143,104,012.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202119/11/202511.8605 Tasa Fija 99,232,009.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202810.4287 Tasa Fija 54,701,045.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 40,262,755.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 40,262,755.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201829/09/202310.3875 Tasa Fija 4,399,222.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201809/02/202310.4343 Tasa Fija 238,930.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/05/202031/05/202310.3875 Tasa Fija 82,267.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202028/02/202310.722 Tasa Fija 210,463.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202029/02/202410.3875 Tasa Fija 321,470.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/11/202129/07/202610.862 Tasa Fija 13,591,238.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202130/04/20266.28 Tasa Fija 7,547,852.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202031/01/202310.1831 Tasa Fija 131,205.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/12/20239.579 Tasa Fija 214,637.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202410.722 Tasa Fija 434,001.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202028/02/202310.6999 Tasa Fija 147,106.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202410.722 Tasa Fija 619,966.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/09/202311.0749 Tasa Fija 727,720.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201928/06/202410.3875 Tasa Fija 27,358,139.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202001/12/202310.3935 Tasa Fija 1,345,266.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202031/05/202410.6999 Tasa Fija 529,459.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201830/01/202310.3875 Tasa Fija 3,545,954.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202030/11/202310.3875 Tasa Fija 5,540,751.80

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 63 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/202310.4535	Tasa Fija 495,375.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202006/09/202410.4162	Tasa Fija 250,477.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/202310.4535	Tasa Fija 1,795,927.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202110/03/202510.4471	Tasa Fija 24,680,938.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/11/201931/05/202410.3875	Tasa Fija 7,909,866.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14	Tasa Fija 154,885,105.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14	Tasa Fija 170,030,384.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26	Tasa Fija 4,027,606.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/05/202126/05/20266.14	Tasa Fija 191,529,131.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202006/03/20256.07	Tasa Fija 6,024,277.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202030/06/20239.579	Tasa Fija 702,168.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202225/09/202410.8472	Tasa Fija 4,404,029.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202030/11/202310.3875	Tasa Fija 5,540,751.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/06/202019/11/202410.8125	Tasa Fija 2,164,669.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202020/06/202510.8359	Tasa Fija 5,015,049.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202028/11/202510.3875	Tasa Fija 12,519,662.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202025/09/202410.8472	Tasa Fija 3,669,837.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/06/202023/01/202510.8375	Tasa Fija 4,679,310.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202510.3875	Tasa Fija 358,220,433.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202129/12/202310.3875	Tasa Fija 97,670,397.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/11/201902/06/202310.3987	Tasa Fija 154,818.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20255.45143	Tasa Fija 7,583,265.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202510.3875	Tasa Fija 120,748,460.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20255.45143	Tasa Fija 1,453,773.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201920/11/202310.815	Tasa Fija 5,749,820.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20255.45143	Tasa Fija 706,871.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201931/10/202410.3875	Tasa Fija 2,321,236.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20254.64143	Tasa Fija 686,103.24

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 64 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20254.97143 Tasa Fija 622,116.58	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202026/06/202510.8472 Tasa Fija 10,018,078.69	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202023/06/202310.8472 Tasa Fija 10,018,078.69	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202310.3875 Tasa Fija 2,987,865.61	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202310.3875 Tasa Fija 14,060,464.41	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202310.3875 Tasa Fija 1,827,430.98	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202310.3875 Tasa Fija 1,070,544.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202310.3875 Tasa Fija 391,714.44	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202310.3875 Tasa Fija 3,767,970.31	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202310.3875 Tasa Fija 10,826,813.22	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/11/201926/11/202410.8472 Tasa Fija 5,760,395.23	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/06/202029/09/202310.3875 Tasa Fija 23,183,688.68	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202019/12/202510.822 Tasa Fija 64,211,630.18	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/01/201929/09/202310.3875 Tasa Fija 2,199,611.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202510.845 Tasa Fija 26,589,990.96	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202510.8605 Tasa Fija 27,016,290.71	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202510.845 Tasa Fija 27,040,668.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202510.845 Tasa Fija 27,040,668.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/201827/04/202310.845 Tasa Fija 3,686,077.32	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202115/05/202510.4612 Tasa Fija 1,214,302.52	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54 Tasa Fija 5,089,498.21	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/201720/12/20237.62 Tasa Fija 4,704,059.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/201928/06/202410.3875 Tasa Fija 15,633,222.24	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202102/06/202310.3875 Tasa Fija 14,129,266.68	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202006/09/202410.4162 Tasa Fija 412,707.56	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/08/202123/04/202610.8375 Tasa Fija 1,704,605.86	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/201928/06/202410.3875 Tasa Fija 15,633,222.24	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201915/12/202310.4612 Tasa Fija 456,745.24	

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 65 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202110/06/202510.4471 Tasa Fija 4,550,376.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202129/07/202610.862 Tasa Fija 12,911,676.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201928/06/202410.3875 Tasa Fija 6,217,480.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201917/10/202410.8125 Tasa Fija 3,359,029.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201928/06/202410.3875 Tasa Fija 4,299,136.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202020/08/20255.77 Tasa Fija 21,370,945.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202025/08/202510.8472 Tasa Fija 6,678,719.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/08/202026/08/202510.3875 Tasa Fija 18,480,223.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/201929/11/202410.3875 Tasa Fija 6,055,400.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202131/03/202610.3875 Tasa Fija 7,064,633.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202130/01/202610.3987 Tasa Fija 12,776,430.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202006/03/20255.51 Tasa Fija 4,212,195.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202109/06/202310.3875 Tasa Fija 10,092,333.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202101/04/202610.409 Tasa Fija 94,061,963.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/201815/06/202310.4612 Tasa Fija 37,489,847.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201929/01/202410.862 Tasa Fija 119,809,745.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202117/06/20266.29 Tasa Fija 15,767,883.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/09/202029/08/202310.862 Tasa Fija 9,282,203.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa Fija 1,984,240.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa Fija 2,553,340.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202019/09/202510.822 Tasa Fija 5,518,187.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202012/01/202410.4471 Tasa Fija 13,281,141.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202016/04/20255.39 Tasa Fija 1,037,875.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202019/09/202510.822 Tasa Fija 5,518,187.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/201902/06/202310.3987 Tasa Fija 630,415.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/201902/06/202310.3987 Tasa Fija 138,691.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202024/09/202510.8472 Tasa Fija 17,972,444.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202016/01/202510.4737 Tasa Fija 29,767,555.06

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 66 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/2024/09/20255.41557 Tasa Fija 18,510,654.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202006/12/202410.4162 Tasa Fija 9,571,466.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202015/03/202310.4612 Tasa Fija 8,613,771.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/06/201902/06/202310.3987 Tasa Fija 504,332.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202026/01/202410.8472 Tasa Fija 1,899,260.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa Fija 1,500,067.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa Fija 12,288,823.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202118/02/202610.8125 Tasa Fija 32,691,246.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201829/12/202310.3875 Tasa Fija 14,886,191.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/201829/12/202310.3875 Tasa Fija 25,230,833.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202017/10/202410.8125 Tasa Fija 3,039,650.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202115/04/202510.4612 Tasa Fija 1,318,983.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/07/201809/02/202310.4343 Tasa Fija 183,044.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/06/202103/03/202310.3875 Tasa Fija 10,092,333.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202026/11/202410.8472 Tasa Fija 6,548,659.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202103/03/202310.3875 Tasa Fija 10,092,333.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202006/09/202410.4162 Tasa Fija 505,164.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201919/02/20245.20914 Tasa Fija 13,681,919.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202010/01/20255.64971 Tasa Fija 11,368,820.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202123/04/202610.8375 Tasa Fija 11,778,492.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/201931/05/202410.3875 Tasa Fija 2,194,092.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/08/201831/07/20238.39 Tasa Fija 1,289,545.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202028/06/202410.3875 Tasa Fija 8,778,933.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202031/03/202510.8605 Tasa Fija 67,207,637.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201831/01/202310.3875 Tasa Fija 39,948,799.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202004/04/202510.4162 Tasa Fija 7,052,659.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202014/11/202310.4535 Tasa Fija 5,760,786.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202510.4737 Tasa Fija 7,543,150.38

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 67 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202510.4737 Tasa Fija 6,659,342.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202025/10/202410.845 Tasa Fija 4,168,769.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 1,169,791.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 3,397,115.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 2,746,451.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/201931/05/202410.3875 Tasa Fija 44,885,652.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/07/202101/03/202310.3875 Tasa Fija 14,129,266.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/201809/02/202310.4343 Tasa Fija 335,555.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/201809/02/202310.4343 Tasa Fija 208,806.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/201809/02/202310.4343 Tasa Fija 186,434.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/07/202103/07/202310.3875 Tasa Fija 18,166,200.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/201829/12/202310.3875 Tasa Fija 68,672,020.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202107/05/202610.4249 Tasa Fija 34,414,016.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202115/04/202510.4612 Tasa Fija 3,224,182.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/06/201914/12/202310.4535 Tasa Fija 2,729,251.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/201828/02/202310.3875 Tasa Fija 3,027,700.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/07/201928/06/202410.3875 Tasa Fija 49,204,318.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/201809/02/202310.4343 Tasa Fija 341,242.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202410.3875 Tasa Fija 5,277,431.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202410.3875 Tasa Fija 4,441,761.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202410.3875 Tasa Fija 969,425.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202410.3875 Tasa Fija 17,115,759.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201831/08/202310.3875 Tasa Fija 161,497.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201831/08/202310.3875 Tasa Fija 107,725.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/201928/06/202410.3875 Tasa Fija 4,623,761.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/201831/08/20238.54 Tasa Fija 167,945.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/201928/06/202410.3875 Tasa Fija 5,236,911.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201829/12/202310.3875 Tasa Fija 13,876,958.32

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 68 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/201829/09/202310.3875 Tasa Fija 10,998,055.61	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/201931/07/202410.3875 Tasa Fija 672,822.26	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201809/02/202310.4343 Tasa Fija 203,285.49	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/08/201929/08/202310.3875 Tasa Fija 51,505,274.58	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/09/201915/09/202310.4612 Tasa Fija 685,117.85	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202410.4612 Tasa Fija 376,852.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202410.4612 Tasa Fija 8,706,592.20	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202410.4612 Tasa Fija 9,096,439.77	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202410.4612 Tasa Fija 2,598,982.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202410.4612 Tasa Fija 2,598,982.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202410.4612 Tasa Fija 2,598,982.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/201931/05/202410.3875 Tasa Fija 22,896,981.18	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/01/202310.8125 Tasa Fija 20,078,090.28	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202229/01/20278.07 Tasa Fija 56,785,391.77	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 73,871,872.90	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 32,777,920.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 13,258,803.88	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 7,803,210.66	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 66,068,662.24	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202214/02/202310.4535 Tasa Fija 10,052,267.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202212/02/202710.4535 Tasa Fija 83,768,895.80	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202217/02/202710.8125 Tasa Fija 38,591,171.39	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202220/12/20287.4 Tasa Fija 29,606,899.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/02/202216/01/202310.4737 Tasa Fija 10,046,549.78	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/02/202226/01/202310.8472 Tasa Fija 15,027,118.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/02/202231/01/202310.3875 Tasa Fija 15,138,500.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/02/202220/02/202310.815 Tasa Fija 2,007,210.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202228/02/202310.722 Tasa Fija 1,514,296.00	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 69 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202220/02/202310.815	Tasa Fija 4,014,420.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202220/02/202310.815	Tasa Fija 1,003,605.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202228/02/202310.722	Tasa Fija 1,009,530.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/03/202231/08/202511.852	Tasa Fija 22,792,722.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202217/04/202610.9625	Tasa Fija 14,390,074.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/04/202228/02/20239.579	Tasa Fija 1,024,745.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202228/04/202310.3875	Tasa Fija 18,923,125.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202228/04/202310.3875	Tasa Fija 7,569,250.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202215/05/202610.4612	Tasa Fija 1,716,772.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202228/02/202310.1831	Tasa Fija 1,017,537.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202228/04/202310.3875	Tasa Fija 21,025,694.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202228/04/202310.3875	Tasa Fija 21,025,694.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202203/06/202710.579	Tasa Fija 18,142,816.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202202/06/202310.3875	Tasa Fija 18,923,125.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202204/04/202310.4287	Tasa Fija 50,347,623.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202231/05/202310.3875	Tasa Fija 25,230,833.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202206/06/202510.5462	Tasa Fija 50,380,835.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/06/202219/04/202310.8125	Tasa Fija 10,039,045.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/202224/06/202611.0045	Tasa Fija 72,005,154.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202205/07/202710.579	Tasa Fija 23,098,493.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202224/06/202611.0045	Tasa Fija 17,579,254.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202230/06/202310.3875	Tasa Fija 50,461,666.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202202/01/202310.6976	Tasa Fija 1,264,413.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/07/202230/06/202310.8605	Tasa Fija 3,001,810.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/07/202203/01/202310.7291	Tasa Fija 233,402.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/07/202203/01/202310.7291	Tasa Fija 1,111,923.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/07/202203/01/202310.7291	Tasa Fija 63,893.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/07/202229/11/202210.7291	Tasa Fija 43,039.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/07/202203/01/202310.7291	Tasa Fija 26,246.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202203/01/202310.7122	Tasa Fija 42,731.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202204/01/202310.7122	Tasa Fija 518,426.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/07/202206/07/202310.3875	Tasa Fija 18,923,125.00

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 70 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202203/01/202310.7996	Tasa Fija	484,987.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202206/01/202310.8112	Tasa Fija	1,123,778.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202203/01/202310.8112	Tasa Fija	77,250.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202203/01/202310.8112	Tasa Fija	7,603.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202230/12/202210.8111	Tasa Fija	409,793.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202228/02/202310.1831	Tasa Fija	1,017,537.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/07/202209/01/202310.8737	Tasa Fija	574,188.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/07/202210/01/202310.8737	Tasa Fija	42,845.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/07/202210/01/202310.8737	Tasa Fija	527,483.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/07/202229/11/202210.8737	Tasa Fija	391,952.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/07/202209/01/202310.8737	Tasa Fija	891,046.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/07/202210/01/202310.8737	Tasa Fija	35,972.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/07/202205/01/202310.8737	Tasa Fija	880,536.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202205/01/202310.9107	Tasa Fija	241,753.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202210/01/202310.9107	Tasa Fija	215,526.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202213/01/202310.9107	Tasa Fija	598,504.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/07/202210/01/202310.4471	Tasa Fija	5,027,568.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/07/202209/01/202310.4343	Tasa Fija	5,033,331.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/07/202211/01/202310.4471	Tasa Fija	10,055,137.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/202213/01/202310.4471	Tasa Fija	5,027,568.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/07/202203/01/202310.9688	Tasa Fija	25,056.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/07/202211/01/202310.4471	Tasa Fija	5,027,568.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/07/202215/02/202310.4612	Tasa Fija	904,446.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202211/01/202310.9844	Tasa Fija	55,434.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202216/01/202310.4737	Tasa Fija	5,023,274.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202216/02/202310.4737	Tasa Fija	301,396.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202217/01/202310.9844	Tasa Fija	1,469,201.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/07/202217/01/202310.9729	Tasa Fija	292,134.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/07/202212/01/202310.9729	Tasa Fija	1,584,235.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/07/202217/01/202310.9729	Tasa Fija	10,901.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/07/202217/01/202310.9729	Tasa Fija	92,489.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/07/202217/01/202310.9729	Tasa Fija	569,469.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/07/202217/01/202310.9729	Tasa Fija	123,875.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/07/202217/01/202310.9729	Tasa Fija	22,812.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/07/202217/02/202310.8125	Tasa Fija	461,796.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/07/202217/01/202310.9729	Tasa Fija	323,152.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/07/202212/01/202310.9729	Tasa Fija	663,592.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/07/202212/01/202310.4471	Tasa Fija	5,027,568.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/07/202212/01/202310.9772	Tasa Fija	762,401.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/07/202205/01/202310.9772	Tasa Fija	36,894.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/07/202210/01/202310.9772	Tasa Fija	168,661.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/202213/01/202310.4471	Tasa Fija	5,027,568.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/07/202220/01/202310.9689	Tasa Fija	10,755,881.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/07/202203/01/202310.9689	Tasa Fija	5,435.03

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 71 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202217/01/202310.9964	Tasa Fija	14,463.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202216/01/202310.9841	Tasa Fija	330,631.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202210/01/202310.9841	Tasa Fija	262,445.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202203/01/202310.9841	Tasa Fija	42,149.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/07/202223/02/202310.8375	Tasa Fija	50,135,468.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/07/202224/01/202310.9922	Tasa Fija	334,350.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/07/202219/01/202310.9922	Tasa Fija	4,825,584.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/07/202224/01/202310.9922	Tasa Fija	37,394.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/07/202220/01/202310.9922	Tasa Fija	84,878.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/07/202224/01/202310.9922	Tasa Fija	296,414.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/07/202205/01/202310.9922	Tasa Fija	586,842.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/07/202224/01/202310.9922	Tasa Fija	103,898.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202224/07/202310.3875	Tasa Fija	50,461,666.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20274.9525	Tasa Fija	11,126,192.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20274.9525	Tasa Fija	10,052,612.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/08/202224/01/202310.87	Tasa Fija	34,688.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/08/202217/01/202310.87	Tasa Fija	524,071.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/08/202224/01/202310.87	Tasa Fija	29,486.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/08/202226/01/202310.8825	Tasa Fija	1,045,031.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/08/202223/01/202310.8375	Tasa Fija	4,512,192.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/08/202202/03/202310.3987	Tasa Fija	474,072.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/08/202202/03/202310.3987	Tasa Fija	1,033,882.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/08/202225/01/202310.8472	Tasa Fija	4,508,135.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/08/202231/01/202310.3875	Tasa Fija	25,230,833.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202231/01/202310.9611	Tasa Fija	8,773,524.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202231/01/202310.9611	Tasa Fija	285,383.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202226/01/202310.9611	Tasa Fija	6,476,592.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202231/01/202310.9611	Tasa Fija	10,921.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202231/01/202310.9611	Tasa Fija	20,033.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202231/01/202310.9611	Tasa Fija	15,482.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202231/01/202310.9611	Tasa Fija	92,657.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202231/01/202310.9611	Tasa Fija	140,232.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/08/202227/01/202310.845	Tasa Fija	4,506,778.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202203/01/202310.9611	Tasa Fija	38,661.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/08/202205/01/202310.9611	Tasa Fija	469,920.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202223/01/202310.9514	Tasa Fija	751,131.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202212/01/202310.9514	Tasa Fija	25,758.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202212/01/202310.9514	Tasa Fija	241,034.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/08/202230/01/202310.8605	Tasa Fija	4,502,715.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202203/02/202310.9514	Tasa Fija	239,452.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202231/01/202310.9514	Tasa Fija	121,205.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/08/202201/02/202310.3935	Tasa Fija	5,044,749.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202206/01/202311.0551	Tasa Fija	145,356.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202210/01/202311.0551	Tasa Fija	29,222.84

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 72 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/08/202203/02/202310.409  
Tasa Fija 5,039,033.75

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/08/202204/08/202310.3875  
Tasa Fija 18,923,125.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/08/202206/01/202311.116 Tasa Fija 129,872.32

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/08/202225/01/202311.116 Tasa Fija 107,482.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/08/202203/01/202311.116 Tasa Fija 10,882.34

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/08/202210/01/202311.116 Tasa Fija 84,235.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/08/202224/01/202311.116 Tasa Fija 61,404.90

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/08/202207/02/202310.4249  
Tasa Fija 5,036,197.57

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/08/202207/02/202311.0672 Tasa Fija 428,578.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/08/202207/02/202311.0672 Tasa Fija 34,443.26

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/08/202207/02/202311.0672 Tasa Fija 42,092.52

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/08/202210/01/202311.0672 Tasa Fija 780,143.90

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/08/202207/02/202311.0672 Tasa Fija 27,707.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/08/202208/02/202310.4287  
Tasa Fija 5,034,762.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/08/202207/02/202311.0672 Tasa Fija 62,934.14

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/08/202202/02/202311.0672 Tasa Fija 3,897,906.46

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/08/202208/02/202310.4287  
Tasa Fija 5,034,762.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/08/202202/02/202311.0684 Tasa Fija 1,502,941.86

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/08/202207/02/202311.0684 Tasa Fija 102,884.95

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/08/202203/01/202311.0684 Tasa Fija 5,823.95

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/08/202202/02/202311.0684 Tasa Fija 1,399,656.83

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/202210/02/202310.4471  
Tasa Fija 5,027,568.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/08/202202/02/202311.1707 Tasa Fija 274,845.48

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/08/202210/02/202310.4471  
Tasa Fija 5,027,568.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202212/01/202311.1731 Tasa Fija 67,490.63

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202209/02/202311.1731 Tasa Fija 2,304,921.15

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202203/01/202311.1731 Tasa Fija 36,336.49

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/202213/02/202310.4471  
Tasa Fija 5,027,568.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202217/01/202311.1731 Tasa Fija 25,660.02

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202217/01/202311.1741 Tasa Fija 75,214.64

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/08/202214/02/202310.4535  
Tasa Fija 10,052,267.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/08/202214/02/202311.2194 Tasa Fija 102,038.41

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/08/202209/02/202311.2194 Tasa Fija 4,737,647.69

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/08/202214/02/202311.2194 Tasa Fija 243,058.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/08/202214/02/202311.2194 Tasa Fija 494,371.52

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/08/202209/02/202311.2194 Tasa Fija 559,352.32

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/08/202217/01/202311.2194 Tasa Fija 14,581.02

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/08/202209/02/202311.2194 Tasa Fija 219,333.59

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/08/202215/02/202310.4612  
Tasa Fija 10,049,400.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/08/202214/02/202311.2194 Tasa Fija 306,363.89

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/08/202214/02/202311.2194 Tasa Fija 63,187.21

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/08/202215/02/202310.4612  
Tasa Fija 5,024,700.06

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/08/202214/02/202311.2194 Tasa Fija 148,278.04

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/08/202214/02/202311.2194 Tasa Fija 67,541.07

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/08/202216/02/202310.4737

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 73 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 10,046,549.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/08/202213/02/202311.2194 Tasa Fija 208,259.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/08/202224/01/202311.3286 Tasa Fija 38,400.74  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202217/02/202310.8125  
Tasa Fija 10,039,045.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202221/03/202310.822  
Tasa Fija 5,518,186.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/08/202219/01/202311.3482 Tasa Fija 118,233.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/08/202224/01/202311.3482 Tasa Fija 505,150.27  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/08/202220/02/202310.815  
Tasa Fija 10,036,050.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202220/02/202311.3128 Tasa Fija 163,291.55  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/08/202221/02/202310.822  
Tasa Fija 10,033,067.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/08/202221/02/202311.3596 Tasa Fija 297,690.26  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/08/202209/02/202311.3596 Tasa Fija 338,864.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/08/202221/02/202311.3596 Tasa Fija 6,104.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/08/202221/02/202311.3596 Tasa Fija 25,886.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/08/202214/02/202311.3596 Tasa Fija 318,647.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/08/202216/02/202311.3596 Tasa Fija 975,620.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/08/202216/02/202311.3596 Tasa Fija 9,331,372.92  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/08/202222/02/202310.8359  
Tasa Fija 6,018,059.83  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/08/202222/02/202310.8359  
Tasa Fija 10,030,099.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/08/202222/02/202310.3875  
Tasa Fija 59,241,996.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202207/02/202311.3897 Tasa Fija 578,000.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202220/02/202311.3897 Tasa Fija 263,110.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202209/02/202311.3897 Tasa Fija 78,181.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/08/202223/02/202310.8375  
Tasa Fija 10,027,093.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/08/202224/02/202310.8472  
Tasa Fija 8,014,462.93  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202231/01/202311.4294 Tasa Fija 75,016.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202219/01/202311.4294 Tasa Fija 497,506.53  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202224/02/202310.8472  
Tasa Fija 10,018,078.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202216/02/202311.4294 Tasa Fija 68,880.47  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202224/02/202310.8472  
Tasa Fija 8,014,462.93  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202224/02/202310.3875  
Tasa Fija 15,138,500.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/08/202227/02/202310.845  
Tasa Fija 10,015,062.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202213/02/202311.487 Tasa Fija 18,703.64  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/08/202225/08/202310.3875  
Tasa Fija 18,923,125.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/08/202228/03/202310.8545  
Tasa Fija 1,081,302.54  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202207/02/202311.5313 Tasa Fija 48,345.47  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/09/202228/02/202310.8545  
Tasa Fija 10,012,060.56  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/09/202215/02/202410.5112  
Tasa Fija 1,250,621.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/09/202218/01/202311.519 Tasa Fija 19,052.98

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 74 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/09/202228/02/202311.519	Tasa Fija	202,769.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/09/202228/02/202311.519	Tasa Fija	46,867.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/09/202228/02/202311.519	Tasa Fija	69,020.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/09/202207/02/202311.519	Tasa Fija	243,948.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/09/202223/02/202311.519	Tasa Fija	6,658,398.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202201/03/202310.3935	Tasa Fija	2,017,899.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/09/202228/02/202311.519	Tasa Fija	523,179.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/09/202223/02/202311.519	Tasa Fija	1,164,934.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202201/03/202310.3935	Tasa Fija	3,026,849.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202201/03/202310.3875	Tasa Fija	5,046,166.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202219/01/202311.5098	Tasa Fija	47,707.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202220/02/202311.5098	Tasa Fija	281,902.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202209/02/202311.5098	Tasa Fija	18,501.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/09/202207/02/202311.556	Tasa Fija	38,225.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/09/202203/03/202310.3875	Tasa Fija	5,046,166.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202206/03/202311.556	Tasa Fija	1,026,228.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202203/03/202311.556	Tasa Fija	309,545.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202205/01/202310.354	Tasa Fija	47,252.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202228/02/202311.5612	Tasa Fija	77,044.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202223/02/202311.5612	Tasa Fija	82,566.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202221/02/202311.5612	Tasa Fija	1,745.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202206/01/202310.4287	Tasa Fija	1,006,952.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202207/03/202310.4249	Tasa Fija	2,518,098.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202203/01/202310.3582	Tasa Fija	153,299.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202204/01/202310.3582	Tasa Fija	11,398,693.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202207/03/202311.5639	Tasa Fija	466,225.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202207/03/202311.5639	Tasa Fija	1,573.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202207/03/202311.5639	Tasa Fija	24,189.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202204/01/202310.3582	Tasa Fija	1,097,104.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202207/03/202311.5639	Tasa Fija	249,533.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202207/03/202311.5639	Tasa Fija	15,944.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202204/01/202310.3582	Tasa Fija	491,178.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202204/01/202310.3582	Tasa Fija	46,857.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202202/03/202311.5639	Tasa Fija	6,211,460.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202206/01/202310.4162	Tasa Fija	1,007,522.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202202/01/202310.3582	Tasa Fija	113,076.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202204/01/202310.3582	Tasa Fija	267,715.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202202/01/202310.3582	Tasa Fija	11,009.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202207/03/202311.5639	Tasa Fija	121,385.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202202/03/202311.5639	Tasa Fija	1,451,530.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/09/202207/03/202311.5639	Tasa Fija	9,976.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202208/03/202310.3875	Tasa Fija	5,046,166.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202205/04/202310.409	Tasa Fija	1,088,431.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202203/01/202310.3728	Tasa Fija	5,426.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202202/01/202310.3728	Tasa Fija	2,873,155.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202202/01/202310.3728	Tasa Fija	1,472,392.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202207/03/202311.5705	Tasa Fija	74,614.50

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 75 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202204/01/202310.3728	Tasa Fija	919,372.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202202/01/202310.3728	Tasa Fija	7,809.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202207/03/202311.5705	Tasa Fija	13,082.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202209/03/202310.4343	Tasa Fija	2,516,665.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202210/01/202310.4471	Tasa Fija	1,005,513.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202210/03/202310.3875	Tasa Fija	5,046,166.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202210/03/202310.3875	Tasa Fija	40,369,333.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202226/12/202210.3874	Tasa Fija	5,012.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202203/01/202310.3874	Tasa Fija	11,654.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202207/03/202311.5697	Tasa Fija	303,085.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/09/202210/03/202310.4471	Tasa Fija	2,513,784.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/09/202211/01/202310.4471	Tasa Fija	1,005,513.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202202/01/202310.3874	Tasa Fija	113,992.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202204/01/202310.3874	Tasa Fija	18,752.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202207/02/202311.5697	Tasa Fija	11,152.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/09/202230/12/202210.3874	Tasa Fija	340,173.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/09/202228/08/202611.0105	Tasa Fija	30,268,503.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202202/01/202310.4237	Tasa Fija	72,205.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202204/01/202310.4237	Tasa Fija	3,127,855.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202210/03/202311.5697	Tasa Fija	1,488,876.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202204/01/202310.4237	Tasa Fija	551,999.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202221/02/202311.5697	Tasa Fija	25,361.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202213/03/202310.4471	Tasa Fija	1,700,323.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202204/01/202310.4237	Tasa Fija	57,690.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202221/02/202311.5697	Tasa Fija	14,410.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202212/01/202310.4471	Tasa Fija	1,005,513.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202208/09/202310.3875	Tasa Fija	15,138,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202213/12/202210.445	Tasa Fija	137,700.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202202/01/202310.445	Tasa Fija	28,217.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202211/01/202310.445	Tasa Fija	19,622.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202204/01/202310.445	Tasa Fija	271,543.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202226/01/202311.774	Tasa Fija	41,874.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202209/03/202311.774	Tasa Fija	3,869,061.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202214/03/202310.4535	Tasa Fija	2,457,779.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202213/01/202310.4471	Tasa Fija	1,005,513.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202209/01/202310.445	Tasa Fija	912,268.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202204/01/202310.445	Tasa Fija	206,124.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202204/01/202310.445	Tasa Fija	241,286.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202221/02/202311.774	Tasa Fija	297,062.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202223/02/202311.774	Tasa Fija	148,695.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202206/01/202310.445	Tasa Fija	2,964.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202206/01/202310.445	Tasa Fija	65,723.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202213/01/202310.4612	Tasa Fija	1,004,940.01

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 76 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202206/01/202310.48	Tasa Fija	4,712.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202209/01/202310.48	Tasa Fija	3,198,850.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202211/01/202310.48	Tasa Fija	324,082.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202209/01/202310.48	Tasa Fija	2,935,224.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202214/03/202311.8213	Tasa Fija	662,210.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202223/02/202311.8213	Tasa Fija	353,362.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202209/03/202311.8213	Tasa Fija	3,148,188.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202214/03/202311.8213	Tasa Fija	29,812.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202214/03/202311.8213	Tasa Fija	9,201.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202213/01/202310.48	Tasa Fija	127,228.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202202/01/202310.48	Tasa Fija	6,650.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202209/01/202310.48	Tasa Fija	22,050.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202210/02/202311.8213	Tasa Fija	48,830.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202209/03/202311.8213	Tasa Fija	989,123.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/09/202211/01/202310.48	Tasa Fija	298,362.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202216/01/202310.4737		Tasa Fija	1,004,654.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/09/202214/12/202210.5	Tasa Fija	28,730.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/09/202202/01/202310.5	Tasa Fija	151,234.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/09/202209/01/202310.5	Tasa Fija	43,413.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/09/202202/03/202311.9225	Tasa Fija	573,035.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/09/202202/02/202311.9225	Tasa Fija	54,183.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/09/202216/03/202311.9225	Tasa Fija	1,853,150.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202217/01/202310.8125		Tasa Fija	1,003,904.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/09/202221/02/202311.9225	Tasa Fija	38,034.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202217/03/202310.8125		Tasa Fija	2,509,761.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/09/202210/02/202311.9225	Tasa Fija	249,778.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202215/09/202610.6112		Tasa Fija	5,653,186.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202211/01/202310.535	Tasa Fija	4,509,853.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202210/03/202311.944	Tasa Fija	1,764,077.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202211/01/202310.535	Tasa Fija	458,745.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202204/01/202310.535	Tasa Fija	596,901.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202209/01/202310.535	Tasa Fija	8,828.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202217/03/202311.944	Tasa Fija	262,420.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202221/02/202311.944	Tasa Fija	38,035.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202210/03/202311.944	Tasa Fija	634,829.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202218/01/202310.8125		Tasa Fija	1,003,904.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202209/03/202311.944	Tasa Fija	630,238.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202215/09/202310.3875		Tasa Fija	15,138,500.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202210/03/202310.4471		Tasa Fija	15,679,178.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202209/12/202210.5725	Tasa Fija	22,223.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202202/01/202310.5725	Tasa Fija	25,635.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202211/01/202310.5725	Tasa Fija	472,987.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202209/01/202310.5725	Tasa Fija	35,997.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202223/02/202311.9683	Tasa Fija	58,654.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202223/12/202210.5725	Tasa Fija	193,270.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202228/02/202311.9683	Tasa Fija	37,931.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202221/03/202310.822		Tasa Fija	2,458,101.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202219/01/202310.8125			

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 77 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Tasa Fija 1,003,904.51  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202206/09/202310.4162  
 Tasa Fija 3,022,568.43  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202221/03/202310.822  
 Tasa Fija 26,085,974.78  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.0059  
 Tasa Fija 5,693,622.98  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.0059  
 Tasa Fija 113,872,459.79  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202221/03/202310.822  
 Tasa Fija 60,198,403.33  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202221/03/202310.822  
 Tasa Fija 316,041,617.50  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.0059  
 Tasa Fija 146,136,323.47  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202206/01/202310.5899 Tasa Fija 963,542.78  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202202/01/202310.5899 Tasa Fija 23,406.70  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202218/01/202310.5899 Tasa Fija 1,599,265.97  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202218/01/202310.5899 Tasa Fija 4,666.02  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202213/03/202311.9921 Tasa Fija 104,537.94  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202221/03/202311.9921 Tasa Fija 256,714.61  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202216/03/202311.9921 Tasa Fija 6,675,539.32  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202221/03/202311.9921 Tasa Fija 52,140.96  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202202/01/202310.5899 Tasa Fija 197.96  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202209/01/202310.5899 Tasa Fija 22,065.78  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202215/03/202311.9921 Tasa Fija 91,660.91  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202221/03/202311.9921 Tasa Fija 482,037.09  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/09/202220/01/202310.815  
 Tasa Fija 1,003,605.00  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/09/202218/09/202310.8125  
 Tasa Fija 5,019,522.57  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202220/01/202310.5899 Tasa Fija 173,132.90  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202209/01/202310.5899 Tasa Fija 193,743.57  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202218/01/202310.5899 Tasa Fija 136,468.64  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202228/02/202311.9921 Tasa Fija 77,880.86  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/09/202222/03/202310.8359  
 Tasa Fija 27,081,269.25  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202216/01/202310.5899 Tasa Fija 274,863.38  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/09/202228/02/202311.9921 Tasa Fija 244,630.80  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202213/01/202310.6086 Tasa Fija 1,147.07  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202216/01/202310.6086 Tasa Fija 4,609,774.36  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202220/01/202310.6086 Tasa Fija 136,037.04  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202219/12/202210.6086 Tasa Fija 2,235,222.69  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202216/01/202310.6086 Tasa Fija 322,360.26  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202213/01/202310.6086 Tasa Fija 188,745.27  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202218/01/202310.6086 Tasa Fija 50,577.61  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202216/01/202310.6086 Tasa Fija 316,089.45  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202214/02/202311.9968 Tasa Fija 3,783,181.32  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202221/03/202311.9968 Tasa Fija 96,823.84  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/09/202223/01/202310.8375  
 Tasa Fija 1,002,709.38  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202216/01/202310.6086 Tasa Fija 35,448.17  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202216/03/202311.9968 Tasa Fija 246,554.16  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202219/01/202310.6173 Tasa Fija 1,031,441.79  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202216/01/202310.6173 Tasa Fija 24,604.37  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202216/01/202310.6173 Tasa Fija 201,369.59

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 78 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202224/03/202310.8472  
Tasa Fija 2,384,302.72

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202224/01/202310.8472  
Tasa Fija 1,001,807.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202206/01/202310.6173 Tasa Fija 45,234.16

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202221/03/202312.106 Tasa Fija 151,815.91

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202216/03/202312.106 Tasa Fija 14,552.63

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202218/01/202310.6698 Tasa Fija 2,646,595.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202207/02/202312.1951 Tasa Fija 542,017.15

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202209/01/20235.3931 Tasa Fija 202,173.85

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202225/01/202310.8472  
Tasa Fija 1,001,807.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202209/01/202310.6698 Tasa Fija 53,097.20

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202204/01/202310.6698 Tasa Fija 30,025.07

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202218/01/202310.6698 Tasa Fija 2,181,700.34

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202209/01/202310.6698 Tasa Fija 27,571.86

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202224/03/202312.1951 Tasa Fija 1,041,806.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202221/03/202312.1951 Tasa Fija 225,484.98

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202216/03/202312.1951 Tasa Fija 201,790.99

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202221/03/202312.1951 Tasa Fija 143,382.39

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202220/01/202310.6698 Tasa Fija 1,267,150.99

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202218/01/202310.6698 Tasa Fija 501,110.36

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202220/01/202310.6899 Tasa Fija 1,784,201.84

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202219/01/202310.6899 Tasa Fija 22,863.07

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202224/01/202310.6899 Tasa Fija 1,540,977.86

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202210/02/202312.1722 Tasa Fija 134,503.16

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202227/03/202312.1722 Tasa Fija 27,402.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202216/01/202310.6899 Tasa Fija 4,104.79

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202214/03/202312.1722 Tasa Fija 28,577.20

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/09/202228/03/202310.8545  
Tasa Fija 2,503,015.14

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/09/202227/03/202312.1722 Tasa Fija 318,639.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/09/202226/01/202310.8472  
Tasa Fija 1,001,807.87

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/09/202224/03/202310.8472  
Tasa Fija 1,502,711.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202218/01/202310.729 Tasa Fija 659,332.32

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202210/02/202312.1096 Tasa Fija 28,460.99

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202228/03/202312.1096 Tasa Fija 17,195.63

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202226/01/202310.729 Tasa Fija 44,604.13

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202218/01/202310.729 Tasa Fija 42,475.65

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202210/02/202312.1096 Tasa Fija 6,545.38

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202216/01/20235.38129 Tasa Fija 28,635.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202214/03/202312.1096 Tasa Fija 12,576.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202204/01/202310.729 Tasa Fija 295,420.59

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202225/01/202310.729 Tasa Fija 52,636.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/09/202228/03/202312.1096 Tasa Fija 115,958.78

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202229/03/202310.862  
Tasa Fija 2,502,262.92

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202227/03/202310.845  
Tasa Fija 1,577,372.34

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202229/03/202310.862  
Tasa Fija 1,501,357.75

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202227/01/202311.0275 Tasa Fija 59,197.16

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202226/12/202211.0275 Tasa Fija 1,905,842.92

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202223/01/202311.0275 Tasa Fija 3,496,049.39

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 79 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202228/03/202312.18	Tasa Fija	482,112.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202220/01/202311.0275	Tasa Fija	362,876.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202218/01/202311.0275	Tasa Fija	27,042.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202223/01/202311.0275	Tasa Fija	7,359.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202221/03/202312.18	Tasa Fija	37,650.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202228/03/202312.18	Tasa Fija	129,638.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/10/202225/01/202311.0275	Tasa Fija	238,413.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/10/202230/03/202310.8605	Tasa Fija	1,751,055.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/10/202231/01/202310.3875	Tasa Fija	30,277,000.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202229/12/202211.0437	Tasa Fija	753,742.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202223/01/202311.0437	Tasa Fija	300,133.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202210/01/202311.0437	Tasa Fija	124,990.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202210/01/202311.0437	Tasa Fija	293,098.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202225/01/202311.0437	Tasa Fija	1,042,493.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/10/202229/03/202310.862	Tasa Fija	1,751,584.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202212/01/202311.0437	Tasa Fija	308,879.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/10/202231/03/202310.3875	Tasa Fija	1,513,850.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202210/01/202311.0437	Tasa Fija	62,056.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202223/03/202312.2034	Tasa Fija	351,500.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202223/03/202312.2034	Tasa Fija	6,678,127.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/10/202228/03/202312.2034	Tasa Fija	32,307.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/10/202202/05/202310.3987	Tasa Fija	1,129,705.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202226/01/202311.046	Tasa Fija	317,165.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202225/01/202311.046	Tasa Fija	4,172,341.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202202/03/202312.1675	Tasa Fija	321,681.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202225/01/202311.046	Tasa Fija	1,823,348.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202226/12/202211.046	Tasa Fija	116,375.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202228/03/202312.1675	Tasa Fija	110,696.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/10/202228/03/202312.1675	Tasa Fija	9,905.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/10/202203/04/202310.409	Tasa Fija	1,763,661.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/10/202230/03/202310.8605	Tasa Fija	1,751,055.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/10/202203/04/202310.409	Tasa Fija	13,101,487.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202220/01/202311.0605	Tasa Fija	136,668.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202219/12/202211.0605	Tasa Fija	25,465.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202210/01/202311.0605	Tasa Fija	23,665.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202225/01/202311.0605	Tasa Fija	136,593.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202216/01/202311.0605	Tasa Fija	68,512.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202231/03/202312.1891	Tasa Fija	2,538,965.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202209/01/20235.37601	Tasa Fija	158,911.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202202/03/202312.1891	Tasa Fija	127,571.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202221/03/202312.1891	Tasa Fija	531,599.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/10/202204/04/202310.409	Tasa Fija	1,763,661.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/10/202231/03/202310.3875	Tasa Fija	1,766,158.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202225/01/202311.0605	Tasa Fija	54,945.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202230/03/202312.1891	Tasa Fija	47,349.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/10/202216/02/202312.1891	Tasa Fija	1,690,974.99

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 80 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/10/202221/03/202310.822	
Tasa Fija 6,019,840.33	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202231/01/202311.0558	Tasa Fija 1,012,612.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202223/01/202311.0558	Tasa Fija 55,012.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202210/01/202311.0558	Tasa Fija 945,770.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202209/01/202311.0558	Tasa Fija 221,839.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202203/03/202312.1885	Tasa Fija 331,572.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202204/04/202312.1885	Tasa Fija 280,364.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202230/03/202312.1885	Tasa Fija 3,067,900.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202204/04/202312.1885	Tasa Fija 29,539.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202204/04/202312.1885	Tasa Fija 25,508.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202203/02/202311.0558	Tasa Fija 793,224.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202201/02/202311.0558	Tasa Fija 4,809,936.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202210/01/202311.0558	Tasa Fija 69,917.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202204/04/202312.1885	Tasa Fija 557,855.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202201/02/202311.0558	Tasa Fija 2,453,913.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202228/03/202312.1885	Tasa Fija 81,031.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202230/03/202312.1885	Tasa Fija 5,115,085.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/10/202203/04/202310.409	
Tasa Fija 1,763,661.81	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202201/02/202311.0558	Tasa Fija 27,084.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202223/01/202311.0558	Tasa Fija 42,733.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/10/202205/04/202310.409	
Tasa Fija 1,763,661.81	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202202/01/202311.0558	Tasa Fija 67,911.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202203/02/202311.0558	Tasa Fija 16,525.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/10/202203/04/202310.409	
Tasa Fija 5,039,033.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/10/202205/01/202310.409	
Tasa Fija 403,122.70	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/10/202205/04/202310.3875	
Tasa Fija 2,523,083.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/10/202203/04/202310.3875	
Tasa Fija 7,228,129.13	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202203/02/202311.0662	Tasa Fija 97,337.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202202/01/202311.0662	Tasa Fija 22,177.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202202/01/202311.0662	Tasa Fija 2,379,930.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202202/01/202311.0662	Tasa Fija 246,069.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202230/01/202311.0662	Tasa Fija 1,372,669.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202207/03/202312.2248	Tasa Fija 159,118.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202204/04/202310.409	
Tasa Fija 1,763,661.81	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202227/01/202311.0662	Tasa Fija 188,018.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202202/01/202311.0662	Tasa Fija 49,903.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202201/02/202311.0662	Tasa Fija 132,120.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202217/02/202312.2248	Tasa Fija 221,063.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202204/04/202310.409	
Tasa Fija 5,039,033.75	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202220/01/202311.0662	Tasa Fija 911,404.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202207/02/202311.0662	Tasa Fija 922,962.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202230/01/202311.0662	Tasa Fija 1,130.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202207/03/202312.2248	Tasa Fija 491,049.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202204/04/202312.2248	Tasa Fija 71,633.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202206/01/202311.0662	Tasa Fija 474,242.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202203/02/202311.075	Tasa Fija 278,360.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202210/01/202311.075	Tasa Fija 249,211.00

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 81 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202207/03/202312.2331 Tasa Fija 277,733.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202205/04/202310.409
Tasa Fija 1,763,661.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202202/02/202311.075 Tasa Fija 433,217.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202210/01/202311.075 Tasa Fija 68,025.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202203/03/202312.2331 Tasa Fija 69,140.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202201/02/202311.075 Tasa Fija 82,326.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202202/01/202311.075 Tasa Fija 19,940.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202205/04/202312.2331 Tasa Fija 1,130,002.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202209/01/202310.4343
Tasa Fija 352,333.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202231/01/202311.0815 Tasa Fija 753,017.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202210/01/202311.0815 Tasa Fija 219,955.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202201/02/202311.0815 Tasa Fija 3,646,640.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202214/02/202312.2331 Tasa Fija 466,931.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202201/02/202311.0815 Tasa Fija 167,829.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202221/03/202310.822
Tasa Fija 7,023,147.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202201/02/202311.0815 Tasa Fija 5,047.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202210/01/202311.0815 Tasa Fija 126,281.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202201/02/202311.0815 Tasa Fija 314,062.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202228/03/202312.2331 Tasa Fija 43,188.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202208/02/202310.4287
Tasa Fija 1,006,952.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202201/02/202311.0815 Tasa Fija 222,499.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202210/01/202311.0815 Tasa Fija 410,815.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202203/02/202311.09 Tasa Fija 127,281.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202210/01/202311.09 Tasa Fija 36,857.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202201/02/202311.09 Tasa Fija 176,757.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202204/04/202312.2356 Tasa Fija 7,578.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202227/01/202311.09 Tasa Fija 246,162.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202230/12/202211.09 Tasa Fija 132,503.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202231/01/202311.09 Tasa Fija 862,076.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202210/01/202311.09 Tasa Fija 773.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202201/02/202311.09 Tasa Fija 386,727.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202210/03/202312.2356 Tasa Fija 158,957.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/10/202209/02/202310.4343
Tasa Fija 1,006,666.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/10/202211/04/202310.4471
Tasa Fija 5,027,568.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202230/01/20235.57138 Tasa Fija 262,092.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202204/01/202311.09 Tasa Fija 17,591.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202218/01/202311.09 Tasa Fija 160,409.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202210/02/202311.09 Tasa Fija 307,393.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202227/01/202311.094 Tasa Fija 57,201.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202223/01/202311.094 Tasa Fija 73,630.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202208/02/202311.094 Tasa Fija 2,796,237.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202209/02/202311.094 Tasa Fija 637,516.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202210/01/202311.094 Tasa Fija 190,623.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202201/02/202311.094 Tasa Fija 895,224.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202210/03/202312.2461 Tasa Fija 144,706.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202210/04/202312.2461 Tasa Fija 7,159,066.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202211/04/202312.2461 Tasa Fija 15,107.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202211/04/202312.2461 Tasa Fija 4,141.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202202/01/202311.094 Tasa Fija 23,860.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202208/02/202311.094 Tasa Fija 225,573.68

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 82 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202209/02/202311.094	Tasa Fija	1,787,275.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202210/01/202311.094	Tasa Fija	216,077.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202216/01/202311.094	Tasa Fija	243,467.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/10/202210/02/202310.4471	Tasa Fija	1,005,513.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/10/202212/01/202310.4471	Tasa Fija	201,102.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202208/02/202311.094	Tasa Fija	4,199,741.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202210/01/202311.094	Tasa Fija	333,518.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202201/02/202311.094	Tasa Fija	211,653.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202211/04/202312.2461	Tasa Fija	131,114.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/10/202210/02/202310.4471	Tasa Fija	1,005,513.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202209/01/202311.094	Tasa Fija	53,263.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202208/02/202311.094	Tasa Fija	19,917.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202210/02/202311.094	Tasa Fija	496,579.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202230/01/202311.094	Tasa Fija	79,601.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202205/04/202312.2461	Tasa Fija	542,893.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202211/04/202312.2461	Tasa Fija	84,986.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/10/202212/04/202310.4471	Tasa Fija	5,027,568.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202213/01/202311.101	Tasa Fija	271,759.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202207/02/202311.101	Tasa Fija	1,915,677.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202211/04/202312.3277	Tasa Fija	20,996.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202207/02/202311.101	Tasa Fija	1,245,061.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202209/01/202311.101	Tasa Fija	3,042,672.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202210/02/202311.101	Tasa Fija	653,995.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202210/02/202311.101	Tasa Fija	47,883.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202208/02/202311.101	Tasa Fija	166,788.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202209/02/202311.101	Tasa Fija	406,338.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202216/01/202311.101	Tasa Fija	82,241.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202229/03/202312.3277	Tasa Fija	69,848.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202211/04/202312.3277	Tasa Fija	37,504.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202216/02/202312.3277	Tasa Fija	237,122.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202227/01/202311.101	Tasa Fija	1,199.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202210/01/202311.101	Tasa Fija	28,298.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202202/02/202311.101	Tasa Fija	6,847.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202209/01/202311.101	Tasa Fija	268,470.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202221/03/202312.3277	Tasa Fija	314,167.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/10/202213/02/202310.4471	Tasa Fija	1,005,513.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/10/202214/04/202310.4535	Tasa Fija	5,026,133.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202208/02/202311.101	Tasa Fija	121,411.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202210/01/202311.101	Tasa Fija	16,064.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202207/02/202311.101	Tasa Fija	1,970.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202214/04/202312.3277	Tasa Fija	681,010.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/10/202215/10/202710.9825	Tasa Fija	136,566,563.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202212/01/202311.14	Tasa Fija	1,925,390.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202209/01/202311.14	Tasa Fija	19,913.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202208/02/202311.14	Tasa Fija	199,546.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202214/03/202312.4306	Tasa Fija	129,971.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202230/01/20235.75433	Tasa Fija	92,658.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202224/01/202311.14	Tasa Fija	31,318.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202204/04/202312.4306	Tasa Fija	71,433.74

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 83 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/10/202214/02/202310.4535  
Tasa Fija 1,005,226.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202227/01/202311.14 Tasa Fija 1,547,649.99  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202216/01/202311.14 Tasa Fija 64,155.91  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/10/202216/01/202310.4737  
Tasa Fija 351,629.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202227/01/202311.155 Tasa Fija 212,364.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202226/12/202211.155 Tasa Fija 165.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202208/02/202311.155 Tasa Fija 1,492,369.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202214/04/202312.4519 Tasa Fija 683,709.79  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202203/03/202312.4519 Tasa Fija 764,922.46  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202211/04/202312.4519 Tasa Fija 113,165.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202208/02/202311.155 Tasa Fija 7,000.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202208/02/202311.155 Tasa Fija 1,314,445.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202207/02/202311.155 Tasa Fija 473,994.53  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202215/02/202310.4612  
Tasa Fija 1,004,940.01  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202217/01/202311.155 Tasa Fija 204,094.80  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202209/01/202311.155 Tasa Fija 37,768.45  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202208/02/202311.155 Tasa Fija 1,055,163.27  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202217/01/202310.3875  
Tasa Fija 1,261,541.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202221/03/202310.822  
Tasa Fija 5,016,533.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/10/202203/02/202311.185 Tasa Fija 1,278,114.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/10/202215/02/202311.185 Tasa Fija 3,345.60  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/10/202216/02/202311.185 Tasa Fija 531,793.90  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/10/202216/02/202310.4737  
Tasa Fija 1,004,654.98  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/10/202218/01/202310.3875  
Tasa Fija 1,261,541.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/10/202218/01/202311.185 Tasa Fija 14,959.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/10/202210/01/202311.185 Tasa Fija 24,860.62  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/10/202221/03/202310.822  
Tasa Fija 5,016,533.61  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/10/202215/03/202310.3875  
Tasa Fija 8,578,483.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202210/01/202311.22 Tasa Fija 74,317.49  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202215/02/202311.22 Tasa Fija 11,651,710.15  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202202/01/202311.22 Tasa Fija 174,695.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202214/02/202311.22 Tasa Fija 143,839.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202225/01/202311.22 Tasa Fija 775,886.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202218/04/202312.4814 Tasa Fija 493,644.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202213/04/202312.4814 Tasa Fija 1,005,741.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202213/04/202312.4814 Tasa Fija 5,703,394.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202218/04/202312.4814 Tasa Fija 18,158.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/10/202217/02/202310.8125  
Tasa Fija 1,003,904.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202203/02/202311.22 Tasa Fija 853,907.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202209/01/202311.22 Tasa Fija 1,112,957.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202215/02/202311.22 Tasa Fija 950,630.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202217/02/202311.22 Tasa Fija 2,044,879.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202215/02/202311.22 Tasa Fija 39,137.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202213/04/202312.4814 Tasa Fija 370,817.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202217/01/202311.22 Tasa Fija 92,751.95  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202215/02/202311.22 Tasa Fija 244,370.87

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 84 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202210/01/202311.22	Tasa Fija	343,845.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202210/01/202311.22	Tasa Fija	32,476.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202208/02/202311.22	Tasa Fija	635,435.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202213/02/202311.22	Tasa Fija	14,723.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202217/03/202312.4814	Tasa Fija	223,196.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202218/04/202312.4814	Tasa Fija	116,682.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/10/202217/02/202310.8125		Tasa Fija	1,003,904.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202216/01/202311.22	Tasa Fija	301,357.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202213/02/202311.22	Tasa Fija	444,440.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/10/202219/01/202310.8125		Tasa Fija	367,958.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202214/02/202311.22	Tasa Fija	869,073.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/10/202214/04/202312.4814	Tasa Fija	186,123.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/10/202219/01/202310.3875		Tasa Fija	1,513,850.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202210/02/202311.2425	Tasa Fija	833,190.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202217/02/202311.2425	Tasa Fija	318,476.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202216/01/202311.2425	Tasa Fija	3,197,906.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202215/02/202311.2425	Tasa Fija	146,046.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202225/01/202311.2425	Tasa Fija	15,505.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202225/01/202311.2425	Tasa Fija	627,283.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202216/01/202311.2425	Tasa Fija	685,905.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202208/02/202311.2425	Tasa Fija	199,875.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202213/02/202311.2425	Tasa Fija	3,468,129.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202214/04/202312.508	Tasa Fija	153,270.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202213/04/202312.508	Tasa Fija	30,122.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202210/02/202311.2425	Tasa Fija	641,027.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202216/01/202311.2425	Tasa Fija	1,080,489.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202215/02/202311.2425	Tasa Fija	78,957.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202213/02/202311.2425	Tasa Fija	137,670.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/10/202220/02/202310.815		Tasa Fija	1,003,605.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202216/01/202311.2425	Tasa Fija	436,757.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202221/02/202311.2425	Tasa Fija	699,760.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202216/01/202311.2425	Tasa Fija	216,739.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/10/202213/02/202311.2425	Tasa Fija	246,811.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/10/202220/01/202310.3875		Tasa Fija	2,018,466.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/10/202221/04/202310.3875		Tasa Fija	4,036,933.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202202/01/20235.26	Tasa Fija	144,482.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202216/01/20235.26	Tasa Fija	289,359.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202213/02/20235.89396	Tasa Fija	139,918.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202217/02/202311.2725	Tasa Fija	133,301.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202219/01/202311.2725	Tasa Fija	47,511.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202215/02/202311.2725	Tasa Fija	136,213.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202205/01/202311.2725	Tasa Fija	559,804.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202225/01/202311.2725	Tasa Fija	294,051.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202225/01/202311.2725	Tasa Fija	5,141.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202201/03/202312.5574	Tasa Fija	404,021.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202218/04/202312.5574	Tasa Fija	8,740.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202225/01/202311.2725	Tasa Fija	225,820.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202221/04/202312.5574	Tasa Fija	1,657,453.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/10/202228/03/202312.5574	Tasa Fija	295,451.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/10/202223/01/202310.3875			

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 85 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 2,018,466.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/10/202217/03/202310.3875  
Tasa Fija 11,606,183.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/10/202223/01/202311.2725 Tasa Fija 29,285.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/10/202216/01/202311.2725 Tasa Fija 10,838.22  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/10/202223/01/202310.8375  
Tasa Fija 367,520.87  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/10/202223/01/202310.8375  
Tasa Fija 501,354.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/10/202217/02/202311.2725 Tasa Fija 306,387.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/10/202213/02/202311.2725 Tasa Fija 36,115.30  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/10/202221/02/202310.822  
Tasa Fija 1,003,306.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202226/01/202311.2705 Tasa Fija 71,512.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202220/01/202311.2705 Tasa Fija 126,550.54  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202216/01/202311.2705 Tasa Fija 4,128.32  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202222/02/202311.2705 Tasa Fija 390,633.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202210/01/202311.2705 Tasa Fija 216,908.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202215/02/202311.2705 Tasa Fija 2,602,160.43  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202230/01/202311.2705 Tasa Fija 21,944.95  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202201/03/202312.5581 Tasa Fija 23,101.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202213/02/20235.853 Tasa Fija 197,763.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202223/01/202311.2705 Tasa Fija 20,702.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202209/01/202311.2705 Tasa Fija 48,560.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202208/02/202311.2705 Tasa Fija 11,074.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202213/02/202311.2705 Tasa Fija 71,205.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202211/04/202312.5581 Tasa Fija 29,941.06  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/202222/02/202310.8359  
Tasa Fija 1,003,009.97  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/202222/02/202310.8359  
Tasa Fija 1,003,009.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202217/02/202311.2705 Tasa Fija 55,582.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202224/01/202311.2705 Tasa Fija 39,645.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202208/02/202311.2705 Tasa Fija 116,997.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202210/01/202311.2705 Tasa Fija 814,278.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202223/02/202311.2705 Tasa Fija 571,746.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202221/04/202312.5581 Tasa Fija 1,875,902.12  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/202205/04/202310.3875  
Tasa Fija 394,610.23  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/202224/01/202310.8472  
Tasa Fija 330,471.41  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202217/02/202311.2802 Tasa Fija 111,078.49  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202215/02/202311.2802 Tasa Fija 814,590.38  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202215/02/202311.2802 Tasa Fija 236,144.54  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202217/04/202312.5399 Tasa Fija 6,123.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202213/04/202312.5399 Tasa Fija 201,979.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202224/01/202311.2802 Tasa Fija 326,352.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202219/01/202311.2802 Tasa Fija 6,497.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202216/01/202311.2802 Tasa Fija 64,284.45  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202215/02/202311.2802 Tasa Fija 888,756.66  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/10/202223/02/202310.8375  
Tasa Fija 1,002,709.38  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/10/202223/02/202310.8375  
Tasa Fija 1,002,709.38  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202210/01/202311.2802 Tasa Fija 199,352.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202215/02/202311.2802 Tasa Fija 202,031.12

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 86 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202225/01/202311.2802	Tasa Fija	33,684.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202210/01/202311.2802	Tasa Fija	10,991.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202208/02/202311.2802	Tasa Fija	21,189.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202213/02/202311.2802	Tasa Fija	19,296.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202217/02/202311.2802	Tasa Fija	159,728.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202220/01/202311.2802	Tasa Fija	163,154.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202210/02/202311.2802	Tasa Fija	273,897.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/10/202225/05/202310.8472	Tasa Fija	1,222,205.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/10/202225/04/20234.39143	Tasa Fija	57,775,906.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202223/02/202311.325	Tasa Fija	119,267.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202217/01/202311.325	Tasa Fija	1,166,988.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202225/01/202311.325	Tasa Fija	71,424.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202215/02/202311.325	Tasa Fija	244,898.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202213/02/202311.325	Tasa Fija	26,057.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202225/04/202312.5325	Tasa Fija	600,602.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202220/04/202312.5325	Tasa Fija	3,146,755.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202220/01/202311.325	Tasa Fija	172,627.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202210/02/202311.325	Tasa Fija	620,164.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202216/01/202311.325	Tasa Fija	113,965.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202225/04/202312.5325	Tasa Fija	9,748.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202225/04/202312.5325	Tasa Fija	6,552.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/10/202226/01/202310.8472	Tasa Fija	450,813.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202203/02/202311.325	Tasa Fija	106,632.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202226/01/202311.325	Tasa Fija	136,188.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202224/02/202311.325	Tasa Fija	234,702.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202227/01/202311.325	Tasa Fija	242,383.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202220/04/202312.5325	Tasa Fija	1,002,934.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202220/04/202312.5325	Tasa Fija	4,197,201.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/10/202224/02/202310.8472	Tasa Fija	1,001,807.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/10/202224/02/202310.8472	Tasa Fija	1,001,807.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202225/04/202312.5325	Tasa Fija	83,452.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202225/01/202311.3331	Tasa Fija	598,670.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202227/01/202311.3331	Tasa Fija	47,934.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202223/02/202311.3331	Tasa Fija	256,869.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202225/04/202312.5225	Tasa Fija	171,218.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202227/02/202310.845	Tasa Fija	1,001,506.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202220/02/202311.3331	Tasa Fija	6,534,280.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202228/02/202311.3331	Tasa Fija	447,610.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202223/01/202311.3331	Tasa Fija	96,695.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202213/04/202312.5225	Tasa Fija	133,663.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202220/02/202311.3331	Tasa Fija	23,315.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202228/04/202310.3875	Tasa Fija	2,018,466.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202209/01/20235.29421	Tasa Fija	192,569.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202231/07/202310.1831	Tasa Fija	7,364,155.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202216/03/202310.3875	Tasa Fija	15,138,500.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202228/04/202310.8545	Tasa Fija	1,752,110.60

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 87 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202210/02/202311.341	Tasa Fija	605,361.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202223/02/202311.341	Tasa Fija	862,629.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202220/02/202311.341	Tasa Fija	123,086.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202212/01/202311.341	Tasa Fija	228,065.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202208/02/202311.341	Tasa Fija	2,167,298.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202220/02/202311.341	Tasa Fija	2,317,842.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202203/03/202312.5238	Tasa Fija	18,491.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202210/02/202311.341	Tasa Fija	124,156.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202225/01/202311.341	Tasa Fija	84,318.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/11/202215/02/202311.341	Tasa Fija	435,117.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/11/202230/01/202310.8605		Tasa Fija	450,271.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/11/202230/05/202310.8605		Tasa Fija	190,114.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202228/02/202311.353	Tasa Fija	635,528.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202225/01/202311.353	Tasa Fija	232,944.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202225/01/202311.353	Tasa Fija	4,281.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202222/02/202311.353	Tasa Fija	2,966,319.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202220/02/202311.353	Tasa Fija	13,768.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202217/02/202311.353	Tasa Fija	712,500.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202220/02/202311.353	Tasa Fija	474,797.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202215/02/202311.353	Tasa Fija	710,411.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202225/01/202311.353	Tasa Fija	2,691.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202222/02/202311.353	Tasa Fija	947,739.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202211/04/202312.5689	Tasa Fija	28,646.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202201/02/202311.353	Tasa Fija	22,712.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202210/01/202311.353	Tasa Fija	556,256.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202210/01/202311.353	Tasa Fija	788,202.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202222/02/202311.353	Tasa Fija	175,895.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202202/05/202312.5689	Tasa Fija	289,494.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/11/202221/03/202310.822		Tasa Fija	5,016,533.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/11/202203/03/202311.353	Tasa Fija	1,207,048.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/11/202203/03/202310.3875		Tasa Fija	2,018,466.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202201/03/202311.3699	Tasa Fija	46,454.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202218/01/202311.3699	Tasa Fija	1,230,558.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202222/02/202311.3699	Tasa Fija	21,013.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202207/03/202312.5571	Tasa Fija	4,747.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202223/03/202312.5571	Tasa Fija	1,288.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202202/05/202312.5571	Tasa Fija	474,222.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202202/05/202312.5571	Tasa Fija	9,033.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202227/02/202311.3699	Tasa Fija	118,949.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202201/03/202311.3699	Tasa Fija	216,735.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202225/01/202311.3699	Tasa Fija	21,471.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202220/02/202311.3699	Tasa Fija	56,624.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202202/05/202312.5571	Tasa Fija	593,127.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202202/01/202310.756	Tasa Fija	417,210.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202227/02/202311.3699	Tasa Fija	5,608,193.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202201/03/202311.3699	Tasa Fija	1,018,537.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202203/03/202311.3699	Tasa Fija	264,762.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202202/05/202312.5571	Tasa Fija	34,704.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/11/202221/03/202310.822		Tasa Fija	1,003,306.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202220/04/202312.5571	Tasa Fija	1,239,218.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/11/202227/04/202312.5571	Tasa Fija	6,302,248.35

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 88 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202202/02/202310.3987	
Tasa Fija 201,733.12	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202203/03/202310.3875	
Tasa Fija 2,018,466.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202203/03/202310.409	
Tasa Fija 1,007,806.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202202/02/202310.3987	
Tasa Fija 302,599.68	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202203/03/202311.375	Tasa Fija 191,588.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202201/03/202311.375	Tasa Fija 236,098.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202216/01/202311.375	Tasa Fija 125,012.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202208/02/202311.375	Tasa Fija 212,231.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202227/02/202311.375	Tasa Fija 173,041.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202216/01/20235.38419	Tasa Fija 402,685.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202222/02/202311.375	Tasa Fija 57,517.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202207/03/202311.375	Tasa Fija 1,017,378.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202218/04/202312.608	Tasa Fija 119,084.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202213/04/202312.608	Tasa Fija 101,491.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202224/02/202311.375	Tasa Fija 294,430.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202202/05/202312.608	Tasa Fija 99,698.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202204/05/202310.409	
Tasa Fija 2,015,613.50	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202202/02/202311.375	Tasa Fija 49,800.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202227/02/202311.375	Tasa Fija 80,654.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202227/02/202311.375	Tasa Fija 798,242.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202207/03/202310.3875	
Tasa Fija 4,036,933.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202231/10/202310.3875	
Tasa Fija 2,018,466.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202205/05/202310.409	
Tasa Fija 4,031,227.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202205/05/202310.409	
Tasa Fija 4,706,457.52	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202202/01/202310.7625	Tasa Fija 104,905.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202202/01/202310.7625	Tasa Fija 1,527,858.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202224/02/202311.3875	Tasa Fija 1,226,357.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202228/02/202311.3875	Tasa Fija 283,856.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202201/02/202311.3875	Tasa Fija 57,577.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202227/02/202311.3875	Tasa Fija 889,706.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202201/03/202311.3875	Tasa Fija 21,077.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202224/01/202311.3875	Tasa Fija 1,135,251.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202227/02/202311.3875	Tasa Fija 2,349,420.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202204/04/202312.5968	Tasa Fija 189,065.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/202208/03/202310.4287	
Tasa Fija 604,171.48	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202225/01/202311.3875	Tasa Fija 53,046.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202227/02/202311.3875	Tasa Fija 354,164.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/202203/02/202310.409	
Tasa Fija 453,513.04	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202206/01/202310.7625	Tasa Fija 321,447.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202213/01/202311.3875	Tasa Fija 567,454.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202215/02/202311.3875	Tasa Fija 98,605.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202220/02/202311.3875	Tasa Fija 201,578.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202203/01/202310.7625	Tasa Fija 57,831.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202217/01/202311.3875	Tasa Fija 129,063.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202227/02/202311.3875	Tasa Fija 12,241.77

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 89 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202201/03/202311.3875	Tasa Fija	142,196.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202230/01/202311.3875	Tasa Fija	1,048.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202202/05/202312.5968	Tasa Fija	86,784.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/202205/05/202310.409	Tasa Fija	2,015,613.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/202201/03/202310.3875	Tasa Fija	1,009,233.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202209/03/202311.4287	Tasa Fija	570,387.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202216/01/202311.4287	Tasa Fija	29,868.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202226/01/202311.4287	Tasa Fija	1,180,879.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202201/03/202311.4287	Tasa Fija	1,816,156.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202205/04/202312.612	Tasa Fija	96,052.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202209/03/202310.4343	Tasa Fija	1,006,666.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202202/01/202310.77	Tasa Fija	9,041.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202202/02/202311.4287	Tasa Fija	89,563.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202227/02/202311.4287	Tasa Fija	89,182.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202201/03/202311.4287	Tasa Fija	66,018.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202202/03/202310.3875	Tasa Fija	1,009,233.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202208/05/202310.4287	Tasa Fija	1,719,911.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202227/02/202311.4287	Tasa Fija	379,895.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202208/03/202311.4287	Tasa Fija	1,016,826.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202225/01/202311.4287	Tasa Fija	41,374.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202218/01/202311.4287	Tasa Fija	48,380.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202227/02/202311.4287	Tasa Fija	7,679.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202208/05/202310.3875	Tasa Fija	2,018,466.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202207/02/202311.4287	Tasa Fija	203,407.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202225/04/202312.612	Tasa Fija	45,521.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202205/04/202310.3875	Tasa Fija	7,619,711.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202209/03/202310.4343	Tasa Fija	5,033,331.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202208/05/202310.4287	Tasa Fija	8,055,619.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202210/03/202311.4543	Tasa Fija	314,117.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202210/01/202311.4543	Tasa Fija	47,119.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202227/02/202311.4543	Tasa Fija	1,643,115.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202213/02/202311.4543	Tasa Fija	5,175.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202205/04/202312.5924	Tasa Fija	135,324.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202216/01/20235.42019	Tasa Fija	744,991.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202227/02/20236.00478	Tasa Fija	2,726,900.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202210/03/202310.4471	Tasa Fija	1,005,513.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202227/02/202311.4543	Tasa Fija	107,180.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202208/05/202312.5924	Tasa Fija	151,157.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202210/03/202310.4471	Tasa Fija	5,027,568.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202203/03/202310.3875	Tasa Fija	1,009,233.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202225/01/202311.4543	Tasa Fija	775,952.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202225/01/202311.4543	Tasa Fija	543,829.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202201/03/202311.4543	Tasa Fija	36,225.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202221/03/202310.822		

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 90 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 1,003,306.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202209/05/202310.4343  
Tasa Fija 8,053,330.87  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202211/10/202710.5971  
Tasa Fija 24,896,804.66  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija -  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202207/03/202311.4746 Tasa Fija 723,524.84  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202209/05/202312.5405 Tasa Fija 88,594.48  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija -  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202206/01/202310.8 Tasa Fija 1,302,765.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202227/02/202311.4746 Tasa Fija 235,161.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202201/03/202311.4746 Tasa Fija 1,056,150.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202209/05/202312.5405 Tasa Fija 37,133.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202227/04/202312.5405 Tasa Fija 334,351.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202202/02/202311.4746 Tasa Fija 67,037.32  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202206/03/202311.4746 Tasa Fija 1,978,855.98  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202208/03/202311.4746 Tasa Fija 54,060.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202225/01/202311.4746 Tasa Fija 4,708.86  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202208/03/202311.4746 Tasa Fija 8,368.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202204/05/202312.5405 Tasa Fija 256,790.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202204/05/202312.5405 Tasa Fija 4,036,108.70  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202209/02/202310.4343  
Tasa Fija 503,333.18  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202210/05/202310.4471  
Tasa Fija 8,044,109.98  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202209/01/202310.8 Tasa Fija 267,579.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202205/01/202310.8 Tasa Fija 60,969.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202203/02/202311.4746 Tasa Fija 273,270.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202206/03/202311.4746 Tasa Fija 3,148,513.09  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202210/03/202311.4746 Tasa Fija 2,032,511.41  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202222/02/202311.4746 Tasa Fija 43,089.19  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202227/04/202312.5405 Tasa Fija 232,350.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202204/05/202312.5405 Tasa Fija 2,485,930.36  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202210/03/202310.4471  
Tasa Fija 5,027,568.74  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202208/03/202310.3875  
Tasa Fija 1,009,233.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202203/03/202311.4746 Tasa Fija 447,410.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202210/03/202311.4746 Tasa Fija 2,093,120.60  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202203/03/202311.4746 Tasa Fija 1,193,537.18  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202210/05/202310.3875  
Tasa Fija 5,046,166.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202210/05/202310.4471  
Tasa Fija 11,060,651.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202209/01/202311.37 Tasa Fija 152,550.32  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202209/01/202311.37 Tasa Fija 45,798.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202216/12/202211.37 Tasa Fija -  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202206/03/202311.73 Tasa Fija 448,000.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202215/02/202311.73 Tasa Fija 191,386.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/02/202311.73 Tasa Fija 621,295.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202206/03/202311.73 Tasa Fija 957,242.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija -  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202210/02/202311.73 Tasa Fija 244,937.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202206/03/202311.73 Tasa Fija 45,154.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202206/03/202311.73 Tasa Fija 154,691.46  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202212/05/202310.3875

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 91 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Fija 5,046,166.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202221/03/202310.822  
Tasa Fija 5,016,533.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202206/01/202311.37 Tasa Fija 714,657.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202210/01/202311.37 Tasa Fija 17,587.70  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija -  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202209/02/202311.73 Tasa Fija 295,579.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202209/02/202311.73 Tasa Fija 897,035.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202225/01/202311.73 Tasa Fija 23,714.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202206/03/202311.73 Tasa Fija 2,603.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202225/04/202312.4794 Tasa Fija 381,260.32  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202211/05/202310.4471  
Tasa Fija 15,082,706.21  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202214/03/202310.3875  
Tasa Fija 8,073,866.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202211/05/202310.4471  
Tasa Fija 8,044,109.98  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202212/05/202310.4471  
Tasa Fija 3,016,541.24  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202212/06/202310.4471  
Tasa Fija 402,205.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202223/01/20235.46531 Tasa Fija 406,011.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202210/01/202311.385 Tasa Fija 121,000.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202202/01/202311.385 Tasa Fija 56,551.49  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija -  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202203/01/202311.385 Tasa Fija 57,822.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija -  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202203/03/202311.7375 Tasa Fija 1,250,848.19  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202215/03/202310.4612  
Tasa Fija 5,024,700.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202204/01/202311.385 Tasa Fija 88,837.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202215/03/202311.7375 Tasa Fija 956,877.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202201/03/202311.7375 Tasa Fija 369,831.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202220/02/202311.7375 Tasa Fija 338,273.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202225/01/202311.7375 Tasa Fija 238,604.91  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202213/02/202310.4471  
Tasa Fija 452,481.19  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202212/05/202310.4471  
Tasa Fija 15,082,706.21  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202212/05/202310.3875  
Tasa Fija 4,036,933.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202214/03/202311.7375 Tasa Fija 508,291.70  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202212/05/202310.4471  
Tasa Fija 8,044,109.98  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202212/05/202310.3875  
Tasa Fija 100,923,333.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202205/05/202310.409  
Tasa Fija 56,850,378.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202210/01/202311.3957 Tasa Fija 7,937.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202213/02/202311.7499 Tasa Fija 31,852.32  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202208/03/202311.7499 Tasa Fija 919,043.97  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202215/05/202310.3875  
Tasa Fija 5,046,166.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202209/01/20235.4254 Tasa Fija 9,207.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202202/01/202311.3957 Tasa Fija 124,365.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202206/03/202311.7499 Tasa Fija 36,923.72

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 92 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202215/03/202311.7499	Tasa Fija	60,233.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202208/03/202311.7499	Tasa Fija	598,663.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202209/05/202312.6041	Tasa Fija	4,241.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202215/05/202310.4612	Tasa Fija	15,074,100.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202210/01/202311.3957	Tasa Fija	375,431.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202204/01/202311.3957	Tasa Fija	1,313,786.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202216/12/202211.3957	Tasa Fija	-
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202220/01/202311.7499	Tasa Fija	389,977.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202231/01/202311.7499	Tasa Fija	424,650.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202214/02/202311.7499	Tasa Fija	203,693.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202216/01/202311.7499	Tasa Fija	72,153.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202201/02/202311.7499	Tasa Fija	6,581,853.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202221/02/202311.7499	Tasa Fija	988,110.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202218/04/202312.6041	Tasa Fija	308,604.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202221/03/202310.822	Tasa Fija	4,013,226.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202216/03/202310.4737	Tasa Fija	1,004,654.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202216/03/202310.4737	Tasa Fija	5,023,274.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202215/05/202310.4612	Tasa Fija	8,039,520.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202203/01/202311.39	Tasa Fija	108,272.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202209/01/202311.39	Tasa Fija	1,726.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202227/02/202311.7549	Tasa Fija	248,605.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202208/03/202311.7549	Tasa Fija	545,960.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202231/03/202312.6416	Tasa Fija	73,624.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202216/01/20235.44705	Tasa Fija	9,004.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202220/02/20235.95974	Tasa Fija	2,257.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202216/05/202310.3875	Tasa Fija	5,046,166.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202210/01/202311.39	Tasa Fija	7,979.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202225/01/202311.7549	Tasa Fija	498,466.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202225/01/202311.7549	Tasa Fija	475,621.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202217/03/202310.8125	Tasa Fija	1,003,904.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202203/03/202311.7549	Tasa Fija	82,540.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202202/05/202312.6416	Tasa Fija	42,627.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202217/03/202310.8125	Tasa Fija	5,019,522.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202216/05/202310.4737	Tasa Fija	5,023,274.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202209/05/202312.6416	Tasa Fija	265,594.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202217/03/202311.7549	Tasa Fija	1,014,633.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202209/03/202310.3875	Tasa Fija	1,009,233.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202210/05/202310.4471	Tasa Fija	35,092,429.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202220/01/202310.3875	Tasa Fija	20,184,666.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202210/01/202311.3895	Tasa Fija	28,872.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202210/03/202311.7599	Tasa Fija	1,717,902.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202214/03/202311.7599	Tasa Fija	433,604.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202206/03/202311.7599	Tasa Fija	325,869.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202215/03/202311.7599	Tasa Fija	4,183,987.93

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 93 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202202/05/202312.6503	Tasa Fija	80,011.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503	Tasa Fija	346,641.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503	Tasa Fija	52,970.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/11/202217/05/202310.2875	Tasa Fija	5,045,722.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202206/03/202311.7599	Tasa Fija	10,849.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202215/03/202311.7599	Tasa Fija	287,354.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202221/02/202311.7599	Tasa Fija	416,556.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202217/03/202311.7599	Tasa Fija	304,312.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503	Tasa Fija	157,007.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/11/202217/03/202310.8125	Tasa Fija	1,003,904.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/01/202311.3895	Tasa Fija	182,474.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202214/02/202311.7599	Tasa Fija	295,357.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202213/03/202311.7599	Tasa Fija	287,203.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202215/03/202311.7599	Tasa Fija	110,227.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503	Tasa Fija	371,487.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/01/202311.3895	Tasa Fija	51,326.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/01/202311.3895	Tasa Fija	708,406.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202230/01/202311.7599	Tasa Fija	49,420.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202213/03/202311.7599	Tasa Fija	6,087,879.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202215/03/202311.7599	Tasa Fija	15,651.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202213/03/202311.7599	Tasa Fija	1,257,265.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503	Tasa Fija	25,812.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/11/202217/03/202310.8125	Tasa Fija	5,019,522.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/11/202217/01/20234.76286	Tasa Fija	19,547,136.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/11/202214/03/202310.3875	Tasa Fija	1,009,233.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202202/01/202311.3995	Tasa Fija	58,360.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202216/01/202311.3995	Tasa Fija	348,626.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202210/02/202311.79	Tasa Fija	1,124,860.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202222/02/202311.79	Tasa Fija	190,223.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202216/02/202311.79	Tasa Fija	200,483.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202213/03/202311.79	Tasa Fija	238,888.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202207/02/202311.79	Tasa Fija	552,534.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202213/03/202311.79	Tasa Fija	128,593.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/11/202219/05/202310.3875	Tasa Fija	5,046,166.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/11/202220/02/202310.815	Tasa Fija	451,622.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202210/01/202311.3995	Tasa Fija	19,780.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202216/01/202311.3995	Tasa Fija	169,394.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202230/01/202311.79	Tasa Fija	112,645.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202215/03/202311.79	Tasa Fija	52,857.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202213/02/202311.79	Tasa Fija	9,401.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202213/03/202311.79	Tasa Fija	235,232.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202215/03/202311.79	Tasa Fija	28,175.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202220/02/202311.79	Tasa Fija	262,175.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202202/05/202312.7027	Tasa Fija	42,633.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202211/05/202312.7027	Tasa Fija	95,844.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202211/05/202312.7027	Tasa Fija	3,731,691.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/11/202215/03/202310.3875	Tasa Fija	1,009,233.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/11/202219/05/202310.8125		

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 94 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 15,058,567.71  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/11/202220/02/202310.3875  
Tasa Fija 1,075,842.73  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/11/202217/05/20234.49646  
Tasa Fija 4,309,112.37  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/11/202220/01/20234.74129  
Tasa Fija 19,534,593.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202213/01/202311.3987 Tasa Fija 18,305.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202209/01/202311.3987 Tasa Fija 41,576.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202224/02/202311.7987 Tasa Fija 150,710.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202217/03/202311.7987 Tasa Fija 511,211.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202215/03/202311.7987 Tasa Fija 578,602.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202203/02/20235.51983 Tasa Fija 39,881.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202230/01/20235.51983 Tasa Fija 3,000,493.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202216/01/202311.3987 Tasa Fija 9,646.15  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202226/01/202311.7987 Tasa Fija 60,255.05  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202225/01/202311.7987 Tasa Fija 72,577.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202215/03/202311.7987 Tasa Fija 435,121.48  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202209/05/202312.8045 Tasa Fija 32,480.19  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202222/05/202310.3875  
Tasa Fija 5,046,166.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202216/03/202310.3875  
Tasa Fija 1,009,233.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202221/02/202311.7987 Tasa Fija 202,657.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202215/03/202311.7987 Tasa Fija 11,555.38  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202215/03/202311.7987 Tasa Fija 207,883.13  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202223/03/202310.8375  
Tasa Fija 1,002,709.38  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202222/05/202310.8359  
Tasa Fija 15,045,149.58  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202222/05/202310.8359  
Tasa Fija 9,027,089.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202222/05/20234.83557  
Tasa Fija 9,766,242.15  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202221/02/202310.3875  
Tasa Fija 1,009,233.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202221/02/202310.822  
Tasa Fija 3,009,920.17  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202222/05/202310.3875  
Tasa Fija 2,381,790.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202218/05/202310.8125  
Tasa Fija 5,019,522.57  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202218/05/202310.8125  
Tasa Fija 5,019,522.57  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202218/05/202310.8125  
Tasa Fija 5,019,522.57  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202218/05/202310.8125  
Tasa Fija 4,015,618.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202209/01/202311.4099 Tasa Fija 71,072.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202222/03/202311.8174 Tasa Fija 33,838.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202206/03/202311.8174 Tasa Fija 109,222.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202223/03/202311.8174 Tasa Fija 607,484.46  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202215/03/202311.8174 Tasa Fija 964,943.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202213/03/202311.8174 Tasa Fija 323,600.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202202/05/202312.8038 Tasa Fija 154,705.80  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202219/05/202312.8038 Tasa Fija 87,520.87

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 95 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202223/05/202310.8375  
Tasa Fija 3,509,482.81

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202217/03/202311.8174 Tasa Fija 196,779.36

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202222/02/202311.8174 Tasa Fija 64,086.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202208/03/202311.8174 Tasa Fija 742,259.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202216/05/202312.8038 Tasa Fija 72,743.43

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202210/01/202311.4099 Tasa Fija 20,717.27

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202225/01/202311.8174 Tasa Fija 1,355,068.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202225/01/202311.8174 Tasa Fija 201,546.50

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202222/03/202310.3875  
Tasa Fija 1,009,233.33

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202224/03/202310.8472  
Tasa Fija 1,001,807.87

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202218/05/202310.8125  
Tasa Fija 5,019,522.57

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202205/05/202310.409  
Tasa Fija 5,168,033.01

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202218/05/202310.8125  
Tasa Fija 5,019,522.57

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202218/05/202310.8125  
Tasa Fija 5,014,503.05

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202218/05/202310.8125  
Tasa Fija 5,019,522.57

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202206/01/202311.4194 Tasa Fija 35,612.60

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202209/01/202311.4194 Tasa Fija 23,018.69

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202225/01/202311.8324 Tasa Fija 79,342.49

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202214/04/202312.8165 Tasa Fija 313,113.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 418,439.09

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202218/05/202312.8165 Tasa Fija 3,399,804.72

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 49,210.47

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/11/202223/02/202310.8375  
Tasa Fija 451,219.22

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/11/202223/03/202310.3875  
Tasa Fija 1,009,233.33

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/11/202224/03/202310.8472  
Tasa Fija 1,001,807.87

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/11/202224/03/202310.3875  
Tasa Fija 2,523,083.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202210/01/202311.4194 Tasa Fija 75,591.83

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202210/03/202311.8324 Tasa Fija 879,867.07

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/02/202311.8324 Tasa Fija 47,071.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202210/02/202311.8324 Tasa Fija 215,320.77

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/02/202311.8324 Tasa Fija 77,229.16

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202221/03/202311.8324 Tasa Fija 1,032,716.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202222/03/202311.8324 Tasa Fija 171,140.43

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202201/03/202311.8324 Tasa Fija 525,087.43

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202203/04/202312.8165 Tasa Fija 1,152,258.05

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 365,954.30

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202211/05/202312.8165 Tasa Fija 230,985.02

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/01/202311.4194 Tasa Fija 224,281.91

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/01/202311.4194 Tasa Fija 6,672.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202230/01/202311.8324 Tasa Fija 9,392.85

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202221/03/202311.8324 Tasa Fija 4,561,724.79

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202213/02/202311.8324 Tasa Fija 72,510.70

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202222/02/202311.8324 Tasa Fija 40,657.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 82,957.02

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 96 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165	Tasa Fija	8,197.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202212/05/202312.8165	Tasa Fija	2,637,655.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202223/02/202310.3875	Tasa Fija	1,191,884.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202224/05/202310.3875	Tasa Fija	38,119,756.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202224/05/202310.8472	Tasa Fija	3,506,327.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/20234.69914	Tasa Fija	43,961,694.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202224/05/20234.74557	Tasa Fija	9,764,551.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202223/05/20234.74557	Tasa Fija	9,766,022.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202221/02/202310.822	Tasa Fija	389,142.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202224/01/20234.73557	Tasa Fija	19,529,059.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/202310.8125	Tasa Fija	5,014,503.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/202310.8125	Tasa Fija	5,019,522.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/202310.8125	Tasa Fija	5,019,522.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/202310.8125	Tasa Fija	5,019,522.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202206/01/202311.4249	Tasa Fija	7,666.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202220/01/202311.4249	Tasa Fija	1,255,011.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202225/01/202311.4249	Tasa Fija	32,819.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202223/01/202311.4249	Tasa Fija	40,672.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202202/03/202311.8499	Tasa Fija	5,543.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202221/03/202311.8499	Tasa Fija	466,262.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202221/03/202311.8499	Tasa Fija	1,528,625.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202223/01/20235.59355	Tasa Fija	2,977,519.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202213/03/20236.09789	Tasa Fija	4,783.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202215/03/202311.8499	Tasa Fija	2,619.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202219/05/202312.8165	Tasa Fija	3,512,729.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202217/03/202311.8499	Tasa Fija	1,121,630.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202209/02/202311.8499	Tasa Fija	52,675.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202215/03/202311.8499	Tasa Fija	1,215,092.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202226/05/202312.8165	Tasa Fija	1,287,908.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202223/05/202312.8165	Tasa Fija	19,481.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202213/01/202311.4249	Tasa Fija	116,917.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202226/05/202312.8165	Tasa Fija	11,472.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202227/01/202310.845	Tasa Fija	5,007,531.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202225/05/202310.8472	Tasa Fija	5,009,039.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202224/05/202310.8472	Tasa Fija	5,004,030.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202224/05/202310.8472	Tasa Fija	5,009,039.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202224/05/202310.8472	Tasa Fija	5,009,039.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202224/05/202310.8472	Tasa Fija	5,009,039.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202224/05/202310.8472	Tasa Fija	5,009,039.33

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 97 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202225/01/202311.4357	Tasa Fija	69,529.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202202/01/202311.4357	Tasa Fija	43,970.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202217/02/202311.8637	Tasa Fija	491,318.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202224/03/202311.8637	Tasa Fija	185,390.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202215/03/202311.8637	Tasa Fija	7,627.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202222/03/202311.8637	Tasa Fija	15,493.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202227/02/202310.845	Tasa Fija	450,677.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202225/01/202311.4357	Tasa Fija	13,087.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202216/01/202311.4357	Tasa Fija	24,991.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202216/01/202311.4357	Tasa Fija	61,147.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202217/03/202311.8637	Tasa Fija	645,459.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202206/03/202311.8637	Tasa Fija	59,527.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202201/02/202311.8637	Tasa Fija	110,011.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202226/05/202312.8241	Tasa Fija	314,583.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202223/10/20264.77335	Tasa Fija	93,299,011.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202220/01/202311.4357	Tasa Fija	2,072,401.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202227/02/202311.8637	Tasa Fija	204,035.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202221/03/202311.8637	Tasa Fija	42,806.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202221/03/202311.8637	Tasa Fija	2,590.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202227/03/202310.3875	Tasa Fija	1,009,233.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202227/02/202310.845	Tasa Fija	361,458.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202228/04/202310.3875	Tasa Fija	50,461,666.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202202/01/202311.4375	Tasa Fija	11,863.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202224/03/202311.872	Tasa Fija	683,931.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202213/02/202311.872	Tasa Fija	5,111.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202221/03/202311.872	Tasa Fija	94,130.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202230/03/202311.872	Tasa Fija	1,010,552.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202222/03/202311.872	Tasa Fija	955,803.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202204/05/202312.8367	Tasa Fija	512,183.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202206/03/20236.09559	Tasa Fija	21,835.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202203/01/202311.4375	Tasa Fija	790,577.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202205/01/202311.4375	Tasa Fija	60,138.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202217/03/202311.872	Tasa Fija	11,343.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202215/03/202311.872	Tasa Fija	181,171.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202222/03/202311.872	Tasa Fija	410,980.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202209/05/202312.8367	Tasa Fija	28,340.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202228/03/202310.3875	Tasa Fija	1,009,233.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202228/02/202310.8545	Tasa Fija	364,370.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202228/02/202310.3875	Tasa Fija	1,608,676.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202228/02/202310.8545	Tasa Fija	2,002,412.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202230/03/202310.8605	Tasa Fija	400,241.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202205/04/202310.3875	Tasa Fija	23,103,404.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202210/01/202311.4435	Tasa Fija	6,568.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202213/01/202311.4435	Tasa Fija	309,398.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202216/01/202311.4435	Tasa Fija	823,283.97

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 98 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202228/03/202311.881	Tasa Fija	469,363.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202213/03/202311.881	Tasa Fija	366,698.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202231/03/202311.881	Tasa Fija	636,445.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202228/04/202312.849	Tasa Fija	1,817.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202230/03/202311.881	Tasa Fija	2,020,461.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202210/01/202311.4435	Tasa Fija	1,869,265.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202221/03/202311.881	Tasa Fija	81,423.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202201/03/202310.3935	Tasa Fija	407,073.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202229/03/202310.3935	Tasa Fija	1,008,949.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202230/05/202310.8605	Tasa Fija	5,003,016.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202223/01/202311.4435	Tasa Fija	73,450.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202224/02/202311.881	Tasa Fija	1,072,566.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202213/03/202311.881	Tasa Fija	45,852.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202209/05/202312.849	Tasa Fija	28,341.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202216/01/202311.4435	Tasa Fija	40,983.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202225/01/202311.4435	Tasa Fija	9,866.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202207/02/202311.881	Tasa Fija	418,885.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202222/03/202311.881	Tasa Fija	969,124.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202231/03/202310.3935	Tasa Fija	1,008,949.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202227/01/202311.4487	Tasa Fija	49,959.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202213/01/202311.4487	Tasa Fija	66,464.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202225/01/202311.4487	Tasa Fija	39,936.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202210/02/202311.8937	Tasa Fija	41,510.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/03/202311.8937	Tasa Fija	962,418.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202221/03/202311.8937	Tasa Fija	152,681.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202222/05/202312.811	Tasa Fija	1,610,495.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811	Tasa Fija	275,247.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811	Tasa Fija	25,496.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/12/202231/03/202310.3987	Tasa Fija	1,008,665.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/12/202230/06/202310.8605	Tasa Fija	860,518.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202206/01/202311.4487	Tasa Fija	42,860.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202217/03/202311.8937	Tasa Fija	153,472.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202221/03/202311.8937	Tasa Fija	9,389.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811	Tasa Fija	269,465.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811	Tasa Fija	14,894.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/12/202230/03/202310.3987	Tasa Fija	1,008,665.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202227/01/202311.4487	Tasa Fija	36,116.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202202/01/202311.4487	Tasa Fija	21,034.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202206/01/202311.4487	Tasa Fija	5,453,643.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202206/01/202311.4487	Tasa Fija	1,322,984.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202227/03/202311.8937	Tasa Fija	5,368,011.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811	Tasa Fija	386,210.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/01/202311.4487	Tasa Fija	767,378.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202227/03/202311.8937	Tasa Fija	574,138.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/12/202202/03/202310.3987	Tasa Fija	1,190,225.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/12/202202/03/202310.3987	Tasa Fija	415,145.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/12/202202/03/202310.3987		

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 99 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Fija	504,332.79		
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202210/01/202311.459	Tasa Fija	58,814.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202217/01/202311.459	Tasa Fija	88,519.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202230/01/202311.459	Tasa Fija	101,446.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202218/01/202311.459	Tasa Fija	3,171,919.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202209/01/202311.459	Tasa Fija	539,840.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202230/01/202311.459	Tasa Fija	122,302.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202230/01/202311.459	Tasa Fija	797,334.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202206/01/202311.459	Tasa Fija	453,771.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202227/03/202311.8995	Tasa Fija	3,563,882.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202225/05/202312.7876	Tasa Fija	2,281,852.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202221/03/20236.12323	Tasa Fija	61,544.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202216/01/202311.459	Tasa Fija	84,429.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202228/02/202311.8995	Tasa Fija	24,887.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202229/03/202311.8995	Tasa Fija	151,350.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202229/03/202311.8995	Tasa Fija	16,694.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202230/05/202312.7876	Tasa Fija	57,370.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202211/05/202312.7876	Tasa Fija	281,462.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202230/05/202312.7876	Tasa Fija	17,123.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202203/03/202310.409		Tasa Fija	1,487,749.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202215/03/202311.8995	Tasa Fija	684,397.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202227/03/202311.8995	Tasa Fija	11,729.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202230/05/202312.7876	Tasa Fija	10,784.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202203/03/202310.409		Tasa Fija	394,164.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202203/03/202310.409		Tasa Fija	3,023,420.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202206/01/202311.459	Tasa Fija	48,195.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202222/03/202311.8995	Tasa Fija	24,344.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/12/202222/03/202311.8995	Tasa Fija	37,445.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202230/11/202310.409		Tasa Fija	50,390,337.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202202/06/202310.409		Tasa Fija	25,195,168.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202227/01/202311.4662	Tasa Fija	4,659,992.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202224/01/202311.4662	Tasa Fija	1,017,921.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202206/01/202311.4662	Tasa Fija	95,397.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202224/02/202311.9199	Tasa Fija	2,113,902.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202225/04/202312.7743	Tasa Fija	18,537.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202215/02/202311.9199	Tasa Fija	711,126.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202206/03/202310.4162		Tasa Fija	503,761.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202230/01/20235.63224	Tasa Fija	2,288,624.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202206/01/202311.4662	Tasa Fija	105,735.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202202/06/202312.7743	Tasa Fija	1,009,819.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202225/05/202312.7743	Tasa Fija	71,377.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202220/01/202311.4662	Tasa Fija	62,009.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202209/01/202311.4662	Tasa Fija	583,639.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202216/01/202311.4662	Tasa Fija	27,424.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202231/03/202311.9199	Tasa Fija	1,276,934.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202220/02/202311.9199	Tasa Fija	63,215.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202206/01/202311.4662	Tasa Fija	29,592.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/12/202223/02/202311.9199	Tasa Fija	3,466.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202206/03/202310.4162		Tasa Fija	379,054.97

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 100 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202203/04/202310.4162	
Tasa Fija 1,007,522.81	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202216/03/202310.4737	
Tasa Fija 5,023,274.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202216/03/202310.4737	
Tasa Fija 5,023,274.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202216/03/202310.4737	
Tasa Fija 5,023,274.89	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202206/01/202311.4749	Tasa Fija 29,041.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202217/01/202311.4749	Tasa Fija 5,615.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202225/01/202311.4749	Tasa Fija 241,402.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202224/03/202311.9299	Tasa Fija 1,286,253.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202204/04/202311.9299	Tasa Fija 548,388.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202210/02/202311.9299	Tasa Fija 26,864.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202227/03/202311.9299	Tasa Fija 174,467.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202203/03/202311.9299	Tasa Fija 371,091.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202229/03/202311.9299	Tasa Fija 2,977,921.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202202/05/202312.8042	Tasa Fija 222,529.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202229/05/202312.8042	Tasa Fija 1,713,677.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202220/01/202311.4749	Tasa Fija 117,855.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202223/01/202311.4749	Tasa Fija 342,038.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202223/01/202311.4749	Tasa Fija 179,993.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202206/01/202311.4749	Tasa Fija 26,394.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202229/03/202311.9299	Tasa Fija 991,578.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202207/02/202311.9299	Tasa Fija 266,230.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202204/04/202310.4249	
Tasa Fija 1,007,239.51	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202212/01/202311.4749	Tasa Fija 151,296.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202206/01/202311.4749	Tasa Fija 9,982.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202207/02/202311.9299	Tasa Fija 56,638.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202229/03/202311.9299	Tasa Fija 32,921.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202207/03/202310.4249	
Tasa Fija 367,227.59	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202207/03/202310.4249	
Tasa Fija 390,668.22	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202203/03/202311.9299	Tasa Fija 357,793.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202205/06/20234.72729	
Tasa Fija 9,786,472.30	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202205/07/20234.72714	
Tasa Fija 29,359,413.77	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 4,015,618.06	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 4,015,618.06	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 4,015,618.06	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 4,015,618.06	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 4,015,618.06	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202230/01/20235.66019	Tasa Fija 146,313.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202206/01/202311.4787	Tasa Fija 27,447.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202216/02/202311.93	Tasa Fija 2,310.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202207/03/202311.93	Tasa Fija 58,461.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202227/03/202311.93	Tasa Fija 774,377.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202202/06/202312.8071	Tasa Fija 103,332.95

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 101 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202216/05/202312.8071 Tasa Fija	44,630.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202208/03/202310.4287	
Tasa Fija 338,934.87	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202208/03/202310.4287	
Tasa Fija 328,067.63	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202213/01/202311.4787 Tasa Fija	4,300,071.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202216/02/202311.93 Tasa Fija	47,219.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202229/03/202311.93 Tasa Fija	239,186.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202208/03/202310.4287	
Tasa Fija 1,486,488.41	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202213/01/202311.4787 Tasa Fija	159,829.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202231/03/202311.93 Tasa Fija	366,784.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202219/05/202312.8071 Tasa Fija	112,984.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202205/04/202310.4287	
Tasa Fija 1,006,952.47	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202225/01/202311.4787 Tasa Fija	507,698.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202210/01/202311.4787 Tasa Fija	78,959.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202213/01/202311.4787 Tasa Fija	47,233.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202219/05/202312.8071 Tasa Fija	1,008,538.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202204/04/202310.4287	
Tasa Fija 7,446,916.97	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 4,015,618.06	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 4,015,618.06	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 3,513,665.80	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 3,513,665.80	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202202/01/20235.43361 Tasa Fija	271,657.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202220/02/20235.66962 Tasa Fija	98,935.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202227/03/20236.12831 Tasa Fija	4,067.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202227/01/202311.4843 Tasa Fija	70,640.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202213/01/202311.4843 Tasa Fija	109,925.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202205/04/202311.937 Tasa Fija	545,129.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202205/04/202311.937 Tasa Fija	4,757,133.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202206/06/202312.8007 Tasa Fija	547,481.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202206/06/202312.8007 Tasa Fija	26,379.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202206/06/202312.8007 Tasa Fija	35,913.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202209/03/202310.4343	
Tasa Fija 467,363.54	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202209/03/202310.4343	
Tasa Fija 196,784.65	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202231/01/202311.4843 Tasa Fija	51,489.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202211/01/202311.4843 Tasa Fija	2,804,369.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202213/01/202311.4843 Tasa Fija	61,456.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202203/04/202311.937 Tasa Fija	236,291.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202205/04/202311.937 Tasa Fija	647,064.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202229/03/202311.937 Tasa Fija	3,503,227.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202216/05/202312.8007 Tasa Fija	42,418.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202203/04/202311.937 Tasa Fija	188,680.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202202/06/202312.8007 Tasa Fija	1,042,107.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202207/02/202311.4843 Tasa Fija	126,891.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202207/02/202311.4843 Tasa Fija	1,358,876.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202224/03/202311.937 Tasa Fija	419,852.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202203/04/202311.937 Tasa Fija	3,715,733.88

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 102 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202203/03/202311.937	Tasa Fija	144,735.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202229/03/202311.937	Tasa Fija	53,294.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202206/06/202312.8007	Tasa Fija	56,777.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202205/04/202311.937	Tasa Fija	44,819.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202221/03/202310.4343	Tasa Fija	1,006,666.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202217/03/202310.8125	Tasa Fija	2,810,932.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202217/03/202310.8125	Tasa Fija	2,509,761.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202220/01/202311.4971	Tasa Fija	48,683.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202230/01/202311.4971	Tasa Fija	20,133.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202226/01/202311.4971	Tasa Fija	636,196.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202226/01/202311.4971	Tasa Fija	714,791.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202207/02/202311.4971	Tasa Fija	123,861.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202218/01/202311.4971	Tasa Fija	177,932.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202207/02/202311.4971	Tasa Fija	1,992,655.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202213/01/202311.4971	Tasa Fija	568,904.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202205/04/202311.9484	Tasa Fija	1,044,624.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202210/03/202311.9484	Tasa Fija	407,826.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484	Tasa Fija	1,323,940.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202205/04/202311.9484	Tasa Fija	356,950.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202206/03/202311.9484	Tasa Fija	120,526.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202205/04/202311.9484	Tasa Fija	34,422.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202209/05/202312.8042	Tasa Fija	127,508.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202213/03/202310.4471	Tasa Fija	452,481.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202213/01/202311.4971	Tasa Fija	331,768.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202231/03/202311.9484	Tasa Fija	6,000.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484	Tasa Fija	281,913.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202205/04/202311.9484	Tasa Fija	288,059.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484	Tasa Fija	54,777.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202213/01/202311.4971	Tasa Fija	764,223.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202225/01/202311.4971	Tasa Fija	16,303.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202213/01/202311.4971	Tasa Fija	39,535.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484	Tasa Fija	290,115.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484	Tasa Fija	206,366.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202230/05/202312.8042	Tasa Fija	592,569.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202213/03/202310.4471	Tasa Fija	270,269.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202213/03/202310.4471	Tasa Fija	286,649.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202209/06/202310.4471	Tasa Fija	40,220,549.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202210/03/202310.4471	Tasa Fija	1,187,189.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202224/03/20234.66771	Tasa Fija	58,670,881.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202229/03/20234.66771	Tasa Fija	58,670,881.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202204/04/20234.65771	Tasa Fija	58,670,572.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202207/04/20234.65771	Tasa Fija	58,670,572.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202212/04/20234.65771	Tasa Fija	58,670,572.48

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 103 / 11

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202210/02/202311.5035	Tasa Fija	34,111.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202230/01/202311.5035	Tasa Fija	82,468.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202225/01/202311.5035	Tasa Fija	2,325,880.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202220/01/202311.5035	Tasa Fija	1,286,930.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202227/02/202311.9545	Tasa Fija	257,685.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202213/03/202311.9545	Tasa Fija	210,430.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202203/04/202311.9545	Tasa Fija	607,343.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202229/03/202311.9545	Tasa Fija	4,615.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545	Tasa Fija	2,284,707.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202203/04/202311.9545	Tasa Fija	969,067.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202206/06/202312.7887	Tasa Fija	46,864.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202209/01/20235.51708	Tasa Fija	1,148,906.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202206/03/20235.70806	Tasa Fija	1,682,171.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202213/02/20235.70806	Tasa Fija	130,907.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202220/01/202311.5035	Tasa Fija	295,946.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202203/04/202311.9545	Tasa Fija	107,579.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545	Tasa Fija	29,001.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545	Tasa Fija	249,084.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545	Tasa Fija	282,679.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202213/01/202310.4535	Tasa Fija	42,624,455.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202230/01/202311.5035	Tasa Fija	243,288.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202220/01/202311.5035	Tasa Fija	13,696.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202221/03/202311.9545	Tasa Fija	80,192.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545	Tasa Fija	338,388.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202201/06/202312.7887	Tasa Fija	1,119,743.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202201/06/202312.7887	Tasa Fija	196,036.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202210/04/202310.4535	Tasa Fija	1,005,226.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202214/03/202310.4535	Tasa Fija	532,196.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202214/03/202310.4535	Tasa Fija	1,483,940.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202206/01/202311.5035	Tasa Fija	11,238.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202210/03/202311.9545	Tasa Fija	1,052,751.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202206/01/202311.5035	Tasa Fija	16,192.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202210/04/202311.9545	Tasa Fija	267,486.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202203/04/202310.4535	Tasa Fija	7,795,533.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202210/02/202311.5112	Tasa Fija	73,868.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202220/01/202311.5112	Tasa Fija	43,319.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202231/03/202311.9674	Tasa Fija	4,216,669.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202220/02/202311.9674	Tasa Fija	42,393.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202203/04/202311.9674	Tasa Fija	45,408.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202212/04/202311.9674	Tasa Fija	50,166.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202209/06/202312.775	Tasa Fija	2,862,030.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202212/05/202312.775	Tasa Fija	111,875.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202202/03/202311.9674	Tasa Fija	37,249.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202211/04/202310.4612	Tasa Fija	1,004,940.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202225/01/202311.5112	Tasa Fija	86,655.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202220/02/202311.9674	Tasa Fija	235,820.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202215/03/202311.9674	Tasa Fija	61,627.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202215/03/202310.4612	Tasa Fija	1,186,814.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202215/03/202310.4612		

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 104 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Fija 409,264.97	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202213/01/202311.5112	Tasa Fija 72,940.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202214/04/202310.4612	
Tasa Fija 1,004,940.01	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202210/01/202311.5237	Tasa Fija 138,148.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202203/02/202311.0237	Tasa Fija 9,525,924.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/02/202311.5237	Tasa Fija 258,430.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202217/03/202311.975	Tasa Fija 4,551.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202205/04/202311.975	Tasa Fija 1,534.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202214/03/202311.975	Tasa Fija 29,023.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879	Tasa Fija 111,548.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202201/06/202312.7879	Tasa Fija 1,754,014.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879	Tasa Fija 8,137.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202214/04/202310.4737	
Tasa Fija 1,004,654.98	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/02/202311.5237	Tasa Fija 689,375.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202201/03/202311.975	Tasa Fija 242,838.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202210/04/202311.975	Tasa Fija 739,873.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879	Tasa Fija 418,593.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879	Tasa Fija 27,832.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202224/02/20235.69881	Tasa Fija 13,250.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202216/03/202310.4737	
Tasa Fija 310,953.15	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/01/202311.5237	Tasa Fija 198,432.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202204/01/202311.5237	Tasa Fija 654,456.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/03/202311.975	Tasa Fija 6,823.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202211/04/202311.975	Tasa Fija 280,941.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202210/04/202311.975	Tasa Fija 154,900.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202212/04/202311.975	Tasa Fija 82,862.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202229/03/202311.975	Tasa Fija 54,158.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202211/05/202312.7879	Tasa Fija 128,501.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202208/06/202312.7879	Tasa Fija 298,562.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202220/01/202311.5237	Tasa Fija 1,509,181.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/02/202311.5237	Tasa Fija 66,282.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202231/03/202311.975	Tasa Fija 577,610.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202214/04/202311.975	Tasa Fija 94,949.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202210/04/202311.975	Tasa Fija 6,892,332.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879	Tasa Fija 24,814.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202202/06/202312.7879	Tasa Fija 430,229.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202212/04/202310.4737	
Tasa Fija 1,004,654.98	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/02/202311.8625	Tasa Fija 93,488.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/02/202311.8625	Tasa Fija 812,349.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202215/03/202312.2125	Tasa Fija 7,913.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/04/202312.2125	Tasa Fija 127,772.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202213/03/202312.2125	Tasa Fija 192,928.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202212/04/202312.2125	Tasa Fija 1,080,433.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/04/202312.2125	Tasa Fija 570,486.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202213/03/20235.70907	Tasa Fija 18,246.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202227/03/20236.09484	Tasa Fija 43,866.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202213/02/20235.70907	Tasa Fija 19,599.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202213/03/20235.70907	Tasa Fija 972,024.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202217/03/202310.8125	
Tasa Fija 466,081.30	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202214/02/202311.8625	Tasa Fija 1,501,412.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202213/02/202311.8625	Tasa Fija 142,312.82

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 105 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202220/01/202311.8625	Tasa Fija	5,378,566.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202221/02/202312.2125	Tasa Fija	316,276.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/04/202312.2125	Tasa Fija	378,959.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202212/04/202312.2125	Tasa Fija	84,557.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/04/202312.2125	Tasa Fija	1,028,462.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202213/01/202311.8625	Tasa Fija	18,084.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202213/04/202310.8125	Tasa Fija	1,003,904.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202217/03/202310.8125	Tasa Fija	1,085,200.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202217/07/202310.8125	Tasa Fija	898,494.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202217/03/202310.8125	Tasa Fija	2,007,809.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202230/11/20279.38	Tasa Fija	6,285,467.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202230/11/20279.38	Tasa Fija	59,314,553.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202230/11/20279.38	Tasa Fija	21,677,847.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202202/01/20235.52102	Tasa Fija	152,488.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202213/02/20235.70553	Tasa Fija	1,030,259.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202210/01/202311.865	Tasa Fija	23,059.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202202/02/202311.865	Tasa Fija	2,956,962.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202214/04/202312.2125	Tasa Fija	416,817.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202217/03/202312.2125	Tasa Fija	209,649.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202212/04/202312.2125	Tasa Fija	724,359.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202212/06/202312.8538	Tasa Fija	2,455,721.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202206/06/202312.8538	Tasa Fija	91,593.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202213/01/202311.865	Tasa Fija	240,772.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202210/04/202312.2125	Tasa Fija	1,177,714.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202213/01/202311.865	Tasa Fija	306,221.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202213/01/202311.865	Tasa Fija	245,863.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202213/01/202311.865	Tasa Fija	167,219.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202214/04/202312.2125	Tasa Fija	260,986.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202217/03/202310.815	Tasa Fija	1,084,876.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202218/04/202310.815	Tasa Fija	1,003,605.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202217/03/202310.815	Tasa Fija	351,261.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202213/02/202311.865	Tasa Fija	136,360.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202227/01/202311.865	Tasa Fija	4,849,716.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202205/04/202312.2125	Tasa Fija	749,478.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202225/04/202312.8538	Tasa Fija	11,212.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202213/06/202312.8538	Tasa Fija	36,348.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202227/01/202311.865	Tasa Fija	162,313.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202217/03/202310.815	Tasa Fija	446,876.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202219/04/202310.815	Tasa Fija	1,003,605.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202231/08/20234.82553	Tasa Fija	150,460,158.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202218/12/202610.972	Tasa Fija	12,036,844.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202213/03/20235.7075	Tasa Fija	196,363.13

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 106 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202210/02/202311.872	Tasa Fija	18,914.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202214/04/202312.216	Tasa Fija	148,624.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202210/04/202312.216	Tasa Fija	764,079.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202217/03/202312.216	Tasa Fija	482,477.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202216/06/202312.8666	Tasa Fija	304,788.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202212/06/202312.8666	Tasa Fija	1,291,009.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202230/05/202312.8666	Tasa Fija	42,190.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202214/02/202311.872	Tasa Fija	131,153.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202227/01/202311.872	Tasa Fija	5,935.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202217/03/202312.216	Tasa Fija	79,678.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202210/04/202312.216	Tasa Fija	296,068.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/12/202219/04/202310.822		Tasa Fija	1,003,306.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/12/202221/03/202310.822		Tasa Fija	407,986.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/12/202220/04/202310.822		Tasa Fija	1,003,306.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/12/202221/03/202310.822		Tasa Fija	1,089,325.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202223/01/202311.872	Tasa Fija	237,935.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202215/02/202311.872	Tasa Fija	25,207.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202230/01/202311.872	Tasa Fija	142,627.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202227/01/202311.872	Tasa Fija	494,487.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202210/04/202312.216	Tasa Fija	7,623.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202215/03/202312.216	Tasa Fija	61,368.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202220/04/202312.216	Tasa Fija	1,505,599.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202203/04/202312.216	Tasa Fija	120,833.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202206/06/202312.8666	Tasa Fija	335,335.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/12/202214/03/202312.216	Tasa Fija	4,534.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202213/02/202311.8859	Tasa Fija	255,852.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202227/01/202311.8859	Tasa Fija	490,406.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202210/03/202312.2205	Tasa Fija	96,268.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202221/03/202312.2205	Tasa Fija	207,762.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202210/04/202312.2205	Tasa Fija	473,098.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202213/03/202312.2205	Tasa Fija	61,941.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202225/05/202312.87	Tasa Fija	190,720.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202221/03/20235.72356	Tasa Fija	11,683.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202203/04/20236.11297	Tasa Fija	17,536.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/12/202222/03/202310.8359		Tasa Fija	1,066,081.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202213/02/202311.8859	Tasa Fija	205,189.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202227/01/202311.8859	Tasa Fija	1,298,036.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202221/03/202312.2205	Tasa Fija	292,418.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/12/202220/04/202310.8359		Tasa Fija	1,003,009.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/12/202221/04/202310.8359		Tasa Fija	1,003,009.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202216/01/202311.8859	Tasa Fija	80,192.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202227/01/202311.8859	Tasa Fija	3,622,188.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202210/04/202312.2205	Tasa Fija	214,371.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/12/202222/03/202310.8359		Tasa Fija	285,935.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202206/06/202312.87	Tasa Fija	42,067.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/12/202227/01/202311.8859	Tasa Fija	11,698.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/12/202221/04/202310.8359		Tasa Fija	20,060,199.44

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 107 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/12/202223/03/202310.8375

Tasa Fija 451,219.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202214/02/202311.8875 Tasa Fija 6,292.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202230/01/202311.8875 Tasa Fija 46,029.19  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202227/01/202311.8875 Tasa Fija 608,884.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202214/04/202312.225 Tasa Fija 997,860.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202219/04/202312.225 Tasa Fija 192,468.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202222/03/202312.225 Tasa Fija 74,337.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202227/03/202312.225 Tasa Fija 55,259.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202219/04/202312.225 Tasa Fija 595,603.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202223/03/202312.225 Tasa Fija 101,041.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202216/06/202312.8674 Tasa Fija 309,995.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202212/05/202312.8674 Tasa Fija 3,499.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202220/06/202312.8674 Tasa Fija 668,491.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202220/06/202312.8674 Tasa Fija 27,491.87

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/12/202221/04/202310.8375

Tasa Fija 1,002,709.38

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202227/01/202311.8875 Tasa Fija 3,957.32  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202223/03/202312.225 Tasa Fija 51,478.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202219/04/202312.225 Tasa Fija 83,548.03  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202219/04/202312.225 Tasa Fija 99,430.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202220/06/202312.8674 Tasa Fija 86,115.04

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/12/202223/03/202310.8375

Tasa Fija 441,679.99

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202220/02/202311.8875 Tasa Fija 1,399,439.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202217/04/202312.225 Tasa Fija 8,405,414.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202225/05/202312.8674 Tasa Fija 402,546.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202201/06/202312.8674 Tasa Fija 1,805,705.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202227/01/202311.8875 Tasa Fija 274,400.93  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202213/03/202312.225 Tasa Fija 165,771.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202217/04/202312.225 Tasa Fija 7,954,702.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202225/01/202311.8972 Tasa Fija 69,178.41  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202210/02/202311.8972 Tasa Fija 132,024.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202220/02/202311.8972 Tasa Fija 4,451,698.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202220/02/202311.8972 Tasa Fija 7,479.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202220/02/202311.8972 Tasa Fija 1,142,285.82  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202227/01/202311.8972 Tasa Fija 311,800.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202221/04/202312.235 Tasa Fija 187,361.38  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202223/03/202312.235 Tasa Fija 36,073.43  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202217/04/202312.235 Tasa Fija 1,095,887.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202221/03/202312.235 Tasa Fija 218,249.05  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202217/04/202312.235 Tasa Fija 1,980,610.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202227/01/202311.8972 Tasa Fija 12,396.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202217/04/202312.235 Tasa Fija 204,223.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202220/06/202312.8735 Tasa Fija 87,381.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202227/01/202311.8972 Tasa Fija 7,346.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202217/04/202312.235 Tasa Fija 70,358.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202213/06/202312.8735 Tasa Fija 41,952.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202220/06/202312.8735 Tasa Fija 23,457.90

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/12/202223/06/202310.8472

Tasa Fija 12,522,598.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202223/03/202312.235 Tasa Fija 40,682.80  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202213/01/202311.8972 Tasa Fija 52,435.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202220/02/202311.895 Tasa Fija 3,207,493.46  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202220/02/202311.895 Tasa Fija 1,557,423.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202227/01/202311.895 Tasa Fija 1,221,024.51

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 108 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202224/03/202312.2375	Tasa Fija	47,072.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202217/04/202312.2375	Tasa Fija	2,741,672.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202219/04/202312.2375	Tasa Fija	67,591.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202213/04/202312.2375	Tasa Fija	1,202,039.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202223/06/202312.884	Tasa Fija	945,520.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/12/202227/03/202310.845	Tasa Fija	367,079.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202224/02/202311.895	Tasa Fija	118,790.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202210/02/202311.895	Tasa Fija	156,939.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202207/02/202311.895	Tasa Fija	59,057.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202213/01/202311.895	Tasa Fija	54,916.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202227/03/202312.2375	Tasa Fija	200,149.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202203/04/202312.2375	Tasa Fija	225,796.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202205/04/202312.2375	Tasa Fija	93,292.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202217/04/202312.2375	Tasa Fija	150,180.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202214/04/202312.2375	Tasa Fija	443,394.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/12/202226/04/202310.845	Tasa Fija	20,030,125.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/12/202222/06/202310.845	Tasa Fija	12,518,828.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202203/03/20235.74966	Tasa Fija	10,927.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202205/04/202312.2472	Tasa Fija	16,207.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202209/01/20235.5225	Tasa Fija	12,187.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202220/02/20235.74966	Tasa Fija	4,158,880.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202213/01/202311.9045	Tasa Fija	87,979.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202217/04/202312.2472	Tasa Fija	454,013.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202217/04/202312.2472	Tasa Fija	111,521.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202230/01/202311.9045	Tasa Fija	243,768.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202213/03/202312.2472	Tasa Fija	61,357.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/12/202226/06/202310.8545	Tasa Fija	12,515,075.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/12/202228/03/202310.8545	Tasa Fija	407,744.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/12/202228/03/202310.8545	Tasa Fija	271,149.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/12/202218/07/20234.64871	Tasa Fija	9,759,488.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/12/202224/07/20234.64871	Tasa Fija	29,278,465.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/12/202223/06/202310.8545	Tasa Fija	15,018,090.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202220/02/20235.76074	Tasa Fija	258,786.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202226/04/202312.2235	Tasa Fija	410,199.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202217/04/202312.2235	Tasa Fija	239,539.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/12/202227/06/202310.862	Tasa Fija	12,511,314.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202213/02/202311.912	Tasa Fija	7,500.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202218/01/202311.912	Tasa Fija	84,967.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202214/04/202312.2235	Tasa Fija	76,939.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202223/06/202312.8999	Tasa Fija	3,251,234.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/12/202228/04/202310.862	Tasa Fija	1,000,905.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202230/01/202311.912	Tasa Fija	312,695.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202212/04/202312.2235	Tasa Fija	54,464.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202215/03/202312.2235	Tasa Fija	1,599,392.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202214/04/202312.2235	Tasa Fija	1,933,722.88

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 109/ 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202229/03/202312.2235	Tasa Fija	130,563.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202213/06/202312.8999	Tasa Fija	41,793.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202223/01/20235.52304	Tasa Fija	344,917.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202206/03/20235.78023	Tasa Fija	111,891.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/12/202228/04/202310.8605	Tasa Fija	1,000,603.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202203/02/202311.9105	Tasa Fija	12,023.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202209/01/202311.9105	Tasa Fija	573.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202221/04/202312.2249	Tasa Fija	2,930,189.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202226/04/202312.2249	Tasa Fija	32,357.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202226/04/202312.2249	Tasa Fija	193,734.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202210/04/20236.1914	Tasa Fija	119,104.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/12/202230/03/202310.8605	Tasa Fija	350,211.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/12/202228/06/202310.8605	Tasa Fija	15,009,050.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202227/02/202311.9105	Tasa Fija	20,027.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202227/02/202311.9105	Tasa Fija	122,698.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202208/02/202311.9105	Tasa Fija	54,644.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202217/03/202312.2249	Tasa Fija	12,040.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202230/03/202312.2249	Tasa Fija	29,100.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202224/04/202312.2249	Tasa Fija	3,146,012.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202227/03/202312.2249	Tasa Fija	1,439.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202227/02/202311.9105	Tasa Fija	56,813.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202227/01/202311.9105	Tasa Fija	11,097.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202224/04/202312.2249	Tasa Fija	39,761.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202231/03/202312.2249	Tasa Fija	145,521.72
FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANO30/06/202201/12/20236.58	Tasa Fija	2,145,226.36
FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANO30/06/202231/12/20237.30375	Tasa Fija	623,652.42

TOTAL	6,743,574.63	10,893,878,907.37	13,251,071,691.55	2,298,284,134.37
	1,887,363,166.90	2,209,199,966.65	- 811,024,602.40	13,681,919.12 40,931,605.53
	93,299,011.61	21,178,804.29		
Total bancarios	6,743,574.63	12,131,276,546.26	13,251,071,691.55	2,298,284,134.37
	1,887,363,166.90	2,209,199,966.65	- 17,564,915,109.10	13,681,919.12
	40,931,605.53	93,299,011.61	21,178,804.29	
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 [miembro]
Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años [miembro]
Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años [miembro]
Bursátiles y colocaciones privadas [sinopsis]				
Bursátiles listadas en bolsa (quiropgrafarios)				
Scotiabank / VARIOS	No28/06/201316/06/20237.3	1,150,000,000.00		
Scotiabank / VARIOS	No06/12/201927/03/202310.91	6,000,000,000.00		
Scotiabank / VARIOS	No22/12/202213/04/2023	2,068,693,341.00		
TOTAL	-	9,218,693,341.00	- - - - -	- - - - -



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 111 / 11

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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]  
 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 6,743,574.63 53,104,969,887.26 15,344,071,691.55 2,298,284,134.37  
 1,887,363,166.90 5,569,199,966.65 0.00 17,604,915,109.10 13,681,919.12 40,931,605.53  
 93,299,011.61 21,178,804.29

Comentarios:  
 El tipo de cambio tomado al cierre de diciembre fue de 19.5089

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 1 / 21

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

## 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:

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 en los siguientes rubros:

**Negociación:** La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

**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.

**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.

Manual de Operación de Derivados.

Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

Política de Riesgo de Contraparte

Política de Sobregiros

---

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados. Durante el cuarto trimestre de 2022, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a 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)

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

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

Subyacente\*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.

\*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.

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa 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 2022 y en promedio para el cuarto trimestre de 2022 es de:

Scotiabank Posición Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 60,08056,798

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 88,81685,281

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

Inventario de modelos de derivados

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

Clase de activo Derivado Tipo Breve descripción

Tasas de interés Opciones Europea Caps, Floors:

Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets.

$Cap = \sum_{i=1}^n Caplet_i$

Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet.

$Floor = \sum_{i=1}^n Floorlet_i$

Binaria La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos.

La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:

Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap).

Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).

IRSEl intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).

CCIRS Intercambio de intereses en moneda

nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.

Tipo de cambio Opciones Europea En este tipo de contratos se utiliza la fórmula

Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.

Americana El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)

Binaria Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción.

A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.

Barrera Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento  $S_T$ , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento  $S_{(t < T)}$ , son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria.

Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente  $S_T$  alcance un umbral preestablecido  $H$  llamado barrera de la opción.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 7 / 21

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

ForwardForward OTCCompra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

Instrumentos a Valor Razonable

Clase de activoDerivadoTipoBreve descripción

Índices, capitales y metalesOpciones

EuropeaOpción Europea Call / Put: Este tipo de contratos utiliza la fórmula de Black-Scholes.

Opción Europea Quanto: Una opción tipo Quanto es un derivado en el cual el subyacente se denomina en una moneda, pero el instrumento en sí se liquida en otra moneda a una tasa determinada. Tales productos son atractivos para los inversionistas que desean estar expuestos a un activo extranjero, pero sin el riesgo de tipo de cambio equivalente.

BinariaTipo de opción la cual al vencimiento solo tiene dos eventos pagar o no pagar un monto previamente definido.

Derivados listadosMexder FuturesIRLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre Contrato de Intercambio de Flujos de Tasas son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

FXLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre el tipo de cambio son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

Instrumentos valuados a costo

Clase de activoNombre de productoMetodologíaNotas

FI SecurityBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

EQ CashAccionesLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Fondos de inversiónETFsLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Notas Estructuradas listadasBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Políticas 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

Tesorería: Call Money

Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

Cambios: FOREX

Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

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 TIIE.

#### Efectividad De la Cobertura:

Se realizan pruebas y análisis, al inicio de cada operación de cobertura y de manera continua, con base en la comparación de los cambios pasados en el valor

---

---

razonable o en los flujos de efectivo del instrumento de cobertura con los cambios que hayan experimentado en el pasado el valor razonable o los flujos de efectivo de la posición primaria.

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

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

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

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios 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 cumple 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 2022 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 2022 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha de actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos 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 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 2022 y promedio del cuarto trimestre 2022 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank Posición Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 88,81685,281

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 NormalEscenario PosibleEscenario ProbableEscenario de Estrés  
(millones de pesos)

Gap 30d Gap Acum60,08056,64556,64556,645

Cambios en el Gap respecto al escenario normal(3,435)(3,435)(3,435)

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 notional 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 15 / 21

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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 continúa 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

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa.

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a diciembre 31, 2022:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(17,639.15)	(5,530.18)	(246,330.40)	130,512.45	38,481.49	(60,128.23)	(160,634.02)
CCS	24,720.66	(2,255.17)	(1,493.87)	344.74	258.56	(28.73)	21,546.19
Caps&Floors	158.01	(57.46)	158.01	57.45	--	316.01	
Binary Caps&Floors	-----						
TIIE Futures	-----						
Mbonds Futures	-----						
Total DERIVATIVES	7,239.52	(7,842.81)	(247,666.26)	130,914.64	38,740.05	(60,156.96)	(138,771.82)

## 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 las sensibilidades es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (173.82) Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (347.65) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (862.18) Millones de pesos.

Los escenarios de stress están basados en el movimiento que pudieran tener el

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 16 / 21

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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	(0.14)	91.9250.00	(6.94)	100.00 (13.88) 200.00
			(27.75)		
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	-(0.13)	0.10	0.40	1.00
a FX %Forwards		85.541,668.850.10	(166.88)	0.20	(333.77) 0.50 (834.43)
a FX %Opciones Divisa		--	0.10	0.20	0.50
Total			(173.82)	(347.65)	(862.18)

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 2022 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Delta	Vega	Gamma
Options AMD.OQ	---	---
Options BNPUI5.INDX	56,450.002	076.0012,747.00
Options DIS.N	---	---
Options ENHFO5.INDX	---	---
Options ENHGE5.INDX	---	---
Options EZU.P	---	---
Options FXI.P	---	---
Options GLD.P	---	---
Options ICLN.OQ	---	---
Options IDBTV1.INDX	---	---
Options MCHI.OQ	---	---
Options MSFDV1.INDX	---	---
Options MSFDVG.INDX	14,727.00238.003	444.00
Options NVDA.OQ	---	---
Options QQQ.OQ	---	---
Options SOXX.OQ	---	---
Options SPXSR5.INDX	---	---
TOTAL	71,177.002	314.0016,191.00

Análisis de Stress

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

Escenarios a la Baja	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options AMD.OQ	---	---	---
Options BNPUI5.INDX	(5,645.00)	(16,935.00)	(28,225.00)
Options DIS.N	---	---	---
Options ENHFO5.INDX	---	---	---
Options ENHGE5.INDX	---	---	---
Options EZU.P	---	---	---
Options FXI.P	---	---	---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2022**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 17 / 21

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Options GLD.P---  
Options ICLN.OQ---  
Options MEXIBX.INDX---  
Options MXSXAE.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM(1,472.70) (4,418.10) (7,363.50)  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
TOTAL(7,117.70) (21,353.10) (35,588.50)

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

Escenarios a la Alza

0.050.150.2  
Options AMD.OQ---  
Options BNPUI5.INDX2,822.508,467.5011,290.00  
Options DIS.N---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options EZU.P---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options ICLN.OQ---  
Options MEXIBX.INDX---  
Options MXSXAE.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM736.352,209.052,945.40  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
TOTAL3,558.8510,676.5514,235.40

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del EscenarioMonto  
Probable(7,117.70)  
Poco Probable(21,353.10)  
Muy poco Probable(35,588.50)

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 2022 se tienen los siguientes saldos:

Cifras expresadas en pesos

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado  
CLIENTE 1MXN16,500,000(30,200,000)  
CLIENTE 2MXN407,000,000(512,000,000)

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2022**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 18 / 21

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

CLIENTE	3MXN308,600,000	(50,500,000)
CLIENTE	4MXN43,400,000	(46,000,000)
CLIENTE	5MXN373,000,213	(1,252,945,689)
CLIENTE	6USD49,090,000	(45,260,000)
CLIENTE	7USD23,030,000	(7,640,000)
CLIENTE	8USD96,400,000	(316,000,000)
CLIENTE	9USD960,000-	
CLIENTE	10USD5,740,000	(4,690,000)
CLIENTE	11USD17,290,000	(13,400,000)
CLIENTE	12USD5,500,000	(2,740,000)
CLIENTE	13MXN240,700,000	(541,300,000)
CLIENTE	14MXN102,700,000	(219,600,000)
CLIENTE	15MXN221,700,000	(137,800,000)
CLIENTE	16MXN552,700,000	(5,848,700,000)
CLIENTE	17MXN48,878,224	(4,495,200,000)
CLIENTE	18MXN5,300,000	(1,100,000)
CLIENTE	19USD4,990,000	(9,500,000)
CLIENTE	20USD3,840,000	(1,070,000)
CLIENTE	21MXN6,600,000-	
CLIENTE	22USD4,140,000	(3,250,000)
TOTAL	2,538,058,437	(13,538,895,689)

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: **2022**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 19 / 21

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2022**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 20 / 21

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Liquidados anticipadamente

Revelación de cualquier incumplimiento que se haya presentado en los contratos

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2022

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 21 / 21

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

respectivos

Producto	Fecha de evento	Contraparte	
Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
Caps & Floors	oct-22	Cliente 1	USD1,406 Discrepancia Liquidación
Forwards FX	oct-22	Cliente 2	USD135,000 No fondeo su cuenta
Forwards FX	oct-22	Cliente 3	USD142,000 No fondeo su cuenta
Interest Rate Swap	oct-22	Cliente 4	MXN151,278 No envio los fondos
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 5	MXN(22,318) No se liquida
Forwards FX	oct-22	Cliente 6	MXN830,333 Problemas orden de pago
LLAMADA DE MARGEN	oct-22	Cliente 7	MXN1,800,000 No envio los fondos
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 8	MXN(15,237) No se liquida
Interest Rate Swap		Cliente 9	MXN(130,018) No se liquida
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 10	MXN(9,563) No se liquida
Forwards FX	nov-22	Cliente 11	USD40,000,000 No envio los fondos
Forwards FX	nov-22	Cliente 12	MXN20,198,411 No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 13	MXN1,623,351 No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 14	MXN548,712 No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 15	MXN540,556 No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 16	MXN137,667 No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 17	MXN131,250 No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 18	MXN64,904 No envio los fondos
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 19	MXN54,115 No envio los fondos
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 20	MXN50,063 No envio los fondos
Interest Rate Swap	nov-22	Cliente 21	MXN46,823 No envio los fondos
Interest Rate Swap		Cliente 22	MXN(408,398) No se liquida
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 23	MXN2,172,412 No envio los fondos
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 24	MXN100,268 No envio los fondos
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 25	MXN2,250,550 No envio los fondos
FX Options (Vanilla)	nov-22	Cliente 26	MXN195,700 No envio los fondos
Forwards FX	nov-22	Cliente 27	MXN20,272,000 No fondeo su cuenta
Equity Options		Cliente 28	MXN31,000 No envio los fondos
Interest Rate Swap		Cliente 29	MXN(319,098) No se liquida
Interest Rate Swap	dic-22	Cliente 30	MXN(12,627) No se liquida
Interest Rate Swap		Cliente 31	MXN(592,016) No se liquida
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 32	MXN2,172,412 No fondeo su cuenta
Cross Currency Swaps	dic-22	Cliente 33	MXN72,775 No fondeo su cuenta
Equity Options	dic-22	Cliente 34	MXN5,737,346 No envio los fondos
Caps & Floors	dic-22	Cliente 35	MXN7,150 No envio los fondos
Forwards FX	dic-22	Cliente 36	MXN251,097 No envio los fondos
Forwards FX	dic-22	Cliente 37	MXN93,408 No envio los fondos
Forwards FX	dic-22	Cliente 38	MXN17,665 No envio los fondos
Caps & Floors	dic-22	Cliente 39	USD12,008 No envio los fondos

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte  
Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos