



**ANEXO**  
**Scotiabank Inverlat**

# INFORMACIÓN FINANCIERA

SCOTIABANK INVERLAT

## INDICADORES FINANCIEROS

Scotiabank-Indicadores Financieros	T4 2023	T1 2023	T2 2024	T3 2024	T4 2024
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	14.2%	13.1%	11.5%	13.9%	13.7%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	1.4%	1.3%	1.1%	1.3%	1.3%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.1%	3.0%	2.9%	3.0%	2.8%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.2%	2.0%	2.1%	2.0%	2.0%
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)	3.3%	3.4%	3.6%	3.9%	4.0%
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.)	77.4%	76.9%	76.8%	72.4%	71.1%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	21.47%	22.01%	22.44%	22.61%	24.23%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	15.99%	16.64%	17.08%	17.76%	18.59%
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	47.2%	44.4%	46.9%	46.8%	49.3%

La utilidad neta al cierre del cuarto trimestre alcanza \$3,017 millones, un incremento de \$189 millones o 7% respecto al mismo periodo del año anterior, debido a mayores ingresos en intermediación, menores quebrantos en otros ingresos/egresos de la operación y un mayor margen financiero; compensados parcialmente por mayores requerimientos de reservas crediticias.

Respecto al trimestre anterior, la utilidad neta mostró un incremento de \$70 millones o 2% por mayores ingresos en: intermediación, margen financiero y en otros ingresos/egresos de la operación por seguros, bienes adjudicados y venta de cartera de crédito; compensados parcialmente por mayores requerimientos de reservas crediticias.

La utilidad neta acumulada al cierre de diciembre de 2024 se ubicó en \$10,934 millones, una disminución de \$345 millones o 3% respecto al mismo periodo del año anterior, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias; compensados parcialmente por que los ingresos mostraron un crecimiento anual de 7% impulsado por el margen financiero e intermediación, así como comisiones y tarifas netas provenientes principalmente de operaciones de créditos y avalúos; así como menores impuestos. Adicionalmente, la eficiente gestión del gasto logró un índice de productividad de 47%, una mejora de 331 pb respecto al 2023.

Scotiabank-Información Financiera (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				12 meses		
	31-dic	30-sep	31-dic	A/A	31-dic	31-dic	A/A
	2023	2024	2024	Δ%	2023	2024	Δ%
Ingresos por intereses	21,215	21,130	20,715	-2%	79,209	83,728	6%
Gastos por intereses	(14,035)	(13,980)	(13,433)	-4%	(52,136)	(55,557)	7%
<b>Margen Financiero</b>	<b>7,180</b>	<b>7,150</b>	<b>7,282</b>	<b>1%</b>	<b>27,073</b>	<b>28,171</b>	<b>4%</b>
Comisiones	1,210	1,405	1,349	11%	4,477	5,169	15%
Resultado por Intermediación	312	541	720	> +100%	1,865	2,484	33%
Otros ingresos/egresos de la operación	115	225	399	> +100%	878	923	5%
<b>Ingresos no Financieros</b>	<b>1,637</b>	<b>2,171</b>	<b>2,468</b>	<b>51%</b>	<b>7,220</b>	<b>8,576</b>	<b>19%</b>
<b>Total Ingresos</b>	<b>8,817</b>	<b>9,321</b>	<b>9,750</b>	<b>11%</b>	<b>34,293</b>	<b>36,747</b>	<b>7%</b>
Gastos de Administración y Promoción	(4,510)	(4,348)	(4,475)	-1%	(17,320)	(17,343)	0%
<b>PTPP <sup>1)</sup></b>	<b>4,307</b>	<b>4,973</b>	<b>5,275</b>	<b>22%</b>	<b>16,973</b>	<b>19,404</b>	<b>14%</b>
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(1,191)	(1,203)	(1,598)	34%	(2,197)	(5,151)	> +100%
<b>Resultado de la Operación</b>	<b>3,116</b>	<b>3,770</b>	<b>3,677</b>	<b>18%</b>	<b>14,776</b>	<b>14,253</b>	<b>-4%</b>
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	394	37	23	-94%	562	191	-66%
<b>Resultado antes de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>3,510</b>	<b>3,807</b>	<b>3,700</b>	<b>5%</b>	<b>15,338</b>	<b>14,444</b>	<b>-6%</b>
Impuestos a la Utilidad	(682)	(860)	(683)	0%	(4,059)	(3,510)	-14%
<b>Resultado Neto</b>	<b>2,828</b>	<b>2,947</b>	<b>3,017</b>	<b>7%</b>	<b>11,279</b>	<b>10,934</b>	<b>-3%</b>
Otros Resultados Integrales							
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	662	523	(253)	> -100%	255	(384)	> -100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	(774)	(731)	361	> -100%	(150)	410	> -100%
Remediación de beneficios definidos a los empleados	(154)	(1)	4	> -100%	(129)	389	> -100%
Participación en ORI de otras entidades	1	-	9	> +100%	1	11	> +100%
<b>Resultado Integral</b>	<b>2,563</b>	<b>2,738</b>	<b>3,138</b>	<b>22%</b>	<b>11,256</b>	<b>11,360</b>	<b>1%</b>

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

## MARGEN FINANCIERO

El margen financiero fue de \$7,282 millones al cierre del cuarto trimestre de 2024, un incremento de \$102 millones o 1% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente por mayores ingresos en la cartera hipotecaria, automotriz y sin garantía.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de \$132 millones o 2%; principalmente por mayores volúmenes en la cartera hipotecaria y automotriz; así como una mejora en la mezcla de depósitos.

El margen financiero acumulado al cierre de diciembre 2024 ascendió a \$28,171 millones, un incremento de \$1,098 millones o 4% respecto al 2023, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera hipotecaria, sin garantía y automotriz; compensados parcialmente por mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata.

## INGRESOS NO FINANCIEROS

El total de ingresos no financieros fue de \$2,468 millones en el cuarto trimestre de 2024, un incremento de \$831 millones o 51% respecto al mismo periodo del año anterior, debido a mayores ingresos por intermediación y por otros ingresos / egresos de la operación (principalmente menores quebrantos, mayores ingresos en bienes adjudicados y en venta de cartera de crédito), así como por comisiones y tarifas netas. Los mayores ingresos por intermediación se debieron a una utilidad en instrumentos financieros derivados y mercado cambiario; compensada parcialmente por una pérdida en inversiones en instrumentos financieros.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron un incremento de \$297 millones o 14%, debido a mayores ingresos por intermediación y resultados en otros ingresos / egresos de la operación (principalmente seguros y adjudicación de bienes). Los mayores ingresos por intermediación se debieron a una utilidad en instrumentos financieros derivados y mercado cambiario; compensada parcialmente por una pérdida en inversiones en instrumentos financieros.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de diciembre 2024 ascendió a \$8,576 millones, un incremento de \$1,356 millones o 19% respecto al año anterior, debido principalmente a mayores ingresos en comisiones y tarifas netas por operaciones de crédito, avalúos y manejo de cuenta; así como mayores ingresos por intermediación en el mercado cambiario.

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				12 meses		
	31-dic	30-sep	31-dic	A/A	31-dic	31-dic	A/A
	2023	2024	2024	Δ%	2024	2024	Δ%
Aceptaciones por Cuenta de Terceros	1	1	-	-100%	3	2	-33%
Actividades Fiduciarias	46	44	59	28%	212	217	2%
Apertura de Cuenta	5	5	5	0%	22	19	-14%
Cartas de Crédito	81	78	98	21%	251	324	29%
Cheques Certificados	1	1	-	-100%	3	2	-33%
Cheques de caja	-	-	1	0%	1	1	0%
Compraventa de instrumentos financieros	-	2	3	0%	2	7	> +100%
Manejo de Cuenta	91	111	104	14%	339	427	26%
Operaciones de Crédito	482	509	513	6%	1,663	1,929	16%
Otras Comisiones y Tarifas	430	469	382	-11%	1,689	1,521	-10%
Servicios de Banca Electrónica	47	158	157	> +100%	188	618	> +100%
Transferencia de Fondos	26	27	27	4%	104	102	-2%
<b>Total de Comisiones y Tarifas (netas)</b>	<b>1,210</b>	<b>1,405</b>	<b>1,349</b>	<b>11%</b>	<b>4,477</b>	<b>5,169</b>	<b>15%</b>

Scotiabank- Otros Ingresos/Egresos de la operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				12 meses		
	31-dic	30-sep	31-dic	A/A	31-dic	31-dic	A/A
	2023	2024	2024	Δ%	2023	2024	Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	(15)	(6)	-	-100%	6	3	-50%
Aportaciones al IPAB	(577)	(591)	(597)	3%	(2,203)	(2,373)	8%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	5	14	13	> +100%	57	39	-32%
Donativos	(17)	(3)	(2)	-88%	(17)	(6)	-65%
Bienes adjudicados	9	43	93	> +100%	63	244	> +100%
Ingresos por Arrendamiento	9	12	12	33%	42	49	17%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados	56	62	63	13%	206	240	17%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	787	725	812	3%	3,050	3,012	-1%
Quebrantos	(149)	(45)	(33)	-78%	(360)	(342)	-5%
Recuperaciones	3	-	-	-100%	17	3	-82%
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo	(1)	1	(1)	0%	12	-	-100%
Utilidad/Pérdida por venta de cartera de crédito	5	13	39	> +100%	5	54	> +100%
<b>Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación</b>	<b>115</b>	<b>225</b>	<b>399</b>	<b>&gt; +100%</b>	<b>878</b>	<b>923</b>	<b>5%</b>

## ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS

En el cuarto trimestre de 2024, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios ascendió a \$1,598 millones, un incremento de \$407 millones o 34% respecto al mismo periodo del año anterior. El incremento se debe principalmente a mayores requerimientos en la cartera de vivienda, automotriz, tarjeta de crédito y consumo; compensados parcialmente por menores requerimientos en la cartera comercial.

Respecto al trimestre anterior, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra un incremento de \$395 millones o 33%, debido principalmente a mayores volúmenes en la cartera menudeo y a menores liberaciones de reservas adicionales; compensados parcialmente por menores requerimientos de cartera comercial.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de diciembre 2024 ascendió a \$5,151 millones, un incremento anual de \$2,954 millones respecto al año anterior. Este incremento fue impulsado por mayores requerimientos en cartera de consumo.

Scotiabank – Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				12 meses		
	31-dic 2023	30-sep 2024	31-dic 2024	A/A Δ%	31-dic 2023	31-dic 2024	A/A Δ%
	<b>Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios</b>	<b>(1,191)</b>	<b>(1,203)</b>	<b>(1,598)</b>	<b>34%</b>	<b>(2,197)</b>	<b>(5,151)</b>

## GASTOS DE ADMINISTRACIÓN Y PROMOCIÓN

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,475 millones en el cuarto trimestre de 2024, una disminución de \$35 millones respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a la amortización de sistemas en el cuarto trimestre de 2023; compensada parcialmente por IVA, depreciación y gastos de tecnología.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, incrementaron \$127 millones o 3%, debido a mayores gastos de operación principalmente por honorarios, IVA y depreciaciones; compensados parcialmente por menores gastos de PTU.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de diciembre 2024 ascendieron a \$17,343 millones, un incremento anual de \$23 millones, debido principalmente a mayores gastos por IVA, promoción y publicidad, así como en tecnología; compensados por la amortización de sistemas en 2023 y menores honorarios.

Scotiabank – Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				12 meses		
	31-dic 2023	30-sep 2024	31-dic 2024	A/A Δ%	31-dic 2023	31-dic 2024	A/A Δ%
	Gastos de Personal	(1,783)	(2,094)	(1,779)	0%	(7,950)	(7,738)
Gastos de Operación	(2,727)	(2,254)	(2,696)	-1%	(9,370)	(9,605)	3%
<b>Total de Gastos de Administración y Promoción</b>	<b>(4,510)</b>	<b>(4,348)</b>	<b>(4,475)</b>	<b>-1%</b>	<b>(17,320)</b>	<b>(17,343)</b>	<b>0%</b>

## IMPUESTOS A LA UTILIDAD

En el cuarto trimestre de 2024, se registró un impuesto neto a cargo de \$683 millones, un incremento de \$1 millón respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una mayor utilidad en el periodo.

Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto disminuyó \$177 millones o 21%, principalmente por el efecto fiscal cambiario en las operaciones financieras derivadas.

Los impuestos netos acumulados al cierre de diciembre 2024 ascendieron a \$3,510 millones, una disminución anual de \$549 millones o 14%, principalmente por el efecto fiscal cambiario en las operaciones financieras derivadas.

Scotiabank – Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				12 meses		
	31-dic 2023	30-sep 2024	31-dic 2024	A/A Δ%	31-dic 2023	31-dic 2024	A/A Δ%
	Impuesto a la Utilidad Causado	(657)	(1,453)	(370)	-44%	(3,701)	(4,187)
Impuesto a la Utilidad Diferido	(25)	593	(313)	> +100%	(358)	677	> -100%
<b>Total de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>(682)</b>	<b>(860)</b>	<b>(683)</b>	<b>0%</b>	<b>(4,059)</b>	<b>(3,510)</b>	<b>-14%</b>

## BALANCE GENERAL

Al 31 de diciembre de 2024, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$918,666 millones, un incremento de \$82,346 millones o 10% respecto al cierre de diciembre de 2023. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en deudores por liquidación de operaciones (en otros activos), instrumentos financieros derivados de negociación, deudores por reporto, y cartera de crédito total; así como en inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental).

Los activos totales incrementaron \$40,786 millones o 5% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental y bancarios), deudores por liquidación de operaciones (en otros activos), deudores por reporto; así como mayores volúmenes en efectivo y equivalentes de efectivo (principalmente depósitos en otras entidades financieras).

El total del pasivo registró \$828,620 millones al 31 de diciembre de 2024, un incremento de \$70,986 millones o 9% respecto al cierre de diciembre de 2023. Este incremento se debe a mayores volúmenes en instrumentos financieros derivados, valores asignados por liquidar, y acreedores por liquidación de operaciones (en otros pasivos); así como el crecimiento de los depósitos.

El pasivo total incrementó \$37,145 millones o 5% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en otros pasivos (valores asignados por liquidar, acreedores por reporto, instrumentos financieros derivados y acreedores por liquidación de operaciones), préstamos bancarios y de otros organismos; así como el crecimiento de los depósitos.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 dic 2023	30 sep 2024	31 dic 2024	A/A Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	284,193	299,778	334,209	18%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	496,519	507,211	502,594	1%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	17,061	20,398	20,726	21%
Partidas diferidas	3,093	3,694	3,866	25%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(13,209)	(14,762)	(14,733)	12%
Otros Activos	48,663	61,561	72,004	48%
<b>Total Activo</b>	<b>836,320</b>	<b>877,880</b>	<b>918,666</b>	<b>10%</b>
Depósitos	541,557	554,321	558,588	3%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	36,804	40,269	45,168	23%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,060	9,104	8,908	-2%
Otros Pasivos	170,213	187,781	215,956	27%
<b>Total Pasivo</b>	<b>757,634</b>	<b>791,475</b>	<b>828,620</b>	<b>9%</b>
<b>Capital</b>	<b>78,686</b>	<b>86,405</b>	<b>90,046</b>	<b>14%</b>
<b>Total Pasivo y Capital</b>	<b>836,320</b>	<b>877,880</b>	<b>918,666</b>	<b>10%</b>

## CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 1 Y 2

La cartera de préstamos de menudeo al 31 de diciembre de 2024 alcanzó \$280,135 millones, un incremento anual de \$29,380 millones o 12% y de \$5,557 millones o 2% respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado principalmente por mayores créditos a la vivienda y automotriz.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de diciembre de 2024 se ubicó en \$222,459 millones, una disminución anual de \$23,305 millones o 9% debido principalmente a menores créditos de actividad empresarial o comercial. Respecto al trimestre pasado, la disminución fue de \$10,174 millones o 4% debido principalmente a menores créditos gubernamentales.

<b>Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	31 dic 2023	30 sep 2024	31 dic 2024	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	37,274	44,575	47,750	28%
Créditos a la Vivienda	213,481	230,003	232,385	9%
<b>Total Préstamos de Menudeo</b>	<b>250,755</b>	<b>274,578</b>	<b>280,135</b>	<b>12%</b>
Actividad Empresarial o Comercial	200,774	185,090	180,344	-10%
Entidades Financieras	23,989	24,157	27,074	13%
Entidades Gubernamentales	21,001	23,386	15,041	-28%
<b>Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales</b>	<b>245,764</b>	<b>232,633</b>	<b>222,459</b>	<b>-9%</b>
<b>Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2</b>	<b>496,519</b>	<b>507,211</b>	<b>502,594</b>	<b>1%</b>

## CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 3

Al 31 de diciembre de 2024 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$20,726 millones, un incremento anual y trimestral de \$3,665 millones o 21% y de \$328 millones o 2% respectivamente.

Por otro lado, la estimación preventiva para riesgos crediticios al 31 de diciembre de 2024 se ubicó en \$14,733 millones, un incremento anual de \$1,524 millones o 12% y un incremento trimestral de \$29 millones.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 71.1% al 31 de diciembre de 2024, una disminución respecto al año pasado y al trimestre anterior de 634pb y 129pb, respectivamente.

El índice de morosidad al 31 de diciembre de 2024 fue de 4.0%, un incremento de 64pb respecto del año anterior y de 9pb respecto al trimestre pasado.

<b>Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	31 dic 2023	30 sep 2024	31 dic 2024	A/A Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	17,061	20,398	20,726	21%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(13,209)	(14,762)	(14,733)	12%
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta</b>	<b>3,852</b>	<b>5,636</b>	<b>5,993</b>	<b>56%</b>
<b>Índice de morosidad</b>	<b>3.3%</b>	<b>3.9%</b>	<b>4.0%</b>	<b>64 pb</b>



## DEPÓSITOS

El total de depósitos registró \$558,588 millones al 31 de diciembre de 2024, un incremento anual de \$17,031 millones o 3%, debido a mayores volúmenes en títulos de crédito emitidos y depósitos de vista y ahorro; compensados parcialmente por un menor volumen en depósitos a plazo.

Respecto al trimestre inmediato anterior los depósitos disminuyeron \$4,267 millones o 1%, debido principalmente a mayores depósitos de vista y ahorro.

<b>Scotiabank – Depósitos</b> <b>(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	31 dic 2023	30 sep 2024	31 dic 2024	A/A Δ%
<b>Total Depósitos Vista y Ahorro</b>	<b>276,129</b>	<b>290,768</b>	<b>295,084</b>	<b>7%</b>
Público en General	208,686	207,471	193,752	-7%
Mercado de Dinero	44,504	25,263	37,925	-15%
<b>Total Depósitos a Plazo</b>	<b>253,190</b>	<b>232,734</b>	<b>231,677</b>	<b>-8%</b>
Títulos de Crédito Emitidos	10,941	29,350	30,304	> +100%
Cuenta global de captación sin movimientos	1,297	1,469	1,523	17%
<b>Total de Depósitos</b>	<b>541,557</b>	<b>554,321</b>	<b>558,588</b>	<b>3%</b>

## OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN

Al 31 de diciembre de 2024, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$8,908 millones, una disminución anual de \$152 millones y trimestral de \$196 millones debido al prepago de obligaciones e intereses devengados por pagar y sustitución por obligaciones subordinadas híbridas con fecha de emisión el 14 de noviembre de 2024 y devengamiento de intereses a 182 días.

### Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024 valor razonable)

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
<b>Instrumentos financieros negociables</b>	<b>82,400</b>	<b>1,644</b>	<b>22</b>	<b>55</b>	<b>84,121</b>
Sin restricción:	-	-	22	55	77
Restringidos:	82,400	1,644	-	-	84,044
En operaciones de reporto	61,584	1,627	-	-	63,211
Préstamos de valores	2,065	-	-	-	2,065
Otros	18,751	17	-	-	18,768
<b>Instrumentos financieros para cobrar o vender</b>	<b>76,279</b>	<b>25,745</b>	<b>-</b>	<b>1,442</b>	<b>103,466</b>
Sin restricción:	74,452	25,745	-	1,442	101,639
Restringidos:	1,827	-	-	-	1,827
En operaciones de reporto	23	-	-	-	23
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	1,804	-	-	-	1,804
<b>Instrumentos financieros para cobrar principal e interés</b>	<b>5,110</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5,110</b>
Sin restricción	5,110	-	-	-	5,110
<b>Total</b>	<b>163,789</b>	<b>27,389</b>	<b>22</b>	<b>1,497</b>	<b>192,697</b>



**Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)**

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I_BANSAN_24534	14,908,236,351	9.95%	2	14,900
I_BMORGAN_25015	5,000,000,000	10.12%	28	4,986

**Scotiabank-Instrumentos financieros derivados  
(millones de pesos al 31 de diciembre de 2024 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	10,012	10,352	-	-	1,452	1,011	305	700	36,897	36,850	-	-	48,666	48,913
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	15,552	15,814	-	-	15,552	15,814

**Scotiabank-Montos nomenclales en operaciones derivadas  
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de diciembre de 2024)**

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

**Con fines de negociación**

Posición USD	6,313	7,121	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	144	143	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CHF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	62	62	512	512	-	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	48	48	-	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Acciones USD	-	-	-	-	67	67	134	-	-	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	158	1,896	3,577	1,838	-	-	-	-	-
Tasa de interés													
Pesos	-	-	-	-	-	-	32,639	32,088	719,361	782,489	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	725	725	10,298	10,573	-	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	18	-	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-	-

**Con fines de cobertura**

Tasa de interés													
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	132,122	-	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	590	1,150	-	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	122,288	55,680	-	177,968
Créditos a entidades financieras	26,390	684	-	27,074
Créditos a entidades gubernamentales	7,433	7,608	-	15,041
Créditos al consumo	46,548	-	-	46,548
Créditos a la vivienda	228,383	1	30	228,414
<b>Total</b>	<b>431,042</b>	<b>63,973</b>	<b>30</b>	<b>495,045</b>

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	1,881	495	-	2,376
Créditos al consumo	1,202	-	-	1,202
Créditos a la vivienda	3,969	-	2	3,971
<b>Total</b>	<b>7,052</b>	<b>495</b>	<b>2</b>	<b>7,549</b>

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 30 de diciembre de 2024)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	5,255	1,599	-	6,854
Créditos a entidades financieras	96	-	-	96
Créditos al consumo	1,183	-	-	1,183
Créditos a la vivienda	12,552	35	6	12,593
<b>Total</b>	<b>19,086</b>	<b>1,634</b>	<b>6</b>	<b>20,726</b>

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

<b>Saldo al 30 de septiembre de 2024</b>	<b>20,398</b>
Reestructuras	198
Recuperaciones	(492)
Castigos y quitas	(1,713)
Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1, 2 y 3	2,233
Fluctuación Tipo Cambio	102
<b>Saldo al 31 de diciembre de 2024</b>	<b>20,726</b>

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

<b>Saldo al 30 de septiembre de 2024</b>	<b>14,762</b>
Más: Creación de reservas	30
Calificación	1,632
Menos: Adjudicaciones y otros	180
Castigos y quitas	957
Comercial	54
Hipotecario	119
Consumo	784
Eliminaciones	680
Desliz cambiario	(126)
<b>Saldo al 31 de diciembre de 2024</b>	<b>14,733</b>

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

	31 dic 2023	30 sep 2024	31 dic 2024
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2			
Metropolitano	69.3%	71.5%	71.9%
Noroeste – Centro	8.7%	8.3%	8.0%
Norte	11.2%	10.4%	10.4%
Bajío	6.3%	5.6%	5.6%
Sur	4.5%	4.2%	4.1%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3			
Metropolitano	57.2%	58.0%	63.2%
Noroeste – Centro	13.1%	12.7%	12.0%
Norte	5.9%	8.4%	4.2%
Bajío	13.5%	12.2%	12.7%
Sur	10.3%	8.7%	7.9%

### Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)

Grado de Riesgo	Importe Cartera Crediticia	Reservas Preventivas Necesarias				Total Reservas Preventivas
		Cartera Comercial	Consumo		Cartera de Vivienda	
			No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes		
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	449,867	900	148	504	352	1,904
Riesgo A2	56,693	477	58	233	33	801
Riesgo B1	11,512	114	59	79	22	274
Riesgo B2	7,169	14	92	38	49	193
Riesgo B3	3,521	3	40	41	40	124
Riesgo C1	4,105	16	87	85	62	250
Riesgo C2	4,836	1	67	132	313	513
Riesgo D	10,935	848	98	417	1,755	3,118
Riesgo E	11,089	3,532	817	349	2,790	7,488
<b>Total</b>	<b>559,727</b>	<b>5,905</b>	<b>1,466</b>	<b>1,878</b>	<b>5,416</b>	<b>14,665</b>
<b>Exceso</b>						<b>68</b>
<b>Reservas Constituidas</b>						<b>14,733</b>

#### NOTAS:

- Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas son las correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 31 de diciembre de 2024.
- 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 con riesgo de crédito etapa 3	-
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	58
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3	3
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	7
<b>Total</b>	<b>68</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 2024 mantiene el Banco en el rubro de "Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses" son:

### Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)

	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	2,011	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
<b>Total</b>	<b>11,209,692</b>	<b>2,011</b>	

### Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)

	ISR	PTU
Futuros castigos de crédito	5,379	1,216
Pagos anticipados	(515)	(116)
Comisiones cobradas por anticipado	(450)	(102)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	822	174
Plan de pensiones	1,138	257
Provisiones y otros	713	122
Otros	(443)	7
<b>Efecto Neto en Diferido</b>	<b>6,644</b>	<b>1,558</b>

Al 31 de diciembre de 2024, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

<b>Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos</b> (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)						
Vencimiento	Préstamos			Financiamiento		Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	1,762	3,698	-	5,460
Largo	-	-	15,881	3,829	-	19,710
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>17,643</b>	<b>7,527</b>	<b>-</b>	<b>25,170</b>
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	11.62%	10.18%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	11,347	-	18	413	-	11,778
Largo	2,108	-	5,105	1,007	-	8,220
<b>Total</b>	<b>13,455</b>	<b>-</b>	<b>5,123</b>	<b>1,420</b>	<b>-</b>	<b>19,998</b>
Tasa Promedio	5.01%	0.00%	5.66%	5.04%	0.00%	
<b>Total Préstamos Interbancarios</b>	<b>13,455</b>	<b>-</b>	<b>22,766</b>	<b>8,947</b>	<b>-</b>	<b>45,168</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 2024.

<b>Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional</b>	31 dic 2023	30 sep 2024	31 dic 2024
<b>Depósitos a la Vista</b>	<b>52.3%</b>	<b>55.7%</b>	<b>56.1%</b>
Metropolitano	27.4%	31.1%	31.6%
Noroeste – Centro	7.2%	7.3%	6.8%
Norte	7.0%	7.0%	6.9%
Bajío	5.0%	5.2%	5.4%
Sur	5.7%	5.1%	5.4%
<b>Depósitos Ventanilla</b>	<b>39.3%</b>	<b>39.5%</b>	<b>36.7%</b>
Metropolitano	18.0%	13.7%	16.5%
Noroeste – Centro	4.1%	4.8%	4.5%
Norte	7.5%	7.8%	6.9%
Bajío	6.0%	7.3%	5.3%
Sur	3.7%	5.9%	3.5%
<b>Total de Captación del Público</b>	<b>91.6%</b>	<b>95.2%</b>	<b>92.8%</b>
<b>Fondeo Profesional</b>	<b>8.4%</b>	<b>4.8%</b>	<b>7.2%</b>

<b>Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional</b> Tasa Promedio (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)	Pesos	Dólares
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	6.26%	2.80%
Depósitos a plazo	10.08%	0.00%

## Scotiabank-Resultados por Intermediación (millones de pesos)

	31 dic 2024
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(4,479)
Resultado por valuación de divisas	4,876
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	413
Resultado por compraventa de divisas	1,780
Costos de transacción	(101)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(5)
<b>Total</b>	<b>2,484</b>

## EMISIÓN DE CERTIFICADOS BURSÁTILES

Al cierre de diciembre de 2024, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

	Cuarta*	**Primera	**Segunda	**Tercera	**Cuarta	**Quinta
Clave de Pizarra	SCOTIAB 23	SCOTIAB 24	SCOTIAB 24-2	SCOTIAB 24V	SCOTIAB 24D	SCOTIAB 24-3
Monto de la Emisión	\$7,125 millones	\$5,189 millones	\$4,811 millones	\$4,325 millones	"\$24 millones usd / \$472 millones MXN	\$3,970 millones
Fecha de Emisión y Colocación	18 agosto 2023	26 febrero 2024	26 febrero 2024	13 sep 2024	13 sep 2024	13 sep 2024
Plazo de Vigencia de la Emisión	927 días, aprox. 2.5 años	1,095 días, aprox. 3 años	2,548 días, aprox. 7 años	1,095 días, aprox. 3 años	1,092 días, aprox. 3 años	2,548 días, aprox. 7 años
Garantía	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria
Tasa de interés	TIIIE28+0.04	Fondeo+0.32%	9.74%	Fondeo+0.32%	3.46+0.84%	9.89%
Pago de Intereses	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento

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

\*\* Programa autorizado por la CNBV en febrero de 2024.

## EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)

Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo	Importe (\$)	Tasa (%)
14-nov-24	Perpetua	MXOQSC10040	-	8,908,000,000	14.02
<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 MXN
99_SCOTIAB_1-22	533,200	28-feb-22	25-feb-25	1093	MSFDVTHY Index	53,320,000
99_SCOTIAB_5-22	1,238,860	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	123,886,000
99_SCOTIAB_6-22	1,795,500	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	179,550,000
99_SCOTIAB_7-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_8-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_11-22	5,528,250	17-nov-22	14-nov-25	1093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	552,825,000
99_SCOTIAB_12-22	437,550	18-nov-22	14-nov-25	1092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	43,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	753,800	19-dic-22	17-dic-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	75,380,000
99_SCOTIAB_2-23	5,288,850	27-jul-23	27-ene-25	550	Dólar - Peso (USDMXN)	528,885,000
99_SCOTIAB_3-23	348,600	31-ago-23	28-feb-25	547	Dólar - Peso (USDMXN)	34,860,000
99_SCOTIAB_5-23	2,466,850	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	246,685,000
99_SCOTIAB_6-23	1,576,600	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P / BMV IPC (MEXBOL)	157,660,000
99_SCOTIAB_7-23	481,400	15-dic-23	14-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	48,140,000
83_SCOTIAB_5-24	1,418,300	09-dic-24	08-abr-25	120	Dólar - Peso (USDMXN)	141,830,000
99_SCOTIAB_6-24	1,234,750	11-dic-24	10-dic-26	729	S&P 500 Futures ER Index (SPXFP)	123,475,000
99_SCOTIAB_7-24	986,900	11-dic-24	10-dic-27	1094	S&P 500 Futures ER Index (SPXFP)	98,690,000
<b>Total Bonos Bancarios al 31 de diciembre de 2024</b>						<b>2,601,460,000</b>

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto USD
99_SCOTIAB_2-24D	25,000	19-jul-24	14-jul-27	1090	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ US Equity)	2,500,000
99_SCOTIAB_3-24D	613,200	08-nov-24	05-nov-27	1092	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ US Equity)	61,320,000
99_SCOTIAB_4-24D	34,000	03-dic-24	27-nov-26	724	VanEck Semiconductor ETF (SMH US Equity)	3,400,000
<b>Total Bonos Bancarios al 31 de diciembre de 2024</b>						<b>67,220,000</b>



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

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

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

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

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

- 1). Créditos con “pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento”,
- 2). Créditos con “pagos periódicos de principal e intereses” y,
- 3). Créditos que desde su inicio se estipule su carácter de revolventes.

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

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

En el caso que las reestructuras o renovaciones incluyan quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, el Banco podrá diferir la constitución de estimaciones preventivas para riesgos crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una estimación por la diferencia en un período que no exceda de 12 meses.

## Aplicación del programa OTIS

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

### a) CrediAuto

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

### b) Hipotecario

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

### c) Préstamo personal y préstamo de nómina

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

### d) ScotiaLine

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

### e) Tarjetas de crédito

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

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

A continuación, se presentan los importes que se hubieran registrado y presentado en el estado de situación financiera consolidado y en el estado consolidado de resultado integral por tipo de cartera, de no haberse aplicado el criterio contable especial, así como, el detalle de los conceptos y montos por tipo de cartera, por los cuales se haya realizado la afectación contable con motivo de la aplicación del criterio contable especial al 31 de diciembre de 2024.

	31 dic 2024		
	Saldo con CCE OTIS	Efectos en Cartera y Estimación	Saldo sin CCE OTIS
Cartera comercial	\$ 220,083	-	220,083
Créditos de consumo	46,548	(2)	46,546
Créditos a la vivienda:	228,414	46	228,460
<b>Etapa 1</b>	<b>\$ 495,045</b>	<b>44</b>	<b>495,089</b>
Cartera comercial	2,376	-	2,376
Créditos de consumo	1,202	1	1,203
Créditos a la vivienda:	3,971	(1)	3,970
<b>Etapa 2</b>	<b>\$ 7,549</b>	<b>-</b>	<b>7,549</b>
Cartera comercial	6,950	-	6,950
Créditos de consumo	1,183	1	1,184
Créditos a la vivienda:	12,593	(45)	12,548
<b>Etapa 3</b>	<b>\$ 20,726</b>	<b>(44)</b>	<b>20,682</b>
<b>Cartera de crédito</b>	<b>\$ 523,320</b>	<b>-</b>	<b>523,320</b>
(+/-) Partidas diferidas	\$ 3,866	-	3,866
(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios	\$ (14,733)	(9)	(14,742)
<b>Total cartera de crédito, neta</b>	<b>\$ 512,453</b>	<b>(9)</b>	<b>512,444</b>
<b>Total activos</b>	<b>\$ 918,666</b>	<b>(9)</b>	<b>918,657</b>
Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados)	\$ (5,151)	(9)	(5,160)
<b>Resultado neto</b>	<b>\$ 10,934</b>	<b>(9)</b>	<b>10,925</b>
<b>Total capital contable</b>	<b>\$ 90,046</b>	<b>(9)</b>	<b>90,037</b>
<b>Total pasivo y capital contable</b>	<b>\$ 918,666</b>	<b>(9)</b>	<b>918,657</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 2024)

Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	13,468
2	Resultados de ejercicios anteriores	54,989
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	21,579
4	Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1 (solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones)	No aplica
5	Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital común de nivel 1)	No aplica
6	<b>Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>	<b>90,036</b>
<b>Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios</b>		
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	2,040
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)	718
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	8,446
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	7,614
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	832
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones	-
28	<b>Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1</b>	<b>11,204</b>
29	<b>Capital común de nivel 1 (CET1)</b>	<b>78,832</b>
<b>Capital adicional de nivel 1: instrumentos</b>		
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	8,908
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	8,908
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	<b>Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>	<b>8,908</b>
<b>Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios</b>		
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde las Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
40 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
41	Ajustes regulatorios nacionales	-
42	Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones	No aplica
43	<b>Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1</b>	<b>-</b>
44	<b>Capital adicional de nivel 1 (AT1)</b>	<b>8,908</b>
45	<b>Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)</b>	<b>87,740</b>
<b>Capital de nivel 2: instrumentos y reservas</b>		

46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	-
47	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2	-
48	Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2)	No aplica
49	de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
50	Reservas	7
51	<b>Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios</b>	<b>7</b>
<b>Capital de nivel 2: ajustes regulatorios</b>		
52	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54	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	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	<b>Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2</b>	<b>-</b>
58	<b>Capital de nivel 2 (T2)</b>	<b>7</b>
59	<b>Capital total (TC = T1 + T2)</b>	<b>87,747</b>
60	<b>Activos ponderados por riesgo totales</b>	<b>472,125</b>
<b>Razones de capital y suplementos</b>		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.70%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	18.58%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	18.59%
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)	19.80%
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)	9.70%
<b>Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)</b>		
69	Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
70	Razón mínima nacional de T1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
71	Razón mínima nacional de TC (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
<b>Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)</b>		
72	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
73	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica

74	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica
75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-

#### 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)	7
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,218
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 remedaciones por beneficios definidos a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.
4	No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté representado por títulos representativos o acciones.
5	No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.
6	Suma de los conceptos 1 a 5.
7	No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.
8	Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
9	Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
10*	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.



	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
12*	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*	El monto de la inversión en cualquier acción propia que: la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido.
17*	Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.
18*	Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo. Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.
19*	Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de

	las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.
20*	Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos. Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.
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	<b>Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.</b>
	A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.
	B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
	H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.
L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.	

	M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.
	O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
	P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.
27	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
28	Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.
29	Renglón 6 menos el renglón 28.
30	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.
31	Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.
32	No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.
33	Obligaciones subordinadas computables como Capital Básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).
34	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
35	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
36	Suma de los renglones 30, 33 y 34.
37 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
38 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
39 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
40 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
41	<b>Ajustes nacionales considerados:</b> Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
42	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
43	Suma de los renglones 37 a 42.
44	Renglón 36, menos el renglón 43.
45	Renglón 29, más el renglón 44.
46	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental ni en el Capital Básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
47	Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
48	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

50	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.
51	Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.
52 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
54 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
55 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
56	<b>Ajustes nacionales considerados:</b> 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 2024)

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
<b>Activo</b>		
BG1	Efectivo y equivalentes de efectivo	51,428
BG2	Cuentas de Margen	1,761
BG3	Inversiones en instrumentos financieros	192,697
BG4	Deudores por reporto	23,661
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos financieros derivados	64,218
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(473)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	512,453
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	48,781
BG11	Bienes adjudicados (neto)	848
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	2,691
BG13	Inversiones permanentes	5,019
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta	8
BG15	Impuestos a la utilidad diferidos (neto)	6,576
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)	2,666
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,396
	Activos Intangibles (neto)	4,849
<b>Pasivo</b>		
BG17	Captación tradicional	558,729
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	45,168
	Valores Asignados por liquidar	33,120
BG19	Acreedores por reporto	63,245
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	2,281
BG22	Instrumentos financieros derivados	64,727
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	-

BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	42,677
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por Impuestos a la Utilidad	532
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,290
	Pasivos por arrendamiento	1,584
	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	8,908
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	6,273
<b>Capital contable</b>		
BG29	Capital contribuido	13,468
BG30	Capital ganado	76,577
<b>Cuentas de orden</b>		
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	357,426
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	484,460
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	76,147
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	31,971
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	2,281
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	2,158
BG41	Otras cuentas de registro	3,233,964

## 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 2024)

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	2,040	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$2,040
4	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	13	-	
5	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
6	Inversiones en acciones de la propia institución	16	-	
7	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	17	-	

8	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	
9	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18		
10	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
11	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19		
12	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	718	BG 15 Impuestos y PTU diferidos (neto) \$718
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	7	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$7
14	Inversiones en deuda subordinada	26-B	-	
15	Inversiones en organismos multilaterales	26-D	-	
16	Inversiones en empresas relacionadas	26-E	-	
17	Inversiones en capital de riesgo	26-F	-	
18	Inversiones en sociedades de inversión	26-G	-	
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	7,614	BG 16 Activos Intangibles \$4,075 más Gastos de Instalación \$3,539
21	Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	832	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 832
<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	8,908	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$8,908
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	-	
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	54,989	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$54,989
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	1,112	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$1,112
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	20,467	BG 30 Reservas de Capital \$10,240 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$485) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$222) más Resultado Neto \$10,934
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
<b>CUENTAS DE ORDEN</b>				
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
<b>CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL</b>				
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-l	-	
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 2024)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	41,901	3,352
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,193	95
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA´s	1,873	150
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's, UMA´s o con rendimiento referido al INPC	38	3
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	14,754	1,180
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	2,339	187
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	403	32
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	6	1
<b>Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo</b>		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	60	5
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%)	799	64
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	3,628	290
Grupo III (ponderados al 25%)	9	1
Grupo III (ponderados al 50%)	1,448	116
Grupo III (ponderados al 60%)	28	2
Grupo III (ponderados al 100%)	856	68
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%)	3,668	293
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	169	14

Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	785	63
Grupo VI (ponderados al 20%)	5,788	463
Grupo VI (ponderados al 25%)	3,993	319
Grupo VI (ponderados al 30%)	14,820	1,186
Grupo VI (ponderados al 40%)	14,049	1,124
Grupo VI (ponderados al 50%)	37,155	2,972
Grupo VI (ponderados al 70%)	40	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	36,672	2,934
Grupo VI (ponderados al 85%)	11,071	886
Grupo VI (ponderados al 100%)	28,604	2,288
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	152	12
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	22,673	1,814
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	861	69
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	5,927	474
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	130,483	10,439
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	1,210	97
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	4,811	385
Grupo VIII (ponderados al 150%)	9,038	723
Grupo IX (ponderados al 100%)	21,037	1,683
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-

Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	2,122	170
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	19	2
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	144	12

### Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Indicador de Negocio	47,499	3,800

## CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

El índice de capitalización de Scotiabank Inverlat S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (Scotiabank) fue de 18.59% al cierre de diciembre 2024, 200pb superior al mínimo requerido para la categoría I del artículo 220 de las Disposiciones Generales aplicables a las Instituciones de Crédito (16.59% Índice regulatorio más suplementos de Absorción de Pérdidas Totales y de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistemática Local).

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

Referencia	Características	Opciones
1	Emisor	Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2	Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg	N.A.
3	Marco legal	Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
	Tratamiento regulatorio	
4	Nivel de capital con transitoriedad	N.A.
5	Nivel de capital sin transitoriedad	Fundamental
6	Nivel del instrumento	Institución de crédito sin consolidar subsidiarias
7	Tipo de Instrumento	Acción series "F" y "B"
8	Monto reconocido en el capital regulatorio	13,468,335,561
9	Valor nominal del instrumento	Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A	Moneda del instrumento	Pesos mexicanos
10	Clasificación contable	Capital
11	Fecha de emisión	13-ene-01
12	Plazo del instrumento	Perpetuidad
13	Fecha de vencimiento	Sin vencimiento
14	Cláusula de pago anticipado	No
15	Primera fecha de pago anticipado	N.A.
15A	Eventos regulatorios o fiscales	No
15B	Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado	N.A.
16	Fechas subsecuentes de pago anticipado	N.A.
	<b>Rendimientos / dividendos</b>	

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

### Scotiabank-Información relativa a las características de los títulos que forman parte del Capital Neto

Referencia	Descripción
1	Institución de crédito que emite el título que forma parte del Capital Neto.
2	Identificador o clave del título que forma parte del Capital Neto, (ISIN, CUSIP o número identificador de valor internacional).
3	Marco legal con el que el título deberá de cumplir, así como las leyes sobre a las cuales se sujetará.
4	Nivel de capital al que corresponde el título que está sujeto a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
5	Nivel de capital al que corresponde el título que cumple con el anexo 1-Q, 1-R, o 1-S de las presentes disposiciones.
6	Nivel dentro del grupo al cual se incluye el título.
7	Tipo de Instrumento de Capital o título representativo del capital social que se incluye como parte del Capital Neto. En caso de los títulos sujetos a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, establecido en la Resolución 50a, se refiere a las obligaciones subordinadas descritas en el Artículo 64 de la Ley de Instituciones de Crédito.



- 8 Monto del Instrumento de Capital o título representativo del capital social, que se reconoce en el Capital Neto conforme al Artículo 2 bis 6 de las presentes disposiciones, en caso de que la referencia 5 sea Fundamental o Básico no Fundamental; y conforme al Artículo 2 bis 7 de las presentes disposiciones en caso de que dicha referencia sea Complementario. En cualquier otro caso, será el monto que corresponda de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
- 9 Valor nominal del título en pesos mexicanos.
- 9A Moneda utilizada para expresar el valor nominal del título en pesos mexicanos conforme al estándar internacional ISO 4217
- 10 Clasificación contable del título que forma parte del Capital Neto.
- 11 Fecha de emisión del título que forma parte del Capital Neto.
- 12 Especificar si el título tiene vencimiento o es a perpetuidad.
- 13 Fecha de vencimiento del título, sin considerar las fechas de pago anticipado.
- 14 Especificar si el título incluye una cláusula de pago anticipado por el emisor donde se ejerza el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.
- 15 Fecha en la que el emisor puede, por primera vez, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.
- 15A Especificar si la cláusula de pago anticipado considera eventos regulatorios o fiscales.
- 15B Especificar el precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado.
- 16 Fechas en la que el emisor puede, posterior a la especificada en la referencia 15, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.
- 17 Especificar el tipo de rendimiento/dividendo que se mantendrá durante todo el plazo del título.
- 18 Tasa de interés o índice al que hace referencia el rendimiento/dividendo del título
- 19 Especificar si el título incluye cláusulas que prohíban el pago de dividendos a los poseedores de títulos representativos del capital social cuando se incumple con el pago de un cupón o dividendo en algún instrumento de capital.
- 20 Discrecionalidad del emisor para el pago de los intereses o dividendos del título. Si la Institución en cualquier momento puede cancelar el pago de los rendimientos o dividendos deberá seleccionarse (Completamente discrecional); si solo puede cancelarlo en algunas situaciones (Parcialmente discrecional) o si la institución de crédito no puede cancelar el pago (Obligatorio).
- 21 Especificar si en el título existen cláusulas que generen incentivos a que el emisor pague anticipadamente, como cláusulas de aumento de intereses conocidas como "Step-Up".
- 22 Especificar si los rendimientos o dividendos del título son acumulables o no.
- 23 Especificar si el título es convertible o no en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.
- 24 Condiciones bajo las cuales el título es convertible en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.
- 25 Especificar si el título se convierte en su totalidad o solo una parte cuando se satisfacen las condiciones contractuales para convertir.
- 26 Monto por acción considerado para convertir el título en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero en la moneda en la que se emitió dicho instrumento.
- 27 Especificar si la conversión es obligatoria u opcional.
- 28 Tipo de acciones en las que se convierte el título.
- 29 Emisor del instrumento en el que se convierte el título.
- 30 Especificar si el título tiene una característica de cancelación de principal.
- 31 Condiciones bajo las cuales el título disminuye su valor.
- 32 Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el título baja de valor en su totalidad o solo una parcialmente.
- 33 Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el instrumento baja de valor permanente o de forma temporal.
- 34 Explicar el mecanismo de disminución de valor temporal.
- 35 Posición más subordinada a la que está subordinado el instrumento de capital que corresponde al tipo de instrumento en liquidación.

- 36 Especificar si existen o no características del título que no cumplan con las condiciones establecidas en los anexos 1-Q, 1-R y 1-S de las presentes disposiciones.
- 37 Especificar las características del título que no cumplen con las condiciones establecidas en los anexos 1-Q, 1-R y 1-S de las presentes disposiciones.

**Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)**

Ref.	RUBRO	Dic-24 <sup>1)</sup> T	Sep-24 T-1	Jun-24 T-2	Mar-24 T-3	Dic-23 T-4
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	25,907	16,639	16,769	15,792	16,280
1 <sup>a</sup>	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	472,125	463,647	470,684	464,864	471,664
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	4.88%	3.25%	3.25%	3.25%	3.25%
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	921,135	887,401	894,365	842,238	868,289
5	"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	2.81%	1.88%	1.88%	1.88%	1.88%
5a	No aplica					
6a	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No
6b	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No
6c	En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?	0%	0%	0%	0%	0%

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

## 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 2024 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 2 de mayo de 2024 como Institución de Banca Múltiple de Importancia Sistemática Local a Scotiabank Inverlat, S.A., mediante oficio Núm. 141-5/1991/2024 su grado de importancia sistémica y el suplemento de conservación de capital adicional, la institución fue calificada como Grado I por lo que deberá continuar con un suplemento de capital de 60 puntos base.

En base a lo anterior y continuando con la constitución del requerimiento de capacidad total de absorción de pérdidas (TLAC, que corresponde al máximo entre el 6.5% de los APSR Totales y el 3.75% de los Activos Ajustados) la institución tiene que añadir una cuarta parte desde diciembre 2022, por lo que el capital mínimo regulatorio que debe mantener Scotiabank, es de 16.59% y 14.55% al 31 de diciembre de 2024 y 2023.

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 - Composición del Suplemento al Capital Neto

Referencia	Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes	Monto
1	<b>Capital Fundamental</b>	78,832
2	Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto	8,908
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>	8,908
6	Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto	7
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	Instrumentos elegibles de Capital Complementario, de acuerdo a las reglas para el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales	7
11	Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio	87,747
	<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	Suplemento al Capital Neto surgido de instrumentos de capital no regulatorio antes de ajustes	-
	<b>Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes</b>	
18	Suplemento al Capital Neto antes de deducciones	87,747
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	87,747
	<b>Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto</b>	
23	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo ajustados como es permitido bajo el régimen Suplemento al Capital Neto <sup>4</sup>	472,125
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	921,135
	<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)	18.59%
26	Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)	9.53%

27	Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto	16.70%
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)	6.09%
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	5.49%

## Scotiabank- Composición del Suplemento al Capital Neto

Referencia	Descripción
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	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.
6	Capital Complementario, calculado con base en lo establecido en el artículo 2 Bis 5 y 2 Bis 7.
7	Porción amortizada de Instrumentos de Capital Complementario donde el vencimiento remanente es mayor a un año. Esta línea reconoce que, en tanto el plazo remanente de un instrumento de capital complementario sea mayor al requerimiento de vencimiento residual de un año, el monto total podrá ser incluido en el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales, incluso si el instrumento es parcialmente del capital regulatorio vía el requerimiento para amortizar el instrumento en cinco años previo al vencimiento. Solo el monto no reconocido en el capital regulatorio, que cumpla con todos los criterios de elegibilidad del Suplemento al Capital Neto deberá ser reportados en esta línea.
8	Instrumentos de capital complementario emitidos por la Institución en tenencia de terceros que no son elegibles para el Suplemento al Capital Neto. De acuerdo con la fracción IV, del artículo 2 Bis 5 de la CUB y los Anexos 1-R y 1-S, para cumplir con los requerimientos mínimos de Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales hasta el 31 de diciembre de 2021
9	Otros elementos de capital complementario que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.
10	Instrumentos de capital Complementario elegibles de Suplemento al Capital Neto de acuerdo al último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, para ser calculado como: línea 6 - línea 7 – línea 8 - línea 9.
11	Suplemento al Capital Neto surgido del capital regulatorio para ser calculado como: línea 1 + línea 5 + línea 10.
	<b>Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio</b>
12	Instrumentos externos del Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por la institución y deuda subordinada excluida. El monto reportado en esta línea debe cumplir los requerimientos de subordinación señalados en el Anexo 1-R o Anexo 1-S.
13	Instrumentos externos emitidos directamente por institución que no son subordinados a pasivos excluidos, pero cumplen los otros requisitos de los Anexos 1-R o 1-S.
14	El monto reportado en la línea 13, después de la aplicación de los límites superiores 2.5% y 3.5% mostrados en el penúltimo párrafo de la sección 11 de la hoja de términos del TLAC
15	Instrumentos externos de TLAC emitidos con fines de financiamiento previo al 1 de enero de 2022. Montos emitidos después del 1 de enero de 2022 no son elegibles para efectos de Suplemento al Capital Neto y no deben ser reportados aquí. No aplica.
16	Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar una institución de importancia sistémica local en resolución, sujeta a las condiciones mostradas en el segundo párrafo de la sección 7 de la hoja de términos de TLAC. No aplica.
17	Elementos del capital no regulatorio del Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 12 + línea 13

### **Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes**

- 18 Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 11 + línea 17.
- 19 Deducciones de exposiciones de la institución de importancia sistémica local que corresponden a cuentas elegibles para Suplemento al Capital Neto. Todos los montos reportados en esta línea deben corresponder a deducciones aplicadas después de los ajustes adecuados acordados por el grupo de administración de crisis (CMG) (siguiendo el penúltimo párrafo de la sección 3 de la hoja de términos de TLAC, el CMG debe discutir y, donde sea adecuado y consistente con la estrategia de resolución, acordar la asignación de las deducciones).
- 20 Deducciones de inversiones en otros pasivos de TLAC propios, monto para ser deducido de recursos de TLAC. No aplica
- 21 Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto.
- 22 El Suplemento al Capital Neto (como puede ser el caso) después de deducciones. Para ser calculado como: línea 18 - línea 20 - línea 21.

### **Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto**

- 23 APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.
- 24 Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.

### **Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos**

- 25 Indicador Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto), para ser calculada como línea 22 dividido entre línea 23.
- 26 Indicador Suplemento al Capital Neto (como porcentaje de Exposiciones totales 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 con el 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 equipos expertos por tipo de riesgo, lo anterior para garantizar una gestión adecuada tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

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

## **Riesgo de mercado**

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

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre de diciembre de 2024 fue de \$17.34 millones y su promedio durante el cuarto trimestre de 2024 fue de \$15.90 millones mismo que corresponde a un 0.018% del capital neto (\$88,545 millones a noviembre 2024, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del cuarto trimestre de 2024 se muestran a continuación:



<b>Nocional (millones de pesos)</b>	Cierre Diciembre 2024	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	2,117,231	1,868,818
Mercado de Dinero	49,100	52,068
Tipo de cambio		
Cash	3,870	5,000
Derivados	314,715	311,895
Capitales		
Cash	22	20
Derivados	5,920	6,227
<b>VaR 1 día (millones de pesos)</b>		
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	17.18	16.40
Tipo de cambio	3.37	3.71
Capitales	-	-
<b>VaR Global</b>	<b>17.34</b>	<b>15.90</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 2024 muestra una pérdida máxima de \$541.25 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 tercer trimestre de 2024, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

### **Riesgo de liquidez y tasas de interés**

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

Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se han establecido límites, los cuales son revisados al menos de manera anual y monitoreados de manera periódica<sup>1</sup> a fin de que los mitigantes del riesgo estén actualizados y sean precisos. Entre los límites aplicables se encuentran aquellos relacionados a activos líquidos, brechas de liquidez, sensibilidad del margen y sensibilidad del valor económico, mismos que se encuentran alineados con el apetito de riesgo de la institución.

La estructura de límites de riesgo de liquidez y tasas de interés contempla montos nominales, así como de plazo y concentración; de manera periódica se informa al Comité de Activos y Pasivos, Comité de Riesgos y al Consejo de Administración sobre el desempeño de dichos límites, así como de los indicadores en materia de riesgo de liquidez y tasas de interés.

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

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

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

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de diciembre 2024 así como el promedio del cuarto trimestre de 2024 se muestra a continuación:

<b>Scotiabank</b> <b>(millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>2</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US)	75,313	63,746
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	142,206	134,379

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 2024 de 168.73% y 116.27% respectivamente.

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

<sup>2</sup> Cifras previas al cierre del cuarto trimestre 2024.

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 2024 y en promedio para el cuarto trimestre de 2024 es la siguiente:

<b>Scotiabank</b> <b>(millones de pesos)</b>	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Valor Económico (+100 pbs)	(2,181)	(2,192)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(295)	(222)

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 del cálculo de VaR.

<b>Scotiabank</b> <b>(millones de pesos)</b>	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender <sup>1)</sup>	94,172	93,678
Derivados de Cobertura	116,188	116,407

<sup>1)</sup>. Incluye operaciones de venta en directo y en reporto.

## BAJA DE CALIFICACIÓN

Como medida conservadora y a manera de estar preparados para un posible aumento de requerimientos de liquidez como resultado de una posible baja en la calificación del Banco (esto asociado a que una baja en la calificación del Banco desencadenaría un aumento del colateral requerido en operaciones de derivados), el grupo de administración de riesgos realiza de manera periódica el impacto que tendría este escenario y las consecuencias en las medidas de liquidez y activos líquidos. El impacto de la baja en la calificación de la institución en 3 niveles para cierre de diciembre 2024 y el promedio del cuarto trimestre del 2024 fueron \$5,534 millones y \$4,876 millones, respectivamente.

## RIESGO DE CRÉDITO

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

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

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

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

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

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

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

Metodología para determinar las estimaciones preventivas para riesgos crediticios El Banco cuenta con un sistema de clasificación de riesgos crediticios aprobado a nivel institucional para cartera Comercial y modelos de score y/o métricas de seguimiento de desempeño para la cartera de Menudeo. También se cuenta con procesos y sistemas que permiten clasificar la cartera por nivel de riesgo y realizar el proceso de cálculo de reservas de todas las carteras de crédito, conforme a los modelos regulatorios establecidos por CNBV en la CUB.

Se utilizan las Agencias Calificadoras aprobadas por CNBV conforme se describe en Anexo 1-B de la CUB.

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 tercer trimestre corresponde a \$11 millones; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.

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

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

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

Al cierre del cuarto trimestre de 2024, el Banco mantiene \$2 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

## **INFORMACIÓN METODOLÓGICA**

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

- La pérdida esperada representa el monto que el Banco espera perder durante los próximos doce meses por concepto de incumplimientos dadas las características de sus carteras. Es igual al resultado de multiplicar la exposición al incumplimiento (EI), la probabilidad de incumplimiento (PI) y la severidad de la pérdida (SP) de las exposiciones crediticias.

- La pérdida no esperada, es una medida de dispersión alrededor de la pérdida esperada. Representa el capital económico necesario para mantener solvente a la Institución en caso de un evento adverso de gran magnitud que impacte las carteras crediticias.

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

<b>Métricas Riesgo de Crédito<sup>1)</sup></b> <b>(Cifras al 31 de diciembre 2024)</b>	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.28%	2.91%
Consumo	3.70%	15.59%
Cartera Comercial	0.56%	4.24%
<b>Total</b>	<b>0.76%</b>	<b>4.71%</b>

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

<b>Parámetros de Riesgo<sup>1)</sup></b> <b>(Cifras a millones al 31 de diciembre 2024)</b>	EI <sup>2)</sup>	PI	SP
Hipotecas	232,385	1.98%	16.66%
Consumo	66,952	4.90%	72.24%
Cartera Comercial	277,755	1.40%	43.50%

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

2). Incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos Inter compañía.

## TÉCNICAS DE MITIGACIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO

El Banco cuenta con políticas y procesos que le permite realizar una valoración de las garantías. En el proceso de constitución de garantías; previo a su aceptación, se valora la capacidad de absorción de riesgo y 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 2024.

## 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 2024 y en promedio durante el cuarto trimestre de 2024, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.03% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.38% y 0.33% respectivamente.

## **RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES DE DERIVADOS**

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

## **METODOLOGÍA PARA ESTABLECIMIENTO DE LÍMITES DE CRÉDITO PARA CONTRAPARTES Y ASIGNACIÓN DE CAPITAL**

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

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

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

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

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

## **RIESGO OPERACIONAL**

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

## **METODOLOGÍA GENERAL**

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

## **POLÍTICAS PARA LA GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL**

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

## **EVALUACIÓN DE RIESGO OPERACIONAL**

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

## **MANUAL PARA LA RECOLECCIÓN Y CLASIFICACIÓN DE DATOS DE RIESGO OPERACIONAL**

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

## **NIVELES DE TOLERANCIA DE RIESGO OPERACIONAL**

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

## **INDICADORES CLAVE DE RIESGO (KRI)**

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

## **RIESGO LEGAL**

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

## **CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO OPERACIONAL**

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



## VALOR PROMEDIO DE LA EXPOSICIÓN

Durante el periodo de octubre - diciembre 2024, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$67.4 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de diciembre 2024 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$55.6 millones y corresponden 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 el Marco de Gestión del Riesgo Tecnológico y de Ciberseguridad que define las funciones, responsabilidades y obligaciones de las partes interesadas, así como, la supervisión de los organismos y las herramientas, prácticas y entregables requeridos 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 2024 – diciembre 2024 (T4 2024)

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

(Cifras en millones de pesos)	Calculo Individual T4 2024		Calculo Consolidado T4 2024		
	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	135,578	No aplica	135,578
<b>SALIDAS DE EFECTIVO</b>					
2	Financiamiento minorista no garantizado	169,179	13,694	169,179	13,694
3	Financiamiento estable	99,365	6,713	99,365	6,713
4	Financiamiento menos estable	69,814	6,981	69,814	6,981
5	Financiamiento mayorista no garantizado	256,091	93,657	256,091	93,657
6	Depósitos operacionales	153,768	37,628	153,768	37,628
7	Depósitos no operacionales	98,574	52,280	98,574	52,280
8	Deuda no garantizada	3,749	3,749	3,749	3,749
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	-	No aplica	-
10	Requerimientos adicionales:	292,311	20,974	292,311	20,974
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	9,490	7,048	9,490	7,048
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-	-	-
13	Líneas de crédito y liquidez	282,821	13,926	282,821	13,926
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	63	63	63	63
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,857	2,857	2,857	2,857
16	<b>TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	131,246	No aplica	131,246
<b>ENTRADAS DE EFECTIVO</b>					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	11,866	458	11,866	458
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	45,350	31,707	45,350	31,707
19	Otras entradas de efectivo	19,081	19,081	19,081	19,081
20	<b>TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO</b>	76,297	51,246	76,297	51,246
21	<b>TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES</b>	No aplica	135,578	No aplica	135,578
22	<b>TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	80,000	No aplica	80,000
<b>23</b>	<b>COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ<sup>[1]</sup></b>	<b>No aplica</b>	<b>168.73</b>	<b>No aplica</b>	<b>168.73</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.

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

**Durante diciembre 2024, 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 \$73,333 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$28,661 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por \$1,904 millones y \$5,534 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$15,662 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$19,394 millones y por operaciones de call money de \$13,141 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$19,886 millones

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$142,601 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$105,850 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$26,019 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 \$7,323 millones y \$3,409 millones en títulos de nivel 2.

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

**Promedio del tercer trimestre 2024: 167% – promedio del cuarto trimestre 2024: 169%**

El coeficiente de cobertura de liquidez incrementó 200 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$5,672 millones y los depósitos en bancos crecieron en MXN \$4,472 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un incremento de \$7,225 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco decreció en \$9,581 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en \$18,239 millones.

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

<b>Evolución de Activos Líquidos T4-2024</b>	Octubre	Noviembre	Diciembre
Efectivo	5%	6%	5%
Reservas en el Banco Central	21%	20%	18%
Nivel 1	71%	72%	74%
Nivel 2 <sup>a</sup>	3%	2%	3%
Nivel 2B	0%	0%	0%
<b>Total de Activos Líquidos Ponderados</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

4 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.

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

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

<b>Concentración de fuentes de Financiamiento</b>	Octubre	Noviembre	Diciembre
<b>CAPTACION TRADICIONAL</b>			
Depósitos de exigibilidad inmediata	46%	47%	49%
Depósitos a plazo			
Del público en general	36%	34%	32%
Mercado de dinero	6%	6%	6%
Títulos de crédito emitidos	5%	5%	5%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	2%	3%	3%
De largo plazo	5%	5%	5%
<b>Total</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

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

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

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

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

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

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

#### **Exposición Potencial Futura (diciembre 2024)** **(Cifras en millones de pesos)**

Con contrato de compensación	5,062
Sin contrato de compensación	9,218
Posibles llamadas de margen (diciembre 2024)	
Colateral en Tránsito	47
Downgrade (diciembre 2024)	
Baja calificación 3 niveles	5,534

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de diciembre 2024 es la siguiente:

<b>Scotiabank-Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)</b>	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	2,117,231
Tipo de cambio	314,715
Capitales	5,920
<b>Total</b>	<b>2,437,866</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 2024, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de 7.1% al cierre de diciembre del 2024 y en promedio durante cuarto trimestre del 2024 fue de 6.1%.

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

## I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

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

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 descaldes de liquidez se muestran en el siguiente inciso.

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

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

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

Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con las siguientes exposiciones a finales de diciembre 2024.

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

Descripción <sup>7</sup>	Promedio	Diciembre
	T4 2024	2024
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	30,159	27,316
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	55,979	46,047
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	40	41
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	38	38
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	40	41
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	38	38

- 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 2024 y el promedio del cuarto trimestre de 2024 son:

Scotiabank <sup>8</sup>	Posición	Posición
	(Cierre) <sup>9</sup>	(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	75,313	63,746
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	142,206	134,379

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

## II. Información cualitativa

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

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

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

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

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

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

<sup>9</sup> Cifras previas al cierre de diciembre 2024.

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

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

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

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

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

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

- Cálculo de CCL (Coeficiente de Cobertura de Liquidez)
- Cálculo de CFEN (Coeficiente de Financiamiento Estable Neto)
- Cómputo de Activos Líquidos
- Cálculo de LDR (Loan to Deposit Ratio)
- Monitoreo de la concentración de fondeo profesional
- Monitoreo de Brechas de Liquidez
- Monitoreo de Concentración de Depósitos
- Monitoreo de Depósitos con Bancos
- Monitoreo del Portafolio de Inversión
- Monitoreo de créditos cedidos como garantía de fondeo
- Pruebas de Estrés de Liquidez
- Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez
- Reportes periódicos al Comité de Activos y Pasivos de la Institución
- Reportes periódicos al Comité de Riesgos
- Reportes al Consejo de Administración
- Políticas y Manuales alusivos a la Administración del Riesgo de Liquidez
- Plan de Contingencia para Riesgos de Solvencia y Liquidez

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

- Medición, supervisión y pronóstico de compromisos que involucren flujos de efectivo para las principales monedas manejadas por el Banco (MXP+UDIs y USD).
- Procurar una distribución uniforme de los flujos de efectivo, minimizando las brechas de liquidez entre activos y pasivos, considerando el impacto potencial de renovaciones, prepagos, retiros de depósitos, otorgamiento de crédito y el incumplimiento en pago de créditos.
- Mantener fuentes diversificadas de fondeo.
- Establecer programas de corresponsalías y préstamos interbancarios para ayudar a mantener el acceso a mercado.



- Instrumentar y mantener disponibles programas para la emisión de pasivos, y descuento de cartera con fondos especializados.
- Mantener la capacidad operativa en los sistemas de liquidación establecidos por Banco de México, considerando para esto los requerimientos de garantía y límites establecidos para tal efecto.
- Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

- Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital de manera oportuna.
- En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de éstas: (i) operaciones de crédito simple garantizado con depósitos de regulación monetaria o depósitos en dólares que el Grupo Financiero mantenga en el Banco de México, o (ii) reportos sobre títulos elegibles. Dicho financiamiento está sujeto al procedimiento que señala la circular 10/2015 de Banxico.
- Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el cuarto trimestre de 2024, 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 2024, 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 2024

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

(Cifras en millones de pesos)	Cifras Individuales					Cifras Consolidadas				
	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado
	Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año	
<b>ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE</b>										
1 Capital:	95,990.65	0.00	0.00	0.00	95,990.65	95,990.65	0.00	0.00	0.00	95,990.65
2 Capital fundamental y capital básico no fundamental.	95,990.65	0.00	0.00	0.00	95,990.65	95,990.65	0.00	0.00	0.00	95,990.65
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	210,855.24	1,108.38	31.48	195,382.47	0.00	210,855.24	1,108.38	31.48	195,382.47
5 Depósitos estables.	0.00	91,171.60	503.06	19.72	87,110.65	0.00	91,171.60	503.06	19.72	87,110.65
6 Depósitos menos estables.	0.00	119,683.64	605.31	11.76	108,271.82	0.00	119,683.64	605.31	11.76	108,271.82
7 Financiamiento mayorista:	0.00	361,147.00	29,153.85	56,050.88	193,200.64	0.00	361,147.00	29,153.85	56,050.88	193,200.64
8 Depósitos operacionales.	0.00	44,335.43	0.00	0.00	22,167.71	0.00	44,335.43	0.00	0.00	22,167.71
9 Otro financiamiento mayorista.	0.00	316,811.58	29,153.85	56,050.88	171,032.93	0.00	316,811.58	29,153.85	56,050.88	171,032.93
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	50,053.77	701.25	3,368.03	3,718.66	0.00	50,053.77	701.25	3,368.03	3,718.66
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	50,053.77	701.25	3,368.03	3,718.66	0.00	50,053.77	701.25	3,368.03	3,718.66
14 Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	95,990.65	622,056.01	30,963.48	59,450.39	488,292.42	95,990.65	622,056.01	30,963.48	59,450.39	488,292.42
<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	8,356.14	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	8,356.14
16 Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
17 Préstamos al corriente y valores:	0.00	126,945.88	38,924.99	299,930.21	356,461.82	0.00	126,945.88	38,924.99	299,930.21	356,461.82
18 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	12,933.11	0.00	0.00	1,293.31	0.00	12,933.11	0.00	0.00	1,293.31
19 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	14,250.07	9,526.60	3,579.89	10,480.70	0.00	14,250.07	9,526.60	3,579.89	10,480.70

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

20	Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	76,898.53	26,272.39	134,609.96	159,553.19	0.00	76,898.53	26,272.39	134,609.96	159,553.19
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	4,169.97	4,410.68	252,899.16	173,098.09	0.00	4,169.97	4,410.68	252,899.16	173,098.09
23	Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	1,194.19	1,284.68	93,620.37	62,092.67	0.00	1,194.19	1,284.68	93,620.37	62,092.67
24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	19,888.39	0.00	2,461.57	12,036.53	0.00	19,888.39	0.00	2,461.57	12,036.53
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	78,035.70	1,081.77	8,824.58	40,479.03	0.00	78,035.70	1,081.77	8,824.58	40,479.03
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	2,541.96	0.00	0.00	2,160.66	No Aplica	2,541.96	0.00	0.00	2,160.66
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	916.20	No Aplica	0.00	0.00	0.00	916.20
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	842.14	No Aplica	0.00	0.00	0.00	842.14
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		75,493.74	1,081.77	8,824.58	36,560.03	0.00	75,493.74	1,081.77	8,824.58	36,560.03
32	Operaciones fuera de balance.	No Aplica	293,099.94	0.00	0.00	14,655.00	No Aplica	293,099.94	0.00	0.00	14,655.00
33	Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	419,951.99	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	419,951.99
34	<b>Coefficiente de Financiamiento Estable Neto (%).</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>116.27</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>116.27</b>

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

### Durante diciembre 2024, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:

- Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$192,711 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$129,265 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$94,410 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$29,319 millones y \$36,134 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$3,076 millones.

- Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$352,249 millones y por operaciones mercado de dinero de \$23,236 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$18,387 millones, deducciones de capital por \$11,548 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$1,781 millones.

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

## Promedio del tercer trimestre del 2024: 115.48% – Promedio del cuarto trimestre del 2024: 116.27%

El coeficiente de financiamiento neto aumentó 79pb respecto al tercer trimestre del 2024, esto debido principalmente a:

- El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional disminuyó en MXN 9,578 millones. El fondeo profesional aumentó en MXN 13,723 millones.
- El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas aumentaron \$37,942 millones.
- La evolución de la composición del Monto de Financiamiento Estable Disponible y del Monto de Financiamiento Estable Requerido.

Monto Computable (MXN MM)	Octubre	Noviembre	Diciembre
Financiamiento Estable Disponible	486,957	487,791	490,130
Financiamiento Estable Requerido	417,594	421,193	421,069
<b>Coeficiente de Fondeo Estable Neto</b>	<b>116.61%</b>	<b>115.81%</b>	<b>116.40%</b>

- 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 2024 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$21.66 millones de pesos, con una minusvalía de \$0.22 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	1,000,000	2.47	1.94	0.53
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	105,000	3.29	3.14	0.15
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	15,012	0.05	0.05	-
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	150,000	3.51	3.84	(0.33)
Scotiabank	Pública	1_ORBIA_*	150,000	2.25	2.33	(0.08)
Scotiabank	Pública	1_GCARSO_A1	34,000	3.92	4.06	(0.14)
Scotiabank	Pública	1_LIVEPOL_C-1	10,000	0.99	1.00	(0.01)
Scotiabank	Pública	1_BIMBO_A	30,152	1.67	1.66	0.01
Scotiabank	Pública	1L_EWZ_*	7,500	3.51	3.86	(0.35)
<b>Total</b>			<b>1,501,664</b>	<b>21.66</b>	<b>21.88</b>	<b>(0.22)</b>

Al cierre del cuarto trimestre del año 2024, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$0.60 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	100,000	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	50,000	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	20,000	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	45,000	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1B_NAFTRAC_ISHRS	75,000	0.01	(0.02)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1_CEMEX_CPO	130,000	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1I_EWZ_*	1,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	763,891	0.10	(0.05)	0.05
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	3,703	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	53,619	-	(0.12)	(0.12)
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	74,857	0.01	(0.13)	(0.12)
Scotiabank	Pública	1B_NAFTRAC_ISHRS	124,646	0.01	(0.11)	(0.10)
Scotiabank	Pública	1_ALPEK_A	30,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I_IB1MXX_N	950	0.09	-	0.09
Scotiabank	Pública	1_CEMEX_CPO	120,000	0.09	-	0.09
Scotiabank	Pública	1_ORBIA_*	11,190	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	102,098	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	500,000	0.26	-	0.26
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	601	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	55,000	0.15	-	0.15
Scotiabank	Pública	1B_NAFTRAC_ISHRS	139	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_ALPEK_A	60,000	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1I_EWZ_*	100	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_KIMBER_A	238,546	0.22	(0.17)	0.05
Scotiabank	Pública	1_ELEKTRA_*	1,100	0.08	-	0.08
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	15,353	-	-	-
<b>Total</b>			<b>2,576,793</b>	<b>1.21</b>	<b>(0.61)</b>	<b>0.60</b>

La posición accionaria de títulos por cobrar o vender asciende \$0 millones de pesos, con una plusvalía de \$0 millones de pesos.

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

Al 31 de diciembre, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de \$32.26 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$23.72 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$8.54 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición	Coefficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado	106.72	0.00	106.72	22.23%	23.72
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	106.72	0.00	106.72	8.00%	8.54
Índices accionarios	0.00	0.00	0.00	4.00%	0.00
Requerimiento por riesgos específico	0.00	0.00	0.00	4.00%	0.00
<b>Total Requerimiento de capital</b>					<b>32.26</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-24	dic-24
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)	803,884	830,701
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(11,111)	(11,204)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	792,773	819,497
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)	3,717	5,196
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	6,418	7,100
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)	(3,543)	(3,341)
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)	6,592	8,955
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	14,052	23,661
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(14,052)	(23,400)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	9	20
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)	9	281

Otras exposiciones fuera de balance			
17	Exposición fuera de balance (importe nominal bruto)	327,896	357,426
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(239,868)	(265,024)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	88,028	92,402
Capital y exposiciones totales			
20	Capital de Nivel 1	78,770	87,740
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	887,401	921,135
Coeficiente de apalancamiento			
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	8.88%	9.53%

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

Referencia	DESCRIPCION	sep-24	dic-24
1	Activos totales	877,814	918,579
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	(842)	(831)
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	(53,286)	(55,263)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(14,043)	(23,380)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	88,028	92,402
7	Otros ajustes	(10,268)	(10,372)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	887,401	921,135

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

Referencia	DESCRIPCION	sep-24	dic-24
1	Activos totales	877,814	918,579
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(59,878)	(64,218)
3	Operaciones en reporto y préstamos de valores	(14,052)	(23,661)
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	803,884	830,701

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

CONCEPTO/PERIODO	sep-24	dic-24	Variación
Capital Básico <sup>1)</sup>	78,770	87,740	8,970
Activos Ajustados <sup>2)</sup>	887,401	921,135	33,734
Razón de Apalancamiento <sup>3)</sup>	8.88%	9.53%	65 pb

1). Reportado en la fila 20

2). Reportado en la fila 21 y

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

Cifras previas a la réplica de Banxico

**Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la Razón de Apalancamiento por el periodo de septiembre a diciembre de 2024.**

El indicador se ubicó en 9.53%, 65pb mayor respecto al trimestre anterior, debido al incremento del capital nivel 1 de \$8,970 millones(+101pb) por el resultado neto del periodo (+34pb) y sustitución de deuda subordinada (+61pb); disminuyendo parcialmente por el incremento de los activos ajustados por \$33,734 millones (-36 pb); principalmente por el incremento de las exposiciones dentro del balance.

**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 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: <ul style="list-style-type: none"> <li>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.</li> <li>b) La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.</li> <li>c) El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.</li> </ul>
4	<ul style="list-style-type: none"> <li>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.</li> <li>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.</li> </ul> <p>En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.</p>
5	Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones. En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.



- 6 No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
- 7 Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
- 8 No aplica.
- 9 No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
- 10 No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
- 11 Suma de las líneas 4 a 10
- 12 Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)  
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:
- 13 **a)** Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.  
**b)** Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.  
**c)** Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.  
**d)** Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.
- El monto se debe registrar con signo negativo.
- 14 Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.
- 15 Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado.
- Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.
- 16 Suma de las líneas 12 a 15
- 17 Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.
- 18 Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%.
- El monto se debe registrar con signo negativo.
- 19 Suma de las líneas 17 y 18
- 20 Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
- 21 Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19
- 22 Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

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

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

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

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

#### AGENCIAS CALIFICADORAS

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

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

## DIVIDENDOS

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

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

Fecha de pago	Importe
23 de abril de 2013	\$ 165 millones

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

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

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

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

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

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 20 de diciembre del 2013, se aprobó decretar y pagar un dividendo extraordinario en efectivo, hasta por la cantidad de \$4,200'000,000.00 (Cuatro mil doscientos millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.6774193548387 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6,200'000,000 (Seis mil 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".

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

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

## **FUENTES INTERNAS Y EXTERNAS DE LIQUIDEZ**

Al 31 de diciembre de 2024, 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\$130,193 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$51,428 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 2024, 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 a las políticas establecidas.

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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



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

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al riesgo de tasas de interés y al riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 “Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura”, en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las operaciones de cobertura.

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

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



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

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

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

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

2). (MR) Mercados reconocidos

3). (ME) Mercados extrabursátiles

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

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

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1y 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 2024 y en promedio para el cuarto trimestre de 2024 es de:

<b>Scotiabank– Brechas de liquidez acumuladas (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>11</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	75,313	63,746
Liquidity Buffer	142,206	134,379

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

<sup>11</sup>Cifras previas al cierre de diciembre 2024.

## INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

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

### INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

Producto	Subyacente	Moneda	Módulo de Valuación	Factor de Valuación	Fuente de Precios
Cross Currency Interest Rate Swap	(All Interest Rate)	MXN,CAD,USD, EUR,JPY,GBP	Swap	Interest Rate Curve	VALMER
				FX Rate	VALMER
Interest Rate Swap	(All Interest Rate)	MXN,CAD,USD, EUR,JPY,GBP	Swap	Interest Rate Curve	VALMER
Interest Rate Cap/Floor	(All Interest Rate)	MXN,USD	Cap/Floor Black's	Interest Rate Curve	VALMER
				Surface	Bloomberg/Reuters
OTC Binary Interest rate Option	(All Interest Rate)	MXN,USD	Cap/Floor Black's	Interest Rate Curve	VALMER
				Surface	Bloomberg/Reuters
IRS Futures	TIIIE Fondo	MXN	Price	Price	VALMER
Listed Interest Rate Swap (CME)	TIIIE Fondo	MXN	Swap	Interest Rate Curve	VALMER
				Curve	VALMER
OTC European Index Call Spread Option	OTC European Index Call Spread Option	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Call Spread Option	Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
				Dividend	
OTC European Basket Option	Equity Index, Common Stock	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Basket Asian AN/Alytic Multi-Factor	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
OTC European Equity Option	Common Stock, Equity Index, ETF and Bond Index with Target Volatility (Vol Under 15%)	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Equity Option	Dividend	
				Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
OTC Index Binary Equity Option	Common Stock, Equity Index, ETF	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Equity Option	Correlation	
				Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Dividend	

Producto	Subyacente	Moneda	Módulo de Valuación	Factor de Valuación	Fuente de Precios
OTC Single Stock Autocallable Option	Common Stock, Equity Index, ETF	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	EqOpt Autocallable Note	Curve Price Surface Correlation Dividend	VALMER K2 Trader's mark
Equity Index Future	Equity Index	MXN	Price	OPICS	VALMER
Equity Future	Equity Stock	MXN	Price	OPICS	VALMER
Interest Rate Future	(All Interest Rate)	MXN	Price	OPICS	VALMER
Listed Equity Index Future Option	Equity Index	MXN	Price	OPICS	VALMER
Listed Single Stock Option	Common Stock	MXN	Price	OPICS	VALMER
FX Futures	FX Spot	USD,BRL,CLP,COP, MXN,PEN,AUD,EUR, JPY,GBP,CHF,CAD	Price	OPICS	VALMER
OTC Foreign Exchange (FX) American Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Cox, Ross and Rubinstein	Curve FX Rate Surface	VALMER
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Merton, Reiner and Rubinstein	Curve FX Rate Surface	VALMER
OTC Foreign Exchange (FX) European Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Garman and Kohlhagen	Curve FX Rate Surface	VALMER
OTC FX Binary Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Black-Scholes	Curve FX Rate Surface Price	VALMER
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery Forward	FX Spot	MXN,USD,CAD,EUR, BRL,CLP,COP,PEN, AUD,JPY,GBP,CHF	Forex	Curve FX Rate	VALMER

## INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO

Producto	Subyacente	Moneda	Módulo de Valuación	Factor de Valuación	Fuente de Precios
Listed Structured Notes	Common Stock	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Price	Price	VALMER

## POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO

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

### TIPOS DE OPERACIÓN QUE SON OFRECIDOS EN FUNCIÓN AL TIPO DE ACREDITADO

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

### PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO

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

### SUJETOS DE CRÉDITO

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

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

### REGLAS PARTICULARES

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

## **IDONEIDAD DEL CLIENTE**

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

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

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

## **POLÍTICAS DE VAR**

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

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

## **B) DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN**

### **MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:**

#### **CÁLCULO DE SENSIBILIDADES**

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

#### **PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)**

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

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

#### **BONOS DE TASA FLOTANTE**

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

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

## **BONOS CUPÓN CERO**

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

## **RIESGO DE CRÉDITO**

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

## **SENSIBILIDAD DEL PASIVO**

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

## **DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS**

### **SWAPS DE TASA DE INTERÉS**

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

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

### **FUTUROS DE TIIE**

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

### **FUTUROS DE BONO M**

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

### **FUTUROS DE CETE**

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

## **EFFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:**

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

Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios mensuales históricos, es decir una ventana de observación de cinco años con base en un análisis de regresión.

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

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

Grado de relación entre los cambios observados:  $R2 \geq 80\%$ .

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 2024 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el cuarto trimestre de 2024 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

#### **COBERTURA DE FLUJOS DE EFECTIVO:**

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

El componente que forma parte de “Otro Resultado Integral” asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre: la ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.

#### **COBERTURA DE VALOR RAZONABLE:**

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

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

En adición, 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 o 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 cubiertas desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.

Al cierre de diciembre de 2024 y promedio del cuarto trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

<b>Scotiabank– (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>12</sup>	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer	142,206	134,379

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

<sup>12</sup>Cifras previas al cierre de diciembre 2024.

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

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario Estrés
Gap 30d Gap Acum	75,313	69,778	69,777	69,775
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(5,535)	(5,536)	(5,538)

## **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 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

Cifras expresadas en pesos

### A) ANÁLISIS DE SENSIBILIDADES DEL PORTAFOLIO DE OPERACIONES DERIVADAS DE TASA.

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a diciembre 31, 2024

	0-3 Months	3-12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	10,743.00	557,493.00	(331,005.00)	158,457.00	159,117.00	(11,971.00)	542,834.00
CCS	4.00	(88.00)	(115.00)	198.00	528.00	107.00	634.00
Caps&Floors	763.00	(3,944.00)	(2,445.00)	1,130.00	(16.00)	(1.00)	(4,513.00)
Binary	-	-	-	-	-	-	-
Caps&Floors F TIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>11,510.00</b>	<b>553,461.00</b>	<b>(333,565.00)</b>	<b>159,785.00</b>	<b>159,629.00</b>	<b>(11,865.00)</b>	<b>538,955.00</b>

### ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD

#### SUPUESTOS DE CÁLCULO.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIE, 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 (37.08) Millones de pesos.
- Con escenario poco probable un P&L de (74.16) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (158.46) Millones de pesos.

Los escenarios de stress están basados en el movimiento al alza que pudieran tener las tasas de interés, en el escenario probable de 50 pb, en el escenario poco probable de 100 pb y en el escenario muy poco probable 200pb. Los escenarios se muestran a continuación.

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 TIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	0.54	211.81	50.00	(26.95)	100.00	(53.90)	200.00	(107.79)
Volatilidad al 1% a FX %	Caps & Floors	-	1.63	0.10	(0.00)	0.40	-	1.00	-
a FX %	Forwards	4.85	101.33	0.10	(10.13)	0.20	(20.27)	0.50	(50.66)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	0.00	0.20	-	0.50	-
<b>Total</b>					<b>(37.08)</b>		<b>(74.16)</b>		<b>(158.46)</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 2024 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options BNUI5.INDX	-	-	-
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options META.OQ	-	-	-
Options MEXIPC.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

## Análisis de Stress

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

<b>Escenarios a la baja</b>	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	-	-	-
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options META.OQ	-	-	-
Options MEXIPC.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
<b>TOTAL</b>	-	-	-

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

<b>Escenarios al alza</b>	0.05	0.15	0.2
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	-	-	-
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options META.OQ	-	-	-
Options MEXIPC.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
<b>Total</b>	-	-	-

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:

Escenario	Monto
Probable	-
Poco Probable	-
Muy poco Probable	-

## 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 2024 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte	Colateral		Colateral	
	Recibido MXN	Enviado MXN	Recibido USD	Enviado USD
CLIENTE 1	-	-	12,745,000	(23,770,000)
CLIENTE 2	1,060,000,000	(1,269,000,000)	-	-
CLIENTE 3	-	-	200,000	(11,635,000)
CLIENTE 4	-	-	22,900,000	-
CLIENTE 5	42,300,170	(376,822,600)	24,650,000	(60,125,000)
CLIENTE 6	-	-	13,730,000	(24,260,000)
CLIENTE 7	-	-	268,550,000	(143,130,000)
CLIENTE 8	-	-	189,100,000	(173,300,000)
CLIENTE 9	-	-	8,610,000	(420,000)
CLIENTE 10	-	-	-	(100,000)
CLIENTE 11	-	-	50,760,000	(22,140,000)
CLIENTE 12	93,000,000	(127,500,000)	-	-
CLIENTE 13	348,600,000	(327,400,000)	-	-
CLIENTE 14	136,500,000	(181,700,000)	184,620,000	(158,050,000)
CLIENTE 15	66,213,453	(2,871,151,000)	-	-
CLIENTE 16	16,300,000	(22,300,000)	-	-
CLIENTE 17	-	-	1,850,000	(140,000)
CLIENTE 18	-	-	1,870,000	(1,260,000)
CLIENTE 19	-	-	220,000	(3,640,000)
CLIENTE 20	-	-	15,150,000	(22,100,000)
CLIENTE 21	2,700,000	(35,800,000)	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>1,765,613,623</b>	<b>(5,211,673,600)</b>	<b>794,955,000</b>	<b>(644,070,000)</b>

## REVELACIÓN DE CUALQUIER INCUMPLIMIENTO QUE SE HAYA PRESENTADO A LOS CONTRATOS RESPECTIVOS

Producto	Fecha de evento	Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	29/10/2024	Cliente 1	MXN	(853,967)	Otros
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	29/11/2024	Cliente 2	MXN	(898,646)	En espera de instrucción
Pagos por Operaciones de Opción	03/12/2024	Cliente 3	MXN	472,549,750	Pago un día después del vencimiento
Pagos por Operaciones Adelantadas (Forwards)	04/12/2024	Cliente 4	MXN	1,243,479	Pago un día después del vencimiento
Pagos por Operaciones de Opción	05/12/2024	Cliente 5	MXN	121,660	Pago un día después del vencimiento
Pagos por Operaciones de Opción	05/12/2024	Cliente 6	MXN	2,085,993	Pago un día después del vencimiento
Pagos por Operaciones Adelantadas (Forwards)	19/12/2024	Cliente 7	MXN	1,715,555	Pago un día después del vencimiento
Pagos por Operaciones Adelantadas (Forwards)	19/12/2024	Cliente 8	USD	85,000	Pago un día después del vencimiento
Pagos por Operaciones de Opción	20/12/2024	Cliente 9	MXN	130,000	Pago un día después del vencimiento
Pagos por Operaciones de Opción	20/12/2024	Cliente 10	USD	(6,500)	Pago un día después del vencimiento
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	30/12/2024	Cliente 11	MXN	(811,256)	En espera de instrucción

## DESCRIBIR Y NUMERAR LOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS QUE HAYAN VENCIDO DURANTE EL TRIMESTRE

Cifras expresadas en pesos

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
C97837	13/12/2024	Active		mxn/usd	204,582,543	10,000,000	
C97838	13/12/2024	Active		usd/mxn	10,000,000	204,582,543	
SNK776	25/12/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNK777	26/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SNK767	25/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SNJ452	27/11/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNJ388	24/12/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNJ391	24/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SNJ380	24/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNJ379	24/12/2024	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SNJ355	29/10/2024	Active	275,000,000	mxn	275,000,000	275,000,000	
SNJ304	01/11/2024	Active	3,656,528	mxn	3,656,528	3,656,528	
SNJ145	01/11/2024	Active	3,656,528	mxn	3,656,528	3,656,528	
SNI778	20/12/2024	Active	3,430,000,000	mxn	3,430,000,000	3,430,000,000	
C96825	09/10/2024	Active		mxn/usd	184,801,173	9,500,000	
C96826	09/10/2024	Active		usd/mxn	9,500,000	184,801,173	
C96823	09/10/2024	Active		usd/mxn	1,200,000	23,343,306	
C96824	09/10/2024	Active		mxn/usd	23,343,306	1,200,000	
SNH991	16/12/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH838	16/12/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH753	13/12/2024	Active	4,200,000,000	mxn	4,200,000,000	4,200,000,000	
SNH629	13/12/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG734	10/12/2024	Active	1,700,000,000	mxn	1,700,000,000	1,700,000,000	
SNG053	04/12/2024	Active	4,400,000,000	mxn	4,400,000,000	4,400,000,000	
SNG047	04/12/2024	Active	2,640,000,000	mxn	2,640,000,000	2,640,000,000	
SNG044	04/12/2024	Active	4,400,000,000	mxn	4,400,000,000	4,400,000,000	
SNF818	03/12/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNE941	28/11/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNE942	28/11/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNE555	22/11/2024	Active	4,300,000,000	mxn	4,300,000,000	4,300,000,000	
SNE524	22/11/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SND443	26/11/2024	Active	20,000,000	usd	20,000,000	20,000,000	
SND247	23/10/2024	Active	150,000,000	usd	150,000,000	150,000,000	
SND228	23/11/2024	Active	100,000,000	usd	100,000,000	100,000,000	
SMX916	22/10/2024	Active	4,060,000,000	mxn	4,060,000,000	4,060,000,000	
SMX381	18/10/2024	Active	4,015,000,000	mxn	4,015,000,000	4,015,000,000	
SMX142	17/10/2024	Active	8,800,000,000	mxn	8,800,000,000	8,800,000,000	
SMX110	17/10/2024	Active	16,000,000,000	mxn	16,000,000,000	16,000,000,000	
SMV455	25/12/2024	Active	770,000,000	mxn	770,000,000	770,000,000	
SMV049	27/12/2024	Active	322,000,000	mxn	322,000,000	322,000,000	
SMV044	27/12/2024	Active	1,175,000,000	mxn	1,175,000,000	1,175,000,000	
SMV035	27/12/2024	Active	729,000,000	mxn	729,000,000	729,000,000	
SMV031	04/10/2024	Active	897,000,000	mxn	897,000,000	897,000,000	
SMV029	04/10/2024	Active	805,000,000	mxn	805,000,000	805,000,000	
SMV026	04/10/2024	Active	2,197,000,000	mxn	2,197,000,000	2,197,000,000	
SMU870	26/12/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMU558	25/12/2024	Active	770,000,000	mxn	770,000,000	770,000,000	
SMU539	25/12/2024	Active	1,970,000,000	mxn	1,970,000,000	1,970,000,000	
SMU317	01/10/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SMU186	23/12/2024	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	
SMT319	16/12/2024	Active	2,015,000,000	mxn	2,015,000,000	2,015,000,000	
SMT306	16/12/2024	Active	2,030,000,000	mxn	2,030,000,000	2,030,000,000	
SMT256	18/11/2024	Active	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	3,000,000,000	
SMT079	13/12/2024	Active	2,440,000,000	mxn	2,440,000,000	2,440,000,000	
SMT053	13/12/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMT023	18/10/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SM5181	10/12/2024	Active	1,990,000,000	mxn	1,990,000,000	1,990,000,000	
SMR782	06/12/2024	Active	850,000,000	mxn	850,000,000	850,000,000	
SMQ970	04/12/2024	Active	1,215,000,000	mxn	1,215,000,000	1,215,000,000	
SMQ964	04/12/2024	Active	1,020,000,000	mxn	1,020,000,000	1,020,000,000	
SMQ931	04/12/2024	Active	810,000,000	mxn	810,000,000	810,000,000	
SLP276	20/11/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SLP272	29/11/2024	Active	2,486,113,037	mxn	2,486,113,037	2,486,113,037	
SLJ343	01/11/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	



Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SLJ307	01/11/2024	Active	1,470,000,000	mxn	1,470,000,000	1,470,000,000	
SLJ107	31/10/2024	Active	1,855,000,000	mxn	1,855,000,000	1,855,000,000	
SLI966	31/10/2024	Active	1,845,000,000	mxn	1,845,000,000	1,845,000,000	
SLI073	25/10/2024	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	
SLI051	25/10/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SLI044	25/10/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SLI042	25/10/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SLI041	25/10/2024	Active	4,000,000,000	mxn	4,000,000,000	4,000,000,000	
SLI034	25/10/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SLI030	25/10/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SLI022	25/10/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SLH928	24/10/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SLH914	24/10/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
E95839	20/11/2024	Active		mxn			371,925,000
E95784	20/11/2024	Active		mxn			375,320,000
SLF932	14/10/2024	Active	1,900,000,000	mxn	1,900,000,000	1,900,000,000	
SLF732	11/10/2024	Active	3,050,000,000	mxn	3,050,000,000	3,050,000,000	
SLE541	27/12/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SLE337	27/12/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SLC762	20/12/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SLC449	19/12/2024	Active	825,000,000	mxn	825,000,000	825,000,000	
SLC441	19/12/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SLC043	18/12/2024	Active	730,000,000	mxn	730,000,000	730,000,000	
SLA239	04/12/2024	Active	620,000,000	mxn	620,000,000	620,000,000	
SLA230	04/12/2024	Active	1,245,000,000	mxn	1,245,000,000	1,245,000,000	
SKY997	27/11/2024	Active	505,000,000	mxn	505,000,000	505,000,000	
SKW370	13/11/2024	Active	1,270,000,000	mxn	1,270,000,000	1,270,000,000	
SKV646	08/11/2024	Active	770,000,000	mxn	770,000,000	770,000,000	
SKT881	30/10/2024	Active	167,600,000	mxn	167,600,000	167,600,000	
SKT882	30/10/2024	Active	167,600,000	mxn	167,600,000	167,600,000	
SKT197	24/10/2024	Active	770,000,000	mxn	770,000,000	770,000,000	
SKT177	24/10/2024	Active	770,000,000	mxn	770,000,000	770,000,000	
SKS905	23/10/2024	Active	1,280,000,000	mxn	1,280,000,000	1,280,000,000	
SKP639	15/10/2024	Active	1,280,000,000	mxn	1,280,000,000	1,280,000,000	
SKO317	27/11/2024	Active	4,798,275	usd	4,798,275	4,798,275	
SKO314	27/11/2024	Active	4,798,275	usd	4,798,275	4,798,275	
SKO101	03/10/2024	Active	1,280,000,000	mxn	1,280,000,000	1,280,000,000	
SKN990	03/10/2024	Active	1,290,000,000	mxn	1,290,000,000	1,290,000,000	
SKJ909	26/12/2024	Active	1,800,000,000	mxn	1,800,000,000	1,800,000,000	
SKJ380	13/12/2024	Active	3,500,155	usd	3,500,155	3,500,155	
SKJ379	13/12/2024	Active	3,500,155	usd	3,500,155	3,500,155	
SKJ316	19/12/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
C91267	13/12/2024	Active		mxn/usd	1,721,500,000	100,000,000	
C91213	13/12/2024	Active		usd/mxn	100,000,000	1,721,500,000	
M00199570	13/12/2024	Active		usd	100,000,000	100,000,000	
C91211	13/12/2024	Active		mxn/usd	1,721,500,000	100,000,000	
SKI623	16/12/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
C91208	13/12/2024	Active		usd/mxn	100,000,000	1,721,500,000	
SKH865	13/12/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SKH259	11/12/2024	Active	925,000,000	mxn	925,000,000	925,000,000	
SKG201	17/10/2024	Active	23,339,420	usd	23,339,420	23,339,420	
SKG193	01/11/2024	Active	9,498,562	usd	9,498,562	9,498,562	
SKG190	17/10/2024	Active	23,339,420	usd	23,339,420	23,339,420	
SKG188	01/11/2024	Active	9,498,562	usd	9,498,562	9,498,562	
SKE537	26/11/2024	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SKE531	26/11/2024	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SKE046	21/11/2024	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SKD894	20/11/2024	Active	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000	
SKD457	19/11/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SKC736	13/11/2024	Active	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	
SKC385	11/11/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SKC383	11/11/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SKC382	11/11/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SKB455	04/11/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SKB456	04/11/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SKA854	29/10/2024	Active	950,000,000	mxn	950,000,000	950,000,000	
SKA839	24/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SKA836	24/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SJZ896	23/10/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJZ645	22/10/2024	Active	1,910,000,000	mxn	1,910,000,000	1,910,000,000	
SJZ130	17/10/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SJZ132	17/10/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SJZ099	17/10/2024	Active	283,950,000	mxn	283,950,000	283,950,000	
SJZ101	17/10/2024	Active	283,950,000	mxn	283,950,000	283,950,000	
SJZ077	17/10/2024	Active	64,430,000	mxn	64,430,000	64,430,000	
SJZ078	17/10/2024	Active	64,430,000	mxn	64,430,000	64,430,000	
P19252	20/11/2024	Active		usd			68,793,103
P19251	20/11/2024	Active		usd			68,793,103
P19217	16/10/2024	Active		mxn			17,000,000

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
P19210	16/10/2024	Active		mxn			17,000,000
P19208	16/10/2024	Active		mxn			17,000,000
P19207	16/10/2024	Active		mxn			17,000,000
SJX859	09/10/2024	Active	665,000,000	mxn	665,000,000	665,000,000	
SJX240	03/10/2024	Active	650,000,000	mxn	650,000,000	650,000,000	
SJX218	03/10/2024	Active	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	
SJX219	03/10/2024	Active	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	
SJW377	03/10/2024	Active	18,891,249	usd	18,891,249	18,891,249	
SJW378	03/10/2024	Active	18,891,249	usd	18,891,249	18,891,249	
C89344	31/10/2024	Active		usd/mxn	20,403,864	359,108,006	
C89343	31/10/2024	Active		mxn/usd	359,108,006	20,403,864	
SJJ648	09/12/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJD760	17/10/2024	Active	1,828,549	usd	1,828,549	1,828,549	
SJD571	17/10/2024	Active	1,828,549	usd	1,828,549	1,828,549	
M00070733	22/11/2024	Active		mxn		115,000,000	
SJB058	22/11/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SJB055	22/11/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SJB054	22/11/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SIP777	22/11/2024	Active	9,237,597	usd	9,237,597	9,237,597	
SIP762	22/11/2024	Active	9,237,597	usd	9,237,597	9,237,597	
SIP273	02/10/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
P18883	04/12/2024	Active		mxn			12,241,430
P18882	04/12/2024	Active		mxn			12,241,430
SIB311	15/11/2024	Active	2,772,487	mxn	2,772,487	2,772,487	
SHW849	16/12/2024	Active	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SHS954	19/12/2024	Active	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SHS883	18/12/2024	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SHS809	29/11/2024	Active	4,500,000	mxn	4,500,000	4,500,000	
SHS799	29/11/2024	Active	4,500,000	mxn	4,500,000	4,500,000	
SHS421	16/12/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SHS420	16/12/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SHS404	13/12/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHS015	11/12/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHS014	11/12/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHR638	06/12/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SHR050	02/12/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHR049	02/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHQ885	01/12/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHQ883	02/12/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SHQ882	02/12/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SHQ710	29/11/2024	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SHQ418	29/11/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SHQ405	29/11/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SHQ366	29/11/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHQ365	29/11/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
MYF813	29/11/2024	Active		mxn		250,000,000	
SHQ364	29/11/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
MYF804	29/11/2024	Active		mxn		750,000,000	
SHQ359	29/11/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHQ028	24/11/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHP374	15/11/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHP296	17/11/2024	Active	197,349,980	mxn	197,349,980	197,349,980	
SHP295	17/11/2024	Active	197,349,980	mxn	197,349,980	197,349,980	
SHO826	15/11/2024	Active	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SHO827	15/11/2024	Active	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SHO579	12/11/2024	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SHO332	11/11/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHO120	07/11/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SHO078	09/11/2024	Active	1,263,651	mxn	1,263,651	1,263,651	
SHO076	08/11/2024	Active	34,816,715	mxn	34,816,715	34,816,715	
SHO072	09/11/2024	Active	1,263,651	mxn	1,263,651	1,263,651	
SHO070	08/11/2024	Active	34,816,715	mxn	34,816,715	34,816,715	
SHN885	06/11/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHN719	05/11/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHN358	01/11/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHN349	01/11/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHN335	01/11/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHM743	31/10/2024	Active	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SHM744	31/10/2024	Active	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SHM243	25/10/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SHM240	25/10/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SHL936	25/10/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
MXK216	25/10/2024	Active		mxn		750,000,000	
SHL918	25/10/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SHL891	25/10/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SHL834	21/10/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHL832	21/10/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHL833	21/10/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHL812	21/10/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SHL620	18/10/2024	Active	570,000,000	mxn	570,000,000	570,000,000	
SHK030	03/10/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHJ915	06/10/2024	Active	35,500,000	usd	35,500,000	35,500,000	
SHJ771	02/10/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHJ709	06/10/2024	Active	35,500,000	usd	35,500,000	35,500,000	
SHJ325	24/10/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
E81348	20/11/2024	Active		mxn			395,020,000
E81349	20/11/2024	Active		mxn			384,810,000
P18157	21/12/2024	Active		mxn			150,000,000
P18156	21/12/2024	Active		mxn			150,000,000
P18011	31/12/2024	Active		mxn			31,000,000
P18007	31/12/2024	Active		mxn			31,000,000
MUO601	17/12/2024	Active		usd		4,171,304	
SGU753	17/12/2024	Active	4,171,304	usd	4,171,304	4,171,304	
SGU750	17/12/2024	Active	4,171,304	usd	4,171,304	4,171,304	
SGQ551	06/12/2024	Active	4,702,381	usd	4,702,381	4,702,381	
SGQ480	06/12/2024	Active	4,702,381	usd	4,702,381	4,702,381	
MUC603	06/12/2024	Active		usd			4,702,381
SGQ455	06/12/2024	Active	4,702,381	usd	4,702,381	4,702,381	
P17722	27/12/2024	Active		mxn			9,130,764
P17721	27/12/2024	Active		mxn			9,130,764
SFU228	10/12/2024	Active	11,335,327	mxn	11,335,327	11,335,327	
SFU196	10/12/2024	Active	11,335,327	mxn	11,335,327	11,335,327	
SFT531	31/10/2024	Active	28,000,000	mxn	28,000,000	28,000,000	
SFT485	31/10/2024	Active	28,000,000	mxn	28,000,000	28,000,000	
P17627	02/12/2024	Active		mxn			2,500,000
P17626	02/12/2024	Active		mxn			2,500,000
SFF749	11/11/2024	Active	4,360,752	mxn	4,360,752	4,360,752	
SFF720	11/11/2024	Active	4,360,752	mxn	4,360,752	4,360,752	
SFF717	11/12/2024	Active	155,000,000	mxn	155,000,000	155,000,000	
P17612	30/11/2024	Active		mxn			76,485,721
P17611	30/11/2024	Active		mxn			76,485,721
SFD210	29/11/2024	Active	4,882,740	mxn	4,882,740	4,882,740	
SFD194	29/11/2024	Active	4,882,740	mxn	4,882,740	4,882,740	
SFC657	10/10/2024	Active	8,664,499	mxn	8,664,499	8,664,499	
SFC220	10/10/2024	Active	8,664,499	mxn	8,664,499	8,664,499	
P17573	21/11/2024	Active		mxn			250,000,000
P17572	21/11/2024	Active		mxn			250,000,000
SFB254	15/11/2024	Active	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SEY777	31/10/2024	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SEY741	31/10/2024	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SEW798	16/10/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SEW799	16/10/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SEW283	10/10/2024	Active	5,796,568	mxn	5,796,568	5,796,568	
SEW265	10/10/2024	Active	5,796,568	mxn	5,796,568	5,796,568	
SEW032	10/10/2024	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SEV800	16/10/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SEV798	16/10/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SEQ838	15/11/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SEQ837	15/11/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SEJ396	20/12/2024	Active	1,365,000	mxn	1,365,000	1,365,000	
SEJ347	20/12/2024	Active	1,365,000	mxn	1,365,000	1,365,000	
SDX125	22/11/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX048	20/11/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
P17108	06/12/2024	Active		mxn			400,000,000
P17109	06/12/2024	Active		mxn			400,000,000
SDW815	13/11/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW724	07/11/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW608	01/11/2024	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SDW564	30/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW553	30/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW554	31/12/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW523	31/12/2024	Active	480,000,000	mxn	480,000,000	480,000,000	
SDW512	30/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW488	30/10/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
P17008	21/12/2024	Active		mxn			150,000,000
P17007	21/12/2024	Active		mxn			150,000,000
SDW466	30/10/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW444	31/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW419	28/10/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW388	31/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW381	25/10/2024	Active	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDW371	30/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW372	24/10/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDW246	27/12/2024	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SDW249	17/10/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW208	27/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW173	27/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW132	27/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDW148	19/11/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW095	14/10/2024	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SDW122	15/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW073	26/12/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW040	26/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW013	26/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV954	26/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV926	11/10/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV931	26/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV945	11/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV741	17/12/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV711	09/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV577	13/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV505	13/12/2024	Active	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	
SDV453	04/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV460	11/12/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV433	11/12/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV417	04/10/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV367	31/10/2024	Active	72,532,000	mxn	72,532,000	72,532,000	
SDV368	31/10/2024	Active	28,468,000	mxn	28,468,000	28,468,000	
SDV370	09/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV380	04/10/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV383	31/10/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV315	06/12/2024	Active	14,000,000	mxn	14,000,000	14,000,000	
SDV335	31/10/2024	Active	72,532,000	mxn	72,532,000	72,532,000	
SDV336	31/10/2024	Active	28,468,000	mxn	28,468,000	28,468,000	
SDV339	03/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV351	31/10/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV279	06/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV266	03/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV229	06/12/2024	Active	14,000,000	mxn	14,000,000	14,000,000	
SDV186	02/10/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SDV049	31/10/2024	Active	20,600,000	mxn	20,600,000	20,600,000	
SDV010	05/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV015	31/12/2024	Active	1,206,895	mxn	1,206,895	1,206,895	
SDV033	31/12/2024	Active	1,206,895	mxn	1,206,895	1,206,895	
SDV039	31/10/2024	Active	20,600,000	mxn	20,600,000	20,600,000	
SDU912	05/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU919	31/12/2024	Active	838,013	mxn	838,013	838,013	
SDU929	31/12/2024	Active	838,013	mxn	838,013	838,013	
SDU807	31/12/2024	Active	2,335,186	mxn	2,335,186	2,335,186	
SDU845	04/12/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU777	31/12/2024	Active	2,335,186	mxn	2,335,186	2,335,186	
SDU783	31/12/2024	Active	2,811,370	mxn	2,811,370	2,811,370	
SDU721	31/12/2024	Active	2,811,370	mxn	2,811,370	2,811,370	
SDU267	03/12/2024	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SDU107	02/12/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU108	17/10/2024	Active	7,844,828	mxn	7,844,828	7,844,828	
SDU129	17/10/2024	Active	7,844,828	mxn	7,844,828	7,844,828	
SDU134	07/11/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU152	03/12/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU069	28/11/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDT991	28/11/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDT912	28/11/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT933	28/11/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDT859	28/11/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT860	20/12/2024	Active	1,365,000	mxn	1,365,000	1,365,000	
SDT865	20/12/2024	Active	7,380,000	mxn	7,380,000	7,380,000	
SDT778	20/12/2024	Active	1,365,000	mxn	1,365,000	1,365,000	
SDT780	20/12/2024	Active	7,380,000	mxn	7,380,000	7,380,000	
SDT786	27/11/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT662	27/12/2024	Active	1,048,667	mxn	1,048,667	1,048,667	
SDT667	27/12/2024	Active	1,048,667	mxn	1,048,667	1,048,667	
SDT674	27/12/2024	Active	1,048,667	mxn	1,048,667	1,048,667	
SDT695	27/12/2024	Active	1,048,667	mxn	1,048,667	1,048,667	
SDT701	25/11/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDT610	25/11/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT625	17/12/2024	Active	1,678,696	usd	1,678,696	1,678,696	
SDT638	17/12/2024	Active	1,678,696	usd	1,678,696	1,678,696	
SDT568	10/10/2024	Active	8,954,496	mxn	8,954,496	8,954,496	
SDT582	24/12/2024	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SDT592	24/12/2024	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SDT473	17/10/2024	Active	8,669,092	mxn	8,669,092	8,669,092	
SDT495	10/10/2024	Active	8,954,496	mxn	8,954,496	8,954,496	
SDT499	17/10/2024	Active	8,669,092	mxn	8,669,092	8,669,092	
SDT427	16/10/2024	Active	7,850,000	mxn	7,850,000	7,850,000	
SDT430	17/12/2024	Active	4,171,304	usd	4,171,304	4,171,304	
SDT436	16/10/2024	Active	7,850,000	mxn	7,850,000	7,850,000	
SDT437	18/12/2024	Active	25,000,000	mxn	25,000,000	25,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDT349	29/11/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT359	29/11/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT188	29/11/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDT201	29/11/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDT159	21/11/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDT169	21/11/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDT098	20/11/2024	Active	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	
SDT099	20/11/2024	Active	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	
SDT066	08/11/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDS919	14/11/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDS931	15/11/2024	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SDS894	14/11/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDS906	08/11/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDS729	31/10/2024	Active	25,000,000	mxn	25,000,000	25,000,000	
SDS699	25/11/2024	Active	15,214,611	mxn	15,214,611	15,214,611	
SDS708	31/10/2024	Active	25,000,000	mxn	25,000,000	25,000,000	
SDS639	25/11/2024	Active	15,214,611	mxn	15,214,611	15,214,611	
SDS648	13/12/2024	Active	12,500,000	mxn	12,500,000	12,500,000	
SDS671	13/12/2024	Active	12,500,000	mxn	12,500,000	12,500,000	
SDS675	24/10/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS627	17/12/2024	Active	150,000	usd	150,000	150,000	
SDS633	25/11/2024	Active	40,285,356	mxn	40,285,356	40,285,356	
SDS636	25/11/2024	Active	40,285,356	mxn	40,285,356	40,285,356	
SDS590	17/12/2024	Active	150,000	usd	150,000	150,000	
SDS506	22/10/2024	Active	10,133,000	mxn	10,133,000	10,133,000	
SDS512	22/10/2024	Active	10,133,000	mxn	10,133,000	10,133,000	
SDS452	17/10/2024	Active	12,550,000	mxn	12,550,000	12,550,000	
SDS455	17/10/2024	Active	12,550,000	mxn	12,550,000	12,550,000	
SDS409	04/10/2024	Active	18,822,000	mxn	18,822,000	18,822,000	
SDS412	31/10/2024	Active	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	
SDS416	04/10/2024	Active	18,822,000	mxn	18,822,000	18,822,000	
SDS369	28/10/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDS385	31/10/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDS391	31/10/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDS124	21/10/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDS068	16/10/2024	Active	12,150,000	mxn	12,150,000	12,150,000	
SDS075	16/10/2024	Active	12,150,000	mxn	12,150,000	12,150,000	
SDS086	20/10/2024	Active	33,430,806	mxn	33,430,806	33,430,806	
SDS089	20/10/2024	Active	33,430,806	mxn	33,430,806	33,430,806	
SDQ865	05/11/2024	Active	18,800,000	usd	18,800,000	18,800,000	

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108626	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108627	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108628	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108629	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108650	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108651	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108652	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108653	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2109150	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109151	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109152	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109153	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109154	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109155	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109168	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109169	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109170	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109171	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109172	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109173	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109460	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109461	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109462	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109463	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2109464	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109465	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109466	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109467	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2109468	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109469	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109470	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109471	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2109484	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109485	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109486	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109487	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2109488	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109489	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109490	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109491	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2109492	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109493	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109494	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109495	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2110130	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110131	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110132	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110133	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110134	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110135	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110136	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110137	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110138	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110139	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110140	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110141	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110142	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110143	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110144	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110145	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110146	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110147	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110148	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110149	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110150	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110151	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110152	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110153	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110154	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110155	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110156	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110157	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110158	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110159	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110160	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110161	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110162	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110163	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110164	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110165	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110166	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110167	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110168	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110169	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110170	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110171	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110172	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110173	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110322	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110323	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110324	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110325	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110326	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110327	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110328	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110329	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110330	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110331	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110332	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110333	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110334	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110335	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110336	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110337	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110338	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110339	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110340	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110341	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110342	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110343	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110344	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110345	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110346	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110347	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110348	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110349	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110350	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110351	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110352	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110353	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110354	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110355	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110356	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110357	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110358	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110359	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110360	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110361	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110362	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110363	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110364	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110365	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,676
2110800	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110801	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110802	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110803	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110804	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110805	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110806	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110807	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110808	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110809	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110810	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110811	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110812	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110813	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110814	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110815	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110816	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110817	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110818	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110819	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110820	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110821	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110822	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110823	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110824	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110825	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110826	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110827	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110828	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110829	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110830	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110831	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110832	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110833	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110834	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110835	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110839	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110840	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110841	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110842	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110843	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110844	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110845	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110846	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110847	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110848	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110849	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110850	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110851	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110852	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110853	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110854	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110855	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110856	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110857	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110858	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110859	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110860	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110861	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110862	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110863	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110864	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110865	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110866	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110867	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110868	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110869	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110870	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110871	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110872	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110873	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110874	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110878	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110879	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110880	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110881	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110882	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110883	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110884	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110885	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110886	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110887	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110888	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110889	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110890	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110891	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110892	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110893	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110894	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110895	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110896	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110897	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110898	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110899	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110900	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110901	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110902	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110903	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110904	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110905	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110906	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110907	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110908	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110909	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110910	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110911	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110912	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110913	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110917	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110918	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110919	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110920	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110921	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110922	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110923	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110924	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110925	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110926	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110927	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110928	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110929	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110930	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110931	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110932	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110933	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110934	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110935	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110936	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110937	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110938	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110939	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110940	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110941	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110942	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110943	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110944	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110945	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110946	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110947	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110948	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110949	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110950	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2110951	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2110952	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111732	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2111733	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2111734	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2111735	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2111740	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2111741	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2111742	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2111743	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2113477	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113478	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113479	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113480	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113481	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113482	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113483	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113484	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113485	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113486	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113487	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113488	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113489	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113490	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113491	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113492	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113493	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113494	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113495	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113496	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113497	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113498	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113499	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113500	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113501	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113502	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113503	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113504	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113505	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113506	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113507	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113508	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113509	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113510	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113511	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113512	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2113513	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113514	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113515	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113516	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113517	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113518	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113519	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113520	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113521	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113722	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113723	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113724	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113725	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113726	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113727	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113728	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113729	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113730	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113731	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113732	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113733	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113734	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113735	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113736	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113737	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113738	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113739	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113740	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113741	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113742	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113743	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113744	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113745	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113746	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113747	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113748	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113749	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113750	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113751	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113752	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113753	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113754	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113755	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113756	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113757	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113758	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113759	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113760	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113761	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113762	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113763	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113764	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113765	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113766	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2115193	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115194	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115195	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115196	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115197	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115198	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115199	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115200	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115201	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115202	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115203	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115204	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115205	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115206	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115207	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115208	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115209	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115210	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115211	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115212	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115213	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115214	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115215	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115216	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115217	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115218	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115219	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115220	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115221	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115222	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115223	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115224	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115225	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115226	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115227	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115228	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115229	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115230	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115231	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115232	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115233	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115234	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115235	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115236	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115237	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115438	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115439	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115440	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115441	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115442	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115443	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115444	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115445	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115446	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115447	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115448	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115449	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115450	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115451	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115452	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115453	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115454	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115455	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115456	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115457	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115458	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115459	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115460	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115461	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115462	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115463	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115464	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115465	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115466	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115467	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115468	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115469	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115470	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115471	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115472	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115473	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115474	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115475	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115476	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115477	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115478	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115479	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115480	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115481	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115482	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115840	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115841	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115842	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115843	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115844	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115845	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115846	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115847	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115848	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115849	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,577
2115850	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115851	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115852	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115853	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115854	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,577
2115960	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115961	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115962	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115963	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115964	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115965	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115966	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115967	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115968	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115969	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,577
2115970	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115971	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115972	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115973	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115974	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,577
2116177	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116178	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116179	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116180	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116181	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116182	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116183	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116184	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116185	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116186	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116187	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116188	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116189	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116190	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116191	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116192	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116193	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116194	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116195	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116196	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116197	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116198	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116199	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116200	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116201	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116202	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116203	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116324	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116325	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116326	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116327	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116328	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116329	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116330	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116331	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116332	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116333	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116334	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116335	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116336	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116337	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116338	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116339	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116340	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116341	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116342	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116343	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116344	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116345	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116346	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116347	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116348	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116349	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116350	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116513	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,800,000
2116514	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,600,000
2116515	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,100,000
2116518	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,800,000
2116519	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,600,000
2116520	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,100,000
2117321	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117322	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117323	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117324	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117325	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117326	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117327	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117328	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117329	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117330	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117331	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117332	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117333	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117334	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117335	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117336	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117337	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117338	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117339	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117340	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117341	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117342	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117343	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117344	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117345	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117346	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117347	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117348	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117349	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117350	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117351	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117352	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117353	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117354	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117355	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117356	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117357	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117358	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117359	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117360	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117361	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117362	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117363	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117364	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117365	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117366	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117367	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117368	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117369	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117370	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117371	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117372	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117373	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117374	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117375	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117376	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117377	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117378	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117379	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117380	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117381	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117382	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117383	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117384	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117385	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117571	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117572	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117573	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117574	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117575	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117576	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117577	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117578	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117579	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117580	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117581	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117582	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117583	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117584	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117585	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117586	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117587	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117588	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117589	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117590	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117591	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117592	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117593	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117594	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117595	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117596	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117597	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117598	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117599	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117600	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117601	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117602	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117603	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117604	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117605	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117606	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117607	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117608	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117609	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117610	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117611	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117612	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117613	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117614	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117615	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117616	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117617	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117618	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117619	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117620	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117621	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117622	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117623	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117624	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117625	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117626	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117627	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117628	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117629	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117630	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117631	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117632	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117633	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117634	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117635	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117784	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117785	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117786	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117787	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117788	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117789	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117790	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117791	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117792	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117793	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117794	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117795	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117796	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117797	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117798	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117799	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117800	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117801	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117802	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117803	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117804	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117805	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117806	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117807	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117808	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117809	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117810	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117811	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117812	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117813	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117814	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117815	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117816	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117817	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117818	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117819	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117820	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117821	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117822	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117823	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117824	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117825	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117826	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117827	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117828	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117829	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117830	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117831	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117832	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117833	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117834	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117835	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117984	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117985	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117986	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117987	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117988	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117989	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117990	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117991	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117992	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117993	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117994	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117995	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117996	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117997	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117998	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117999	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118000	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118001	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118002	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118003	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118004	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118005	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118006	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118007	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118008	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118009	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118010	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118011	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118012	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118013	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118014	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118015	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118016	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118017	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118018	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118019	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118020	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118021	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118022	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118023	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118024	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118025	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118026	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118027	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118028	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118029	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118030	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118031	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118032	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118033	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118034	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118035	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118041	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,302
2118042	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2118043	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118044	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118045	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,883
2118046	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,302
2118047	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2118048	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118049	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118050	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,883
2118051	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,302
2118052	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2118053	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118054	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118055	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,883
2118061	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,302
2118062	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2118063	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118064	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118065	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,883
2118066	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,302
2118067	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2118068	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118069	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118070	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,883
2118071	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,302
2118072	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2118073	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118074	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118075	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,883
2118341	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118342	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118343	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118344	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118345	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118346	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118347	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118348	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118349	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118350	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118351	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118352	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118353	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118354	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118355	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118356	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118357	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118358	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118359	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118360	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118361	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118362	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118363	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118364	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118365	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118366	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118367	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118368	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118369	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118370	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118371	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118372	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118373	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118374	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118375	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118376	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118377	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118378	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118379	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118380	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118381	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118382	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118383	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118384	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118385	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118386	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118387	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118388	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118389	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118390	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118391	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118392	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118537	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118538	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118539	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118540	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118541	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118542	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118543	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118544	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118545	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118546	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118547	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118548	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118549	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118550	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118551	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118552	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118553	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118554	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118555	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118556	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118557	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118558	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118559	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118560	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118561	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118562	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118563	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118564	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118565	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118566	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118567	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118568	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118569	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118570	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118571	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118572	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118573	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118574	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118575	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118576	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118577	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118578	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118579	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118580	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118581	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118582	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118583	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118584	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118585	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118586	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118587	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118588	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118597	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2118598	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2118599	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2118600	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2118601	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2118602	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2118603	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2118604	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2118613	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2118614	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2118615	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2118616	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2118617	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2118618	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2118619	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2118620	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2118637	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,000,000
2118654	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118655	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118656	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118657	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118658	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118659	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118676	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118677	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118678	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118679	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118680	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118681	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118722	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118723	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118724	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118725	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118726	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,368
2118727	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118728	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118729	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118730	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118731	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,368
2118732	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118733	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118734	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118735	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118736	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,368
2118777	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118778	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118779	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118780	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118781	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,368
2118782	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118783	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118784	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118785	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118786	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,368
2118787	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118788	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118789	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118790	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118791	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,368
2118832	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,464
2118833	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2118834	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118835	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118836	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	24,844
2118887	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,464
2118888	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2118889	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118890	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118891	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	24,844
2119034	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119035	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119036	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119037	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119038	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119039	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119040	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119041	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119042	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119043	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119044	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119045	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119046	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119047	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119048	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119049	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119050	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119051	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119052	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119053	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119054	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119055	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119056	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119057	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119058	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119059	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119060	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119061	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119062	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119063	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119064	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119065	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119066	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119067	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119068	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119069	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119202	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119203	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119204	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119205	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119206	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119207	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119208	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119209	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119210	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119211	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119212	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119213	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119214	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119215	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119216	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119217	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119218	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119219	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119220	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119221	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119222	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119223	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119224	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119225	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119226	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119227	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119228	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119229	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119230	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119231	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119232	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119233	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119234	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119235	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119236	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119237	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119376	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119377	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119378	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119379	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119380	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119381	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119420	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119421	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119422	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119423	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119424	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119425	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119633	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119634	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119635	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119636	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119637	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119638	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119639	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119640	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119641	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119642	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119643	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119644	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119645	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119646	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119647	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119648	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119649	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119650	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119651	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119652	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119653	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119654	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119655	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119656	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119657	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119658	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119659	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119660	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119661	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119662	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119663	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119664	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119665	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119666	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119667	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119668	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119669	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119670	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119671	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119672	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119673	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119674	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119675	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119676	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119677	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119678	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119679	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119680	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119681	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119682	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119683	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119684	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119685	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119686	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119687	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119688	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119689	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119690	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119691	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119692	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119693	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119694	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119695	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119696	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119697	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119698	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119699	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119700	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119701	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119702	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119893	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119894	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119895	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119896	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119897	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119898	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119899	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119900	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119901	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119902	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119903	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119904	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119905	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119906	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119907	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119908	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119909	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119910	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119911	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119912	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119913	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119914	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119915	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119916	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119917	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119918	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119919	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119920	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119921	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119922	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119923	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119924	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119925	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119926	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119927	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119928	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119929	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119930	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119931	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119932	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119933	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119934	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119935	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119936	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119937	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119938	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119939	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119940	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119941	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119942	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119943	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119944	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119945	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119946	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119947	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119948	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119949	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119950	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119951	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119952	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119953	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119954	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119955	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119956	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119957	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119958	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119959	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119960	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119961	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119962	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2120153	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120154	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120155	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120156	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120157	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120158	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120159	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120160	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120161	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120162	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120163	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120164	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120165	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120166	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120167	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120168	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120169	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120170	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120171	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120172	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120173	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120174	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120175	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120176	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120177	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120178	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120179	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120180	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120181	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120182	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120183	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120184	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120185	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120186	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120187	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120188	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120189	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120190	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120191	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120192	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120193	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120194	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120195	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120196	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120197	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120198	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,512
2120199	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120200	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120201	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	175,000
2120202	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,853
2120203	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,512
2120204	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120205	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120206	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	175,000
2120207	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,853
2120208	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,512
2120209	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120210	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120211	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	175,000
2120212	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,853
2120213	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,512
2120214	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120215	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120216	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	175,000
2120217	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,853
2120373	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120374	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120375	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120376	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120377	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120378	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120379	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120380	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120381	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120382	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120383	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120384	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120385	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120386	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120387	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120388	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120389	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120390	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120391	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120392	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120393	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120394	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120395	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120396	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120397	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120398	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120399	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120400	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120401	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120402	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120403	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120404	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120405	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120406	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120407	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120408	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120409	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120410	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120411	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120412	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120413	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120414	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120415	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120416	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120417	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120418	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,512
2120419	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120420	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120421	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	175,000
2120422	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,853
2120423	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,512
2120424	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120425	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120426	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	175,000
2120427	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,853
2120428	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,512
2120429	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120430	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120431	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	175,000
2120432	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,853
2120433	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,512
2120434	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120435	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	175,000
2120436	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	175,000
2120437	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,853
2120523	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120524	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120525	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120526	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120527	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120528	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120529	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120530	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120531	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120532	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120533	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120534	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120535	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120536	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120537	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120573	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120574	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120575	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120576	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120577	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120578	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120579	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120580	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120581	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120582	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120583	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120584	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120585	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120586	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120587	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2121248	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121249	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121250	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121251	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121252	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121253	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121254	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121255	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121256	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121257	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121258	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121259	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121260	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121261	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121262	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121263	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121264	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121265	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121266	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121267	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121268	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121269	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121270	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121271	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121272	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121273	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121274	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121275	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121276	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121277	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121278	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121279	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121280	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121281	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121282	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121283	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121284	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121285	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121286	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121287	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121288	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121289	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121290	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121291	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121292	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121293	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121294	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121295	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121296	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121297	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121298	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121299	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121300	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121301	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121302	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121303	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121304	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121305	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121306	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121307	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121423	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121424	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121425	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121426	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121427	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121428	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121429	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121430	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121431	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121432	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121433	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121434	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121435	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121436	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121437	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121438	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121439	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121440	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121441	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121442	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121443	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121444	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121445	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121446	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121447	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121448	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121449	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121450	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121451	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121452	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121453	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121454	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121455	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121456	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121457	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121458	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121459	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121460	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121461	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121462	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121463	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121464	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121465	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121466	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121467	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121468	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121469	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121470	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121471	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121472	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121473	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121474	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121475	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121476	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121477	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121478	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121479	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121480	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121481	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121482	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121786	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121787	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121788	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121789	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,213
2121790	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121791	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121792	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121793	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,749
2121814	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121815	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121816	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121817	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,213
2121818	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121819	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121820	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121821	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,749
2121833	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121834	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2121835	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121836	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121837	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2121838	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121842	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121843	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2121844	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121845	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121846	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2121847	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121854	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121855	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121856	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121857	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121864	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121865	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121866	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121867	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122013	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	17,345,008
2122014	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	17,345,008
2122035	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122036	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122037	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122038	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122039	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122040	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122041	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122042	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122043	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122044	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122045	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122046	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122047	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2122048	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122049	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122080	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122081	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122082	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122083	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122084	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122085	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122086	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122087	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122088	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122089	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122090	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122091	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122092	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122093	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122094	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122105	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	17,345,008
2122106	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	17,345,008
2122144	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122145	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122146	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122148	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122149	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122150	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122152	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122153	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122154	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122156	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122157	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122158	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122196	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122197	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122198	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122200	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122201	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122202	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122204	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122205	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122206	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122208	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122209	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122210	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122324	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,113
2122325	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,113
2122326	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,113
2122327	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,113
2122350	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,113
2122351	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,113
2122352	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,113
2122353	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,113
2122793	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122794	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122795	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122796	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122797	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122798	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122799	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122800	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122801	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122802	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122803	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122804	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122805	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2122806	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122807	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122808	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122809	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122810	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122811	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122812	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122813	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122814	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122815	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122816	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122817	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122818	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122819	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122820	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122821	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122822	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122823	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122824	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122825	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122826	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122827	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122828	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122844	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122845	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122846	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122847	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122848	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122849	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122850	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122851	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122852	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122853	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122854	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122855	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122856	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122857	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122858	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122859	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122860	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122861	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122862	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122863	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122864	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122865	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122866	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122867	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122868	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122869	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122870	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122871	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122872	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122873	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122874	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122875	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122876	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122877	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122878	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122879	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122893	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122894	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122895	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122896	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122897	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2122898	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122899	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122900	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122901	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122902	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122903	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122904	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122906	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122907	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122908	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122909	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122910	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122911	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122912	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122913	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122914	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122915	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122916	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2122917	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2123556	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2123557	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2123558	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2123559	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,111
2123560	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2123561	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2123562	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2123563	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,111
2123696	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123697	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123698	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123699	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123700	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123701	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123702	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123703	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123704	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123705	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123706	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123707	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123708	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123709	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123710	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123711	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123712	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123713	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123714	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123715	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123716	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123717	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123718	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123719	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123771	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123772	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123773	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123774	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123775	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123776	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123777	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123778	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123779	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123780	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123781	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123782	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123783	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2123784	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123785	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123786	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123787	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123788	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123789	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123790	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123791	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123792	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123793	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123794	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123823	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123824	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123825	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123826	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123827	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123828	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123829	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123830	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123831	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123832	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123833	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123834	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123855	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123856	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123857	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123858	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123859	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123860	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123861	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123862	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123863	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123864	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123865	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123866	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123988	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2123989	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2123990	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2123991	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2123992	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2123993	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124006	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124007	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124008	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124009	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124010	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124011	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124024	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124025	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124026	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124027	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124028	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124029	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124042	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124043	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124044	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124045	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124046	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124047	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124060	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2124061	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2124062	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2124063	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2124064	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2124065	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2124076	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124077	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124078	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124079	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124080	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124081	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124082	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124083	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124084	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124085	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124086	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124087	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124088	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124089	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2124090	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124091	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124092	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2124093	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124094	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124095	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2124096	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124097	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124098	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2124099	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124100	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124101	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124102	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124103	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124104	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124105	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124106	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124107	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124108	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124109	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124110	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124111	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124112	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124113	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124114	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124115	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124116	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124117	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124118	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124119	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124120	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124121	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124122	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124123	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124124	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,000,000
2124395	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124396	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124397	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124398	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124399	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124400	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124401	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124402	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124403	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124404	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124405	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124406	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124407	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124408	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2124409	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124410	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124411	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124412	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124413	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124414	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124415	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124416	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124417	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124418	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124449	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,283
2124450	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2124451	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124452	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124453	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,283
2124454	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2124455	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124456	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124457	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,283
2124458	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2124459	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124460	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124497	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,283
2124498	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2124499	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124500	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124501	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,283
2124502	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2124503	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124504	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124505	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,283
2124506	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2124507	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124508	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124565	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	45,000
2124566	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	45,000
2124567	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	45,000
2124568	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	45,000
2124575	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	45,000
2124576	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	45,000
2124577	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	45,000
2124578	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	45,000
2124707	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124708	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124709	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124710	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124711	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124712	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124713	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124714	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124715	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124716	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124717	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124718	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124719	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124720	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124721	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124722	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124857	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,254,654
2124858	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,254,654
2124859	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,013,047
2124860	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,013,047
2124861	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,004,326
2124862	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,004,326

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2124881	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,254,654
2124882	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,254,654
2124883	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,013,047
2124884	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,013,047
2124885	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,004,326
2124886	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,004,326
2124905	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,254,654
2124906	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,254,654
2124907	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,013,047
2124908	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,013,047
2124909	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,004,326
2124910	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,004,326
2124929	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,254,654
2124930	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,254,654
2124931	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,013,047
2124932	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,013,047
2124933	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,004,326
2124934	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,004,326
2124935	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2124936	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2124937	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2124938	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2124939	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2124940	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2124947	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2124948	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2124949	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2124950	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2124951	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2124952	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2124959	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124960	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124961	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124962	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,336
2124963	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124964	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124965	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124966	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,336
2124971	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124972	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124973	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124974	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124975	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124976	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124977	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124978	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124979	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124980	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124981	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124982	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124987	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124988	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124989	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124990	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124991	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124992	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124993	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124994	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124995	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124996	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124997	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124998	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2125005	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125006	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2125007	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125008	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125009	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125010	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125017	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125018	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125019	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125020	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125021	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125022	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125041	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,254,654
2125042	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,254,654
2125043	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,013,047
2125044	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,013,047
2125045	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,004,326
2125046	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,004,326
2125065	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,254,654
2125066	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,254,654
2125067	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,013,047
2125068	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,013,047
2125069	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,004,326
2125070	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,004,326
2125111	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125112	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125113	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125114	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125115	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125116	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125135	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125136	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125137	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125138	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125139	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125140	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125169	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125170	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125171	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125172	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125173	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125174	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125175	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125176	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125177	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125178	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125179	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125180	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125217	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125218	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125219	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125220	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125221	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125222	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125223	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125224	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125225	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125226	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125227	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125228	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125306	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125307	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125308	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125309	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125310	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125311	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2125312	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125313	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125314	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125315	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125316	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125317	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125334	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125335	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125336	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125337	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125338	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125339	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125340	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125341	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125342	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125343	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125344	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125345	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125350	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125351	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2125352	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125353	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2125354	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125355	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2125356	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125357	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2125481	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	1,600,000
2125482	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	1,600,000
2125489	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125490	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125491	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125492	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125493	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125494	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125501	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125502	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125503	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125504	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125505	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125506	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125517	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125518	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125519	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125520	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125521	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125522	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125523	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125524	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125525	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125526	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125527	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125528	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125529	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125530	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125531	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125532	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125533	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125534	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125535	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125536	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125537	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125538	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125539	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125540	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2125581	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125582	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125583	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125584	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125585	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125586	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125587	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125588	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125589	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125590	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125591	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125592	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125593	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125594	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125595	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125596	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125597	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125598	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125599	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125600	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125601	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125602	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125603	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125604	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125611	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125612	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125613	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125614	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125621	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125622	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125623	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125624	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125631	FX	oct-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125632	FX	oct-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125633	FX	nov-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125634	FX	nov-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125641	FX	oct-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125642	FX	oct-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125643	FX	nov-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125644	FX	nov-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125673	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125674	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125675	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125676	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125677	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125678	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2125679	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125680	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2125681	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125682	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2125683	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125684	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2125721	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125722	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125723	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125724	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125725	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125726	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2125727	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125728	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2125729	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125730	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2125731	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125732	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2125757	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125758	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125759	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125760	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125761	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125762	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125763	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125764	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125765	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125766	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125767	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125768	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125796	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2125797	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125798	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125799	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2125800	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125801	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2125802	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2125803	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125804	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2125832	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125833	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2125834	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125835	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125836	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2125837	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125838	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125839	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2125840	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125847	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000
2125848	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125849	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000
2125850	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125851	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,800,000
2125852	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,800,000
2125859	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000
2125860	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125861	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000
2125862	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125863	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,800,000
2125864	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,800,000
2125865	FX	oct-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125866	FX	oct-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125867	FX	nov-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125868	FX	nov-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125869	FX	dic-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125870	FX	dic-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125877	FX	oct-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125878	FX	oct-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125879	FX	nov-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125880	FX	nov-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125881	FX	dic-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125882	FX	dic-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125895	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,000,000
2125907	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,000,000
2126019	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2126020	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2126021	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2126022	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2126023	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2126024	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2126025	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2126026	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2126027	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2126037	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126038	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2126039	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126040	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126041	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2126042	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126043	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126044	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2126045	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126048	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2126049	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2126050	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2126051	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2126052	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126053	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126054	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126055	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126056	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126057	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126064	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126065	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126066	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126067	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126068	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126069	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126070	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126071	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126072	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126073	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126074	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126075	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126076	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126077	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126078	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126079	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126080	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126081	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126084	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2126085	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2126086	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126087	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126088	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126089	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126090	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126091	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126098	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126099	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126100	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126101	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126102	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126103	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126110	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126111	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126112	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126113	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126114	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126115	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126122	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126123	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126124	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126125	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126126	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126127	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2126211	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,821
2126212	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126213	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126214	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126215	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,206
2126216	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,821
2126217	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126218	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126219	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126220	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,206
2126241	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,821
2126242	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126243	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126244	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126245	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,206
2126246	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,821
2126247	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126248	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126249	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126250	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,206
2126319	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126320	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126321	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126322	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126323	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126324	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126325	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126326	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126327	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126328	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126329	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126330	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126331	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126332	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126333	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126334	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126335	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126336	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126337	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126338	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126339	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126340	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126341	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126342	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126343	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126344	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126345	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126346	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126347	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126348	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126349	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126350	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126351	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126352	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126353	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	314,133
2126354	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	314,133
2126395	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126396	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126397	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126398	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126399	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126400	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126401	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126402	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2126403	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126404	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126405	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126406	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126407	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126408	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126409	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126410	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126411	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126412	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126413	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126414	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126415	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126416	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126417	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126418	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126419	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126420	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126421	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126422	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126423	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126424	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126425	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126426	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126427	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126428	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126429	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126430	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126431	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126432	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126433	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126434	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126435	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126436	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126437	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126438	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126439	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126440	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126441	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126442	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126483	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126484	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126485	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126486	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126487	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126488	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126489	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126490	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126491	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126492	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126493	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126494	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126495	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126496	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126497	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126498	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126499	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126500	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126501	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126502	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126503	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126504	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126505	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126506	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2126507	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126508	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126509	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126510	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126511	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126512	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126513	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126514	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126515	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126516	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126517	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126518	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126519	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126520	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126521	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126522	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126523	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126524	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126525	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126526	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126527	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126528	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126529	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126530	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,717
2126549	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,746
2126550	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2126551	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2126552	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2126553	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	12,500
2126554	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,746
2126555	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2126556	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2126557	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2126558	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	12,500
2126564	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,746
2126565	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2126566	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2126567	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2126568	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	12,500
2126569	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,746
2126570	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2126571	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2126572	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2126573	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	12,500
2126579	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126580	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126581	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126582	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,782
2126583	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126584	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126585	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126586	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,782
2126591	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126592	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126593	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126594	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,782
2126595	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126596	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126597	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126598	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,782
2126606	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000,000
2126607	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000,000
2126634	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	114,220
2126635	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	114,220

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2126636	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	114,220
2126637	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	114,220
2126640	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	114,220
2126641	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	114,220
2126642	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	114,220
2126643	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	114,220
2126653	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,732
2126654	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126655	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126656	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126657	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2126658	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,732
2126659	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126660	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126661	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126662	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,000
2126663	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,732
2126664	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126665	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126666	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126667	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,000
2126683	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,732
2126684	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126685	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126686	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126687	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2126688	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,732
2126689	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126690	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126691	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126692	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,000
2126693	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,732
2126694	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126695	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126696	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126697	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,000
2126713	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2126714	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2126715	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2126716	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2126719	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2126720	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2126721	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2126722	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2126727	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126728	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126729	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126730	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,323
2126731	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126732	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126733	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126734	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,323
2126739	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126740	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126741	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126742	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,323
2126743	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126744	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126745	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126746	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,323
2126751	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126752	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126753	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126754	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,116



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2126755	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126756	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126757	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126758	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,116
2126763	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126764	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126765	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126766	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,116
2126767	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126768	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126769	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126770	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,116
2126796	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126797	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126798	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126801	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126802	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126803	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126809	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,589
2126810	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126811	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126812	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126813	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,716
2126814	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,589
2126815	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126816	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126817	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126818	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,716
2126819	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,589
2126820	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126821	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126822	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126823	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,716
2126834	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,589
2126835	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126836	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126837	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126838	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,716
2126839	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,589
2126840	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126841	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126842	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126843	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,716
2126844	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,589
2126845	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126846	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126847	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126848	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,716
2126864	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978
2126865	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126866	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126867	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126868	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514
2126869	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978
2126870	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126871	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126872	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126873	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,514
2126874	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978
2126875	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126876	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126877	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126878	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514
2126909	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2126910	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126911	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126912	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126913	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514
2126914	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978
2126915	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126916	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126917	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126918	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,514
2126919	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978
2126920	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126921	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126922	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126923	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514
2126954	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,971
2126955	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126956	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126957	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126958	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,789
2126959	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,971
2126960	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126961	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126962	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126963	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,789
2126964	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,988
2126965	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126966	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126967	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126968	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	14,670
2126969	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,988
2126970	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126971	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126972	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126973	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	14,670
2126974	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,988
2126975	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126976	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126977	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126978	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,244
2126979	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,988
2126980	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126981	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126982	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126983	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,244
2126994	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,971
2126995	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126996	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126997	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126998	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,789
2126999	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,971
2127000	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127001	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127002	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127003	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,789
2127004	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,988
2127005	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127006	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127007	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127008	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	14,670
2127009	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,988
2127010	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127011	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127012	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127013	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	14,670

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2127014	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,988
2127015	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127016	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127017	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127018	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,244
2127019	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,988
2127020	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127021	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127022	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127023	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,244
2127027	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2127028	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127029	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127030	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127031	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127032	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127033	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127034	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127035	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127036	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127038	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2127039	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127040	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127041	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127042	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127043	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127044	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127045	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127046	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127047	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127048	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	23,500,000
2127049	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	23,500,000
2127211	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2127212	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127213	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127214	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127215	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2127216	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2127217	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127218	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127219	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127220	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2127231	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127232	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127233	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127234	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127235	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2127236	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2127239	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2127240	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127241	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127242	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127243	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2127244	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2127245	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127246	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127247	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127248	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2127258	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127259	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127260	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127261	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127262	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127263	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2127264	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127265	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127266	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127267	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127268	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127269	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127270	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127271	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127272	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127273	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127274	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127275	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127276	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127277	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127278	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127279	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127280	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127281	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127282	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127283	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127284	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127285	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127286	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127287	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127288	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127289	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127290	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127291	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127292	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127293	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127294	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127295	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127296	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127342	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127343	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127344	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127345	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127346	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127347	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127348	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127349	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127350	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127351	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127352	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127353	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127354	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127355	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127356	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127357	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127358	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127359	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127360	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127361	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127362	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127363	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127364	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127365	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127366	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127367	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127368	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127369	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127370	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127371	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127372	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2127373	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127374	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127375	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127376	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127377	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127378	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127379	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127380	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127436	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127437	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127438	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127439	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127440	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127441	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127442	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127443	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127444	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127445	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127446	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127447	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127448	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127452	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127453	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127454	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127455	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127456	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127457	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127458	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127459	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127460	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127461	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127462	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127463	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127464	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127465	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,842
2127466	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127467	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127468	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127469	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,095
2127470	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,842
2127471	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127472	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127473	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127474	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,095
2127475	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,842
2127476	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127477	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127478	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127479	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,095
2127495	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,842
2127496	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127497	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127498	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127499	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,095
2127500	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,842
2127501	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127502	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127503	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127504	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,095
2127505	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,842
2127506	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127507	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127508	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127509	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,095

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2127621	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,295
2127622	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127623	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127624	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127625	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,295
2127626	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127627	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127628	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127629	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,295
2127630	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127631	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127632	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127645	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,295
2127646	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127647	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127648	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127649	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,295
2127650	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127651	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2127652	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127653	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,295
2127654	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127655	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127656	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2127669	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,204
2127670	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127671	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127672	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127673	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127674	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,204
2127675	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127676	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127677	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127678	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127679	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127680	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127681	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127682	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127683	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127684	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127685	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127686	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127687	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127688	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127689	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127690	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127691	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127692	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127693	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127694	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127695	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127696	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127697	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127698	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127699	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127700	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127701	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127702	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127703	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127704	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127705	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127706	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127707	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127708	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2127709	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127710	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127711	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127712	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127713	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127714	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127715	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127716	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127717	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127718	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127719	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,204
2127720	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127721	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127722	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127723	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127724	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,204
2127725	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127726	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127727	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127728	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127729	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127730	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127731	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127732	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127733	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127734	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127735	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127736	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127737	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127738	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127739	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127740	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127741	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127742	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127743	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127744	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127745	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127746	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127747	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127748	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127749	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127750	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127751	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127752	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127753	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127754	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127755	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127756	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127757	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127758	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127759	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127760	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127761	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127762	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127763	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127764	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,204
2127765	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127766	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2127767	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2127768	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,372
2127772	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127773	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127774	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127775	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2127776	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127777	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127778	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127779	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127780	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127781	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127782	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127783	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127784	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127785	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127786	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127787	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127788	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127789	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127790	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127791	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127792	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127793	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127794	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127795	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127796	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127797	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127798	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127799	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127800	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127801	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127802	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127803	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127804	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127805	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127806	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127807	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127808	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127809	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127810	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127850	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127851	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127852	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127853	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127854	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127855	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127856	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127857	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127858	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127859	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127860	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127861	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127862	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127863	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127864	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127865	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127866	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127867	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127868	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127869	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127870	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127871	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127872	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127873	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127874	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127875	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127876	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127877	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127878	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2127879	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127880	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127881	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127882	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127883	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2127884	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127885	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2127886	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127887	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127888	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128127	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,139
2128128	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128129	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128130	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128131	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,139
2128132	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128133	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128134	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128135	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,139
2128136	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128137	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128138	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128175	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,139
2128176	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128177	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128178	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128179	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,139
2128180	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128181	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128182	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128183	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,139
2128184	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128185	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128186	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128223	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	70,000
2128224	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	70,000
2128225	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	70,000
2128226	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2128227	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2128228	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2128229	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128230	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128231	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128232	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128233	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128234	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128235	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128236	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128237	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128238	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128239	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128240	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128241	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128242	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128243	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128244	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128245	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2128246	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128247	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2128248	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128249	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2128250	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	70,000
2128251	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	70,000
2128252	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	70,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2128253	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2128254	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2128255	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2128256	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128257	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128258	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128259	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128260	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128261	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128262	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128263	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128264	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128265	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128266	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128267	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128268	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128269	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	130,000
2128270	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	130,000
2128271	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128272	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2128273	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128274	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2128275	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128276	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2128279	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,000,000
2128280	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,000,000
2128377	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,185,000
2128378	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,185,000
2128379	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,185,000
2128380	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,185,000
2128381	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,185,000
2128382	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,185,000
2128383	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2128384	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2128385	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2128386	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,000,000
2128387	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,000,000
2128388	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,000,000
2128392	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2128393	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2128394	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2128395	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,000,000
2128396	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,000,000
2128397	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,000,000
2128401	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2128402	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2128403	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2128404	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2128405	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2128406	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2128413	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2128414	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2128415	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2128416	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2128417	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2128418	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2128457	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128458	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128459	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128460	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,625
2128461	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128462	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128463	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128464	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2128465	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128466	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128467	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128468	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128469	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128470	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128471	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128472	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128473	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128474	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128475	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128476	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128477	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128478	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128479	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128480	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128481	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128482	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128483	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128484	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128485	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128486	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128487	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128488	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128489	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128490	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128491	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128492	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,625
2128493	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128494	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128495	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128496	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128497	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128498	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128499	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128500	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128501	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128502	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128503	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128504	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128505	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128506	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128507	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128508	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128509	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128510	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128511	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128512	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128513	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128514	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128515	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128516	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128517	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128518	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,250,000
2128519	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,250,000
2128520	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,625
2128521	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128522	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128523	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128524	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128525	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128526	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128527	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128528	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2128531	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128532	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128533	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128534	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128535	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128536	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128537	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128538	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128541	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128542	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128543	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128544	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128545	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,956
2128546	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128547	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128548	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128549	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2128550	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,956
2128551	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128552	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128553	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128554	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128555	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,956
2128556	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128557	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128558	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128559	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2128560	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,956
2128561	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128562	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128563	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128564	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128565	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,956
2128566	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128567	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128568	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128569	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128570	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,956
2128611	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128612	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128613	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128614	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128615	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,956
2128616	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128617	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128618	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128619	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2128620	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,956
2128621	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128622	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128623	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128624	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128625	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,956
2128626	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128627	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128628	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128629	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2128630	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,956
2128631	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2128632	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128633	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128634	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128635	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,956
2128636	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2128637	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128638	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128639	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2128640	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,956
2128683	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,000,000
2128684	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,000,000
2128685	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128686	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128687	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128688	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128689	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128690	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128694	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128695	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128696	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128697	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128698	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2128699	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2128711	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128712	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128713	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128714	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128715	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128716	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128717	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128718	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128719	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128720	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128721	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128722	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128723	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128724	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128725	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,425
2128726	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128727	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128728	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128729	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128730	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128731	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128732	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128733	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128734	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128735	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128736	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128737	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128738	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128739	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128740	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128801	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128802	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128803	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128804	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128805	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128806	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128807	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128808	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128809	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128810	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128811	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128812	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128813	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128814	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128815	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,425
2128816	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2128817	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128818	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128819	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128820	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128821	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128822	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128823	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128824	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128825	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128826	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,583
2128827	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128828	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2128829	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2128830	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,425
2128891	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,405
2128892	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2128893	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128894	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2128895	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,107
2128896	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	18,767
2128897	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2128898	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2128899	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2128900	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,949
2128901	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,405
2128902	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2128903	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128904	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128905	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	12,107
2128906	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	18,767
2128907	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2128908	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2128909	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2128910	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,949
2128911	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,405
2128912	FX	oct-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2128913	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128914	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2128915	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,107
2128916	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	18,767
2128917	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2128918	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2128919	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2128920	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,949
2128921	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,405
2128922	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2128923	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128924	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2128925	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	12,107
2128926	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	18,767
2128927	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2128928	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2128929	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2128930	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,949
2128933	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	14,873
2128934	FX	oct-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	14,873
2128935	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,615
2128936	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128937	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128938	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128939	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,615
2128940	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128941	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128942	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2128943	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,615
2128944	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128945	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128946	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128947	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,615
2128948	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128949	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128950	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128951	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,615
2128952	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128953	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128954	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128955	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,615
2128956	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128957	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128958	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128959	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,615
2128960	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128961	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128962	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128963	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,615
2128964	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128965	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128966	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128967	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2128968	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128969	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128970	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128971	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,286
2128972	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2128973	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128974	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128975	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128976	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,286
2128977	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2128978	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128979	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128980	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128981	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,286
2128982	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2128983	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128984	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128985	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128986	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,286
2128987	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2128988	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128989	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128990	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128991	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,286
2128992	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2128993	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128994	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2128995	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128996	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,286
2128997	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2128998	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2128999	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129000	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129001	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,286
2129002	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2129003	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129004	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129005	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129006	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,286



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2129007	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,202
2129008	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129009	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129010	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129011	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,202
2129012	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129013	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129014	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129015	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,202
2129016	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129017	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129018	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129019	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,202
2129020	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129021	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129022	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129023	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,202
2129024	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129025	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129026	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129027	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,202
2129028	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129029	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129030	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129031	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,202
2129032	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129033	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129034	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129035	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,202
2129036	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129037	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129038	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129039	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	23,500,000
2129040	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	23,500,000
2129047	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2129048	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129049	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129050	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2129051	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129052	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129053	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2129054	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129055	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129056	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2129057	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129058	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129059	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129060	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129061	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129062	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129063	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129064	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129065	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129066	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129067	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129068	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129069	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129070	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129071	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129072	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129073	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129110	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2129111	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129112	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2129113	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2129114	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129115	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129116	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2129117	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129118	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129119	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2129120	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129121	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2129122	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129123	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129124	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129125	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129126	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129127	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129128	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129129	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129130	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129131	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129132	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129133	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129134	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2129135	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129136	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2129173	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2129174	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129175	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129176	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2129177	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129178	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129179	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129180	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129181	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129182	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129183	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129184	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129191	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2129192	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129193	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129194	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2129195	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129196	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129197	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129198	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129199	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129200	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129201	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129202	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129275	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	19,800
2129276	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	19,800
2129277	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129278	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129279	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129280	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2129281	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129282	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2129283	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129284	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129285	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129286	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129289	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129290	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129291	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129292	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000



Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2129293	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129294	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2129295	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129296	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129297	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129298	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2129301	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,000
2129302	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129303	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129304	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129305	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129306	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129307	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,000
2129308	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129309	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129310	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129311	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129312	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129322	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,000
2129324	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129325	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129326	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129327	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129328	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,000
2129329	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129330	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129331	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129332	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129333	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129343	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2129344	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129345	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129346	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129347	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129348	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2129349	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2129350	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2129351	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2129352	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2129353	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2129356	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2129357	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2129358	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2129359	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2129362	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,752
2129363	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129364	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129365	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129366	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,290
2129367	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,752
2129368	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129369	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129370	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129371	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,290
2129372	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,752
2129373	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129374	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129375	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129376	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,290
2129377	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,752
2129378	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129379	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129380	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129381	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,290

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2129382	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,752
2129383	FX	nov-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129384	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129385	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129386	FX	nov-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,290
2129387	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,752
2129388	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129389	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129390	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129391	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,290
2129392	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,752
2129393	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129394	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129395	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129396	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,290
2129397	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,752
2129398	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129399	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2129400	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2129401	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,290
2129588	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,097
2129589	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2129590	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2129591	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2129592	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,216
2129678	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,097
2129679	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2129680	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2129681	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2129682	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,216
2129864	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000,000
2129865	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000,000
2129866	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	310,000
2129867	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	310,000
2129890	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	310,000
2129891	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	310,000
2130108	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,500
2130112	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,500
2130116	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2130117	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,500,000
2130118	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2130119	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2130120	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,500,000
2130121	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2130122	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2130123	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2130124	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,500,000
2130125	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2130126	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2130127	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2130148	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,293,000
2130149	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,293,000
2130150	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,293,000
2130151	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	51,720
2130152	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,293,000
2130153	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,293,000
2130154	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,293,000
2130155	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	51,720
2130156	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,293,000
2130157	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,293,000
2130158	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,293,000
2130159	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	51,720
2130180	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	116,500
2130181	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	116,500

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2130182	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	116,500
2130183	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,660
2130184	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	116,500
2130185	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	116,500
2130186	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	116,500
2130187	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,660
2130188	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	116,500
2130189	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	116,500
2130190	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	116,500
2130191	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,660
2130212	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,500
2130213	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	21,500
2130214	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,500
2130215	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	860
2130216	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	21,500
2130217	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,500
2130218	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,500
2130219	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	860
2130220	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	21,500
2130221	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,500
2130222	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,500
2130223	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	860
2130244	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	69,000
2130245	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	69,000
2130246	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	69,000
2130247	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,760
2130248	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	69,000
2130249	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	69,000
2130250	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	69,000
2130251	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,760
2130252	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	69,000
2130253	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	69,000
2130254	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	69,000
2130255	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,760
2130742	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,376
2130743	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2130744	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2130745	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2130794	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,376
2130795	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2130796	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2130797	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2131325	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	116,500
2131326	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	116,500
2131327	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	116,500
2131328	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,871
2131357	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	21,500
2131358	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,500
2131359	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,500
2131360	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	899
2131389	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	69,000
2131390	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	69,000
2131391	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	69,000
2131392	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,885
2131421	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,293,000
2131422	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,293,000
2131423	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,293,000
2131424	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	54,060
2131453	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,500,000
2131454	FX	dic-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2131455	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2131456	FX	dic-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	62,714

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024100803040	SO	AUDMXN	11/12/2024	(152,000)	13.11338	1,993,233
2024101603597	BO	CADMXN	10/17/2024	6,000,000	14.48824	(86,929,446)
2024110503007	SO	CADUSD	11/05/2024	(2,000,000)	1.38819	1,440,723
2023111503585	BO	EURMXN	10/02/2024	200,000	20.09823	(4,019,646)
2024081303596	B	EURUSD	10/03/2024	35,000,000	1.10224	(38,578,313)
2024090303481	B	EURMXN	10/03/2024	400,000	22.03472	(8,813,888)
2024090303486	B	EURMXN	10/03/2024	1,000,000	22.03824	(22,038,242)
2024090303517	B	EURMXN	10/03/2024	1,400,000	22.03472	(30,848,607)
2024100203758	S	EURMXN	10/03/2024	(1,600,000)	21.45425	34,326,802
2024100203055	B	EURUSD	10/04/2024	2,000,000	1.10431	(2,208,620)
2024100203078	B	EURUSD	10/04/2024	2,000,000	1.10395	(2,207,900)
2024100203104	S	EURUSD	10/04/2024	(2,000,000)	1.10382	2,207,640
2024100203177	S	EURUSD	10/04/2024	(2,000,000)	1.1041	2,208,200
2024100303040	B	EURUSD	10/07/2024	2,000,000	1.10263	(2,205,260)
2024100303453	B	EURUSD	10/07/2024	4,000,000	1.1029	(4,411,600)
2024100303174	S	EURUSD	10/07/2024	(2,000,000)	1.10238	2,204,760
2024100303237	S	EURUSD	10/07/2024	(2,000,000)	1.10321	2,206,420
2024100303250	S	EURUSD	10/07/2024	(2,000,000)	1.10314	2,206,280
2024080703611	BO	EURMXN	10/08/2024	2,000,000	21.33166	(42,663,318)
2024080703613	BO	EURMXN	10/08/2024	400,000	21.32686	(8,530,743)
2024100403062	B	EURUSD	10/08/2024	2,000,000	1.09715	(2,194,300)
2024100403172	S	EURUSD	10/08/2024	(2,000,000)	1.09623	2,192,460
2024082003516	B	EURUSD	10/09/2024	65,000,000	1.11408	(72,415,330)
2024100803261	S	EURUSD	10/09/2024	(65,000,000)	1.09698	71,303,525
2024020803265	B	EURMXN	10/15/2024	125,000	19.37729	(2,422,162)
2024101103064	BO	EURMXN	10/15/2024	1,600,000	21.2989	(34,078,238)
2024101603608	BO	EURMXN	10/17/2024	5,000,000	21.64506	(108,225,280)
2024101803583	S	EURMXN	10/22/2024	(1,400,000)	21.602	30,242,800
2024102303145	B	EURUSD	10/25/2024	1,000,000	1.07809	(1,078,090)
2024102303023	S	EURUSD	10/25/2024	(1,000,000)	1.07784	1,077,840
2024102403404	B	EURUSD	10/28/2024	2,000,000	1.08208	(2,164,160)
2024102403265	S	EURUSD	10/28/2024	(2,000,000)	1.08106	2,162,120
2024102803063	B	EURUSD	10/30/2024	2,000,000	1.08224	(2,164,480)
2024102803284	B	EURUSD	10/30/2024	2,000,000	1.08156	(2,163,120)
2024102803572	S	EURUSD	10/30/2024	(2,000,000)	1.0815	2,163,000
2024102803578	S	EURUSD	10/30/2024	(2,000,000)	1.08157	2,163,140
2024102903005	B	EURUSD	10/31/2024	2,000,000	1.07837	(2,156,740)
2024102903010	B	EURUSD	10/31/2024	2,000,000	1.07875	(2,157,500)
2024102903097	B	EURUSD	10/31/2024	2,000,000	1.0797	(2,159,400)
2024102903117	B	EURUSD	10/31/2024	2,000,000	1.07897	(2,157,940)
2024102903140	B	EURUSD	10/31/2024	2,000,000	1.07916	(2,158,320)
2024102903027	S	EURUSD	10/31/2024	(4,000,000)	1.0803	4,321,200
2024102903040	S	EURUSD	10/31/2024	(2,000,000)	1.08075	2,161,500
2024102903195	S	EURUSD	10/31/2024	(2,000,000)	1.08	2,160,000
2024102903198	S	EURUSD	10/31/2024	(2,000,000)	1.08007	2,160,140
2024103003183	B	EURUSD	11/01/2024	2,000,000	1.0863	(2,172,600)
2024103003217	B	EURUSD	11/01/2024	2,000,000	1.086	(2,172,000)
2024103003286	B	EURUSD	11/01/2024	1,000,000	1.08598	(1,085,980)
2024103003055	S	EURUSD	11/01/2024	(2,000,000)	1.08492	2,169,840
2024103003066	S	EURUSD	11/01/2024	(2,000,000)	1.08546	2,170,920
2024103003070	S	EURUSD	11/01/2024	(1,000,000)	1.08509	1,085,090
2024103103090	B	EURUSD	11/04/2024	2,000,000	1.08548	(2,170,960)
2024103103099	B	EURUSD	11/04/2024	2,000,000	1.08566	(2,171,320)
2024103103053	S	EURUSD	11/04/2024	(2,000,000)	1.08758	2,175,160
2024103103524	S	EURUSD	11/04/2024	(1,500,000)	1.0866	1,629,900
2024103103525	S	EURUSD	11/04/2024	(2,500,000)	1.0866	2,716,500
2024110103610	BO	EURMXN	11/04/2024	3,000,000	21.97983	(65,939,493)
2024110103666	BO	EURMXN	11/04/2024	1,000,000	21.95393	(21,953,931)
2024100203759	B	EURMXN	11/05/2024	1,600,000	21.59678	(34,554,844)
2024110103036	B	EURUSD	11/05/2024	2,000,000	1.08568	(2,171,360)
2024110103093	B	EURUSD	11/05/2024	1,000,000	1.08532	(1,085,320)
2024110103228	S	EURUSD	11/05/2024	(2,000,000)	1.08461	2,169,220
2024110103236	S	EURUSD	11/05/2024	(2,000,000)	1.08471	2,169,420
2024110103238	S	EURUSD	11/05/2024	(1,000,000)	1.08485	1,084,850
2024110403194	B	EURUSD	11/06/2024	2,000,000	1.08966	(2,179,320)
2024110403302	B	EURUSD	11/06/2024	2,000,000	1.08835	(2,176,700)
2024110403139	S	EURUSD	11/06/2024	(2,000,000)	1.09061	2,181,220
2024110403460	S	EURUSD	11/06/2024	(2,000,000)	1.08805	2,176,100
2024110503056	B	EURUSD	11/07/2024	1,000,000	1.09044	(1,090,440)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024110503058	B	EURUSD	11/07/2024	2,000,000	1.09034	(2,180,680)
2024110503037	S	EURUSD	11/07/2024	(2,000,000)	1.09038	2,180,760
2024110503039	S	EURUSD	11/07/2024	(1,000,000)	1.09048	1,090,480
2024110703223	B	EURUSD	11/12/2024	2,000,000	1.0802	(2,160,400)
2024110703230	B	EURUSD	11/12/2024	2,000,000	1.08012	(2,160,240)
2024110703290	B	EURUSD	11/12/2024	2,000,000	1.07897	(2,157,940)
2024110703308	B	EURUSD	11/12/2024	2,000,000	1.07916	(2,158,320)
2024110703100	S	EURUSD	11/12/2024	(2,000,000)	1.08125	2,162,500
2024110703209	S	EURUSD	11/12/2024	(2,000,000)	1.0813	2,162,600
2024110703356	S	EURUSD	11/12/2024	(4,000,000)	1.08	4,320,000
2024110803049	B	EURUSD	11/12/2024	2,000,000	1.07483	(2,149,660)
2024110803069	B	EURUSD	11/12/2024	2,000,000	1.07419	(2,148,380)
2024110803073	B	EURUSD	11/12/2024	2,000,000	1.0745	(2,149,000)
2024110803085	B	EURUSD	11/12/2024	1,000,000	1.07456	(1,074,560)
2024110803035	S	EURUSD	11/12/2024	(2,000,000)	1.07583	2,151,660
2024110803120	S	EURUSD	11/12/2024	(3,000,000)	1.07371	3,221,130
2024110803122	S	EURUSD	11/12/2024	(2,000,000)	1.07349	2,146,980
2024111103167	S	EURMXN	11/12/2024	(35,000,000)	21.78128	762,344,905
2024111103170	SO	EURMXN	11/12/2024	(5,000,000)	21.79058	108,952,915
2024110803223	B	EURMXN	11/13/2024	2,000,000	21.6005	(43,201,000)
2024110803283	S	EURMXN	11/13/2024	(2,000,000)	21.6724	43,344,800
2024111103063	B	EURUSD	11/13/2024	2,000,000	1.06317	(2,126,340)
2024111103171	B	EURUSD	11/13/2024	2,000,000	1.06382	(2,127,640)
2024111103301	B	EURUSD	11/13/2024	2,000,000	1.06475	(2,129,500)
2024111103408	B	EURUSD	11/13/2024	2,000,000	1.06514	(2,130,280)
2024111103060	S	EURUSD	11/13/2024	(2,000,000)	1.06572	2,131,440
2024111103226	S	EURUSD	11/13/2024	(2,000,000)	1.06539	2,130,780
2024111103232	S	EURUSD	11/13/2024	(2,000,000)	1.06513	2,130,260
2024111103276	S	EURUSD	11/13/2024	(2,000,000)	1.06538	2,130,760
2023111503586	BO	EURMXN	11/15/2024	300,000	20.27905	(6,083,714)
2024020803267	B	EURMXN	11/15/2024	125,000	19.50187	(2,437,733)
2024030403675	BO	EURMXN	11/15/2024	1,000,000	19.3632	(19,363,201)
2024111303025	B	EURUSD	11/15/2024	2,000,000	1.06314	(2,126,280)
2024111303028	B	EURUSD	11/15/2024	2,000,000	1.06327	(2,126,540)
2024111303041	B	EURUSD	11/15/2024	1,000,000	1.063	(1,063,000)
2024111303234	B	EURUSD	11/15/2024	2,000,000	1.058	(2,116,000)
2024111303246	B	EURUSD	11/15/2024	2,000,000	1.05726	(2,114,520)
2024111303484	B	EURUSD	11/15/2024	1,000,000	1.05624	(1,056,240)
2024111303052	S	EURUSD	11/15/2024	(2,000,000)	1.06068	2,121,360
2024111303057	S	EURUSD	11/15/2024	(2,000,000)	1.06109	2,122,180
2024111303163	S	EURUSD	11/15/2024	(1,000,000)	1.05795	1,057,950
2024111303214	S	EURUSD	11/15/2024	(2,000,000)	1.05884	2,117,680
2024111303481	S	EURUSD	11/15/2024	(2,000,000)	1.05582	2,111,640
2024111403075	B	EURUSD	11/18/2024	2,000,000	1.05544	(2,110,880)
2024111403143	B	EURUSD	11/18/2024	2,000,000	1.05699	(2,113,980)
2024111403148	B	EURUSD	11/18/2024	2,000,000	1.05711	(2,114,220)
2024111403308	B	EURUSD	11/18/2024	2,000,000	1.05625	(2,112,500)
2024111403322	B	EURUSD	11/18/2024	1,000,000	1.05623	(1,056,230)
2024111403363	B	EURUSD	11/18/2024	1,000,000	1.05603	(1,056,030)
2024111403368	B	EURUSD	11/18/2024	1,000,000	1.05603	(1,056,030)
2024111403045	S	EURUSD	11/18/2024	(2,000,000)	1.0558	2,111,600
2024111403087	S	EURUSD	11/18/2024	(2,000,000)	1.05606	2,112,120
2024111403121	S	EURUSD	11/18/2024	(2,000,000)	1.05644	2,112,880
2024111403451	S	EURUSD	11/18/2024	(5,000,000)	1.05568	5,278,400
2024111503028	B	EURUSD	11/19/2024	2,000,000	1.05562	(2,111,240)
2024111503033	S	EURUSD	11/19/2024	(2,000,000)	1.05435	2,108,700
2024111503264	S	EURUSD	11/19/2024	(2,000,000)	1.05488	2,109,760
2024111503321	S	EURUSD	11/19/2024	(1,000,000)	1.05478	1,054,780
2024111103168	B	EURMXN	11/21/2024	35,000,000	21.82424	(763,848,260)
2024112003055	B	EURUSD	11/22/2024	2,000,000	1.05266	(2,105,320)
2024112003119	B	EURUSD	11/22/2024	2,000,000	1.05244	(2,104,880)
2024112003154	S	EURUSD	11/22/2024	(2,000,000)	1.05196	2,103,920
2024112003157	S	EURUSD	11/22/2024	(2,000,000)	1.0516	2,103,200
2024112103024	B	EURUSD	11/25/2024	2,000,000	1.05252	(2,105,040)
2024112103180	B	EURUSD	11/25/2024	2,000,000	1.05291	(2,105,820)
2024112103186	B	EURUSD	11/25/2024	1,000,000	1.05231	(1,052,310)
2024112103072	S	EURUSD	11/25/2024	(2,000,000)	1.05379	2,107,580
2024112103199	S	EURUSD	11/25/2024	(3,000,000)	1.05098	3,152,940
2024112203671	B	EURUSD	11/26/2024	2,000,000	1.04154	(2,083,080)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024112203135	S	EURUSD	11/26/2024	(2,000,000)	1.04101	2,082,020
2024112203511	S	EURUSD	11/26/2024	(2,000,000)	1.04241	2,084,820
2024100803262	B	EURUSD	11/27/2024	65,000,000	1.09923	(71,449,924)
2024112603404	S	EURUSD	11/27/2024	(65,000,000)	1.0468	68,041,805
2024112603029	B	EURUSD	11/29/2024	2,000,000	1.05	(2,100,000)
2024112603067	S	EURUSD	11/29/2024	(2,000,000)	1.05014	2,100,280
2024112703494	B	EURUSD	11/29/2024	4,000,000	1.05696	(4,227,840)
2024112703258	S	EURUSD	11/29/2024	(2,000,000)	1.0578	2,115,600
2024112703325	S	EURUSD	11/29/2024	(2,000,000)	1.05846	2,116,920
2024101803584	B	EURMXN	12/03/2024	1,400,000	21.79883	(30,518,363)
2024112903150	B	EURUSD	12/03/2024	2,000,000	1.0552	(2,110,400)
2024112903264	B	EURUSD	12/03/2024	2,000,000	1.05509	(2,110,180)
2024112903123	S	EURUSD	12/03/2024	(2,000,000)	1.05616	2,112,320
2024112903603	S	EURUSD	12/03/2024	(2,000,000)	1.05584	2,111,680
2024120203060	B	EURUSD	12/04/2024	2,000,000	1.04788	(2,095,760)
2024120203146	B	EURUSD	12/04/2024	2,000,000	1.04709	(2,094,180)
2024120203222	B	EURUSD	12/04/2024	2,000,000	1.04854	(2,097,080)
2024120203069	S	EURUSD	12/04/2024	(2,000,000)	1.04729	2,094,580
2024120203157	S	EURUSD	12/04/2024	(2,000,000)	1.04621	2,092,420
2024120203212	S	EURUSD	12/04/2024	(2,000,000)	1.04929	2,098,580
2024120203643	S	EURMXN	12/04/2024	(2,000,000)	21.39979	42,799,580
2024120203673	S	EURMXN	12/04/2024	(35,000,000)	21.4172	749,602,000
2024120303045	B	EURUSD	12/05/2024	2,000,000	1.0521	(2,104,200)
2024120303048	B	EURUSD	12/05/2024	2,000,000	1.05206	(2,104,120)
2024120303069	B	EURUSD	12/05/2024	2,000,000	1.05092	(2,101,840)
2024120303103	B	EURUSD	12/05/2024	2,000,000	1.05074	(2,101,480)
2024120303452	B	EURUSD	12/05/2024	3,000,000	1.05325	(3,159,750)
2024120303453	B	EURUSD	12/05/2024	2,000,000	1.05341	(2,106,820)
2024120303029	S	EURUSD	12/05/2024	(2,000,000)	1.05257	2,105,140
2024120303038	S	EURUSD	12/05/2024	(2,000,000)	1.05238	2,104,760
2024120303121	S	EURUSD	12/05/2024	(2,000,000)	1.04955	2,099,100
2024120303135	S	EURUSD	12/05/2024	(2,000,000)	1.04984	2,099,680
2024120303294	S	EURUSD	12/05/2024	(2,000,000)	1.05183	2,103,660
2024120303305	S	EURUSD	12/05/2024	(2,000,000)	1.05177	2,103,540
2024120303323	S	EURUSD	12/05/2024	(1,000,000)	1.05179	1,051,790
2024120403018	B	EURUSD	12/06/2024	2,000,000	1.04767	(2,095,340)
2024120403061	B	EURUSD	12/06/2024	2,000,000	1.05162	(2,103,240)
2024120403022	S	EURUSD	12/06/2024	(2,000,000)	1.04891	2,097,820
2024120403032	S	EURUSD	12/06/2024	(2,000,000)	1.04911	2,098,220
2024120503045	BO	EURMXN	12/06/2024	1,500,000	21.37207	(32,058,111)
2024120503029	B	EURUSD	12/09/2024	2,000,000	1.0567	(2,113,400)
2024120503067	B	EURUSD	12/09/2024	2,000,000	1.05676	(2,113,520)
2024120503099	B	EURUSD	12/09/2024	2,000,000	1.0559	(2,111,800)
2024120503135	B	EURUSD	12/09/2024	2,000,000	1.05569	(2,111,380)
2024120503004	S	EURUSD	12/09/2024	(2,000,000)	1.05668	2,113,360
2024120503161	S	EURUSD	12/09/2024	(4,000,000)	1.05746	4,229,840
2024120603033	B	EURUSD	12/10/2024	2,000,000	1.05926	(2,118,520)
2024120603037	B	EURUSD	12/10/2024	1,000,000	1.05775	(1,057,750)
2024120603040	S	EURUSD	12/10/2024	(2,000,000)	1.05874	2,117,480
2024120603078	S	EURUSD	12/10/2024	(1,000,000)	1.05667	1,056,670
2024120903292	B	EURUSD	12/11/2024	2,000,000	1.058	(2,116,000)
2024120903303	B	EURUSD	12/11/2024	1,000,000	1.05747	(1,057,470)
2024120903311	B	EURUSD	12/11/2024	1,000,000	1.05758	(1,057,580)
2024120903392	B	EURUSD	12/11/2024	1,000,000	1.05703	(1,057,030)
2024120903220	S	EURUSD	12/11/2024	(1,000,000)	1.05872	1,058,720
2024120903230	S	EURUSD	12/11/2024	(1,000,000)	1.0591	1,059,100
2024120903423	S	EURUSD	12/11/2024	(2,000,000)	1.05661	2,113,220
2024120903461	S	EURUSD	12/11/2024	(1,000,000)	1.05633	1,056,330
2024020803269	B	EURMXN	12/13/2024	125,000	19.61445	(2,451,807)
2024121103077	B	EURUSD	12/13/2024	1,000,000	1.05004	(1,050,040)
2024121103085	B	EURUSD	12/13/2024	1,000,000	1.05006	(1,050,060)
2024121103408	B	EURUSD	12/13/2024	2,000,000	1.04942	(2,098,840)
2024121103106	S	EURUSD	12/13/2024	(2,000,000)	1.04886	2,097,720
2024121103465	S	EURUSD	12/13/2024	(2,000,000)	1.04937	2,098,740
2024121303123	B	EURUSD	12/17/2024	2,000,000	1.0487	(2,097,400)
2024121303130	B	EURUSD	12/17/2024	2,000,000	1.0487	(2,097,400)
2024121603067	B	EURUSD	12/18/2024	2,000,000	1.0486	(2,097,200)
2024121603084	B	EURUSD	12/18/2024	2,000,000	1.04803	(2,096,060)
2024121603241	B	EURUSD	12/18/2024	2,000,000	1.04956	(2,099,120)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024121603242	B	EURUSD	12/18/2024	2,000,000	1.04971	(2,099,420)
2024121603071	S	EURUSD	12/18/2024	(2,000,000)	1.0479	2,095,800
2024121603095	S	EURMXN	12/18/2024	(2,000,000)	21.15457	42,309,140
2024121603108	S	EURUSD	12/18/2024	(2,000,000)	1.04982	2,099,640
2024121603125	S	EURUSD	12/18/2024	(2,000,000)	1.05005	2,100,100
2024121603291	S	EURUSD	12/18/2024	(2,000,000)	1.05118	2,102,360
2024121703321	B	EURUSD	12/19/2024	2,000,000	1.05101	(2,102,020)
2024121703334	B	EURUSD	12/19/2024	2,000,000	1.051	(2,102,000)
2024121703097	S	EURUSD	12/19/2024	(2,000,000)	1.05048	2,100,960
2024121703194	S	EURUSD	12/19/2024	(2,000,000)	1.05024	2,100,480
2023111503587	BO	EURMXN	12/20/2024	30,000	20.4354	(613,062)
2024120503421	BO	JPYMXN	12/06/2024	30,000,000	0.134588	(4,037,640)
2024120903155	BO	JPYMXN	12/10/2024	15,000,000	0.133454	(2,001,810)
2024061403325	BO	USDMXN	10/02/2024	164,900	18.76379	(3,094,149)
2024062703091	B	USDMXN	10/02/2024	30,000,000	18.6295	(558,885,000)
2024071103672	BO	USDMXN	10/02/2024	100,000	17.98334	(1,798,334)
2024081603209	BO	USDMXN	10/02/2024	35,670	18.76273	(669,267)
2024090503804	BO	USDMXN	10/02/2024	28,200	19.96117	(562,905)
2024092603865	B	USDMXN	10/02/2024	194,000	19.69148	(3,820,147)
2024092603870	B	USDMXN	10/02/2024	966	19.70048	(19,021)
2024092703298	B	USDMXN	10/02/2024	61,090	19.73124	(1,205,381)
2024092703830	B	USDMXN	10/02/2024	262,129	19.70473	(5,165,181)
2024092703834	B	USDMXN	10/02/2024	235,200	19.70466	(4,634,536)
2024092703843	B	USDMXN	10/02/2024	310,000	19.7046	(6,108,426)
2024092703849	B	USDMXN	10/02/2024	365,828	19.69198	(7,203,882)
2024092703855	B	USDMXN	10/02/2024	76,000	19.70343	(1,497,461)
2024092703939	B	USDMXN	10/02/2024	47,460	19.68849	(934,416)
2024092703946	B	USDMXN	10/02/2024	257,300	19.68885	(5,065,941)
2024092703837	S	USDMXN	10/02/2024	(100,000)	19.69252	1,969,252
2024093003366	B	USDMXN	10/02/2024	20,000,000	19.61842	(392,368,420)
2024093003335	S	USDMXN	10/02/2024	(20,000,000)	19.64414	392,882,760
2024100203395	B	USDMXN	10/02/2024	80,000,000	19.415	(1,553,200,000)
2024100203770	BO	USDMXN	10/02/2024	3,000,000	19.41308	(58,239,240)
2024100203398	S	USDMXN	10/02/2024	(100,000,000)	19.41	1,941,000,000
2023112403541	BO	USDMXN	10/03/2024	305,000	18.03781	(5,501,532)
2023121503655	BO	USDMXN	10/03/2024	68	18.06016	(1,228)
2024010303548	SO	USDMXN	10/03/2024	(249,292)	17.81735	4,441,719
2024092603056	SO	USDMXN	10/03/2024	(10,000,000)	19.55398	195,539,800
2024093003345	B	USDMXN	10/03/2024	20,000,000	19.635	(392,700,000)
2024093003463	B	USDMXN	10/03/2024	58,220	19.64999	(1,144,022)
2024093003865	B	USDMXN	10/03/2024	132,000	19.68853	(2,598,886)
2024093003870	B	USDMXN	10/03/2024	114,000	19.68664	(2,244,277)
2024100203396	S	USDMXN	10/03/2024	(80,000,000)	19.41795	1,553,436,000
2023062903560	SO	USDMXN	10/04/2024	(19,000)	18.45872	350,716
2023062903561	SO	USDMXN	10/04/2024	(500)	18.41326	9,206
2023070603505	SO	USDMXN	10/04/2024	(19,500)	18.65659	363,803
2023082503304	SO	USDMXN	10/04/2024	(19,500)	18.00579	351,113
2024010303658	SO	USDMXN	10/04/2024	(2,564)	17.81753	45,684
2024061403327	BO	USDMXN	10/04/2024	213,750	18.77103	(4,012,308)
2024092503094	S	USDMXN	10/04/2024	(100,000,000)	19.60658	1,960,658,100
2024100203047	B	USDMXN	10/04/2024	1,000,000	19.48133	(19,481,330)
2024100203054	B	USDMXN	10/04/2024	1,000,000	19.46857	(19,468,570)
2024100203077	B	USDMXN	10/04/2024	1,000,000	19.44057	(19,440,570)
2024100203162	B	USDMXN	10/04/2024	100,000,000	19.445	(1,944,500,000)
2024100203567	B	USDMXN	10/04/2024	10,000,000	19.4275	(194,275,000)
2024100203772	B	USDMXN	10/04/2024	3,000,000	19.41	(58,230,000)
2024100203797	B	USDMXN	10/04/2024	26,650	19.42356	(517,638)
2024100203800	B	USDMXN	10/04/2024	100,000,000	19.421	(1,942,100,000)
2024100203032	S	USDMXN	10/04/2024	(838,201)	19.55633	16,392,138
2024100203080	S	USDMXN	10/04/2024	(1,000,000)	19.44403	19,444,030
2024100203089	S	USDMXN	10/04/2024	(2,000,000)	19.46	38,920,000
2024100203204	S	USDMXN	10/04/2024	(10,000,000)	19.373	193,730,000
2024100203486	S	USDMXN	10/04/2024	(2,000,000)	19.42767	38,855,340
2024100203561	S	USDMXN	10/04/2024	(1,000,000)	19.43592	19,435,920
2024040303592	B	USDMXN	10/07/2024	20,000,000	17.0255	(340,510,000)
2024071103665	BO	USDMXN	10/07/2024	50,000	18.06524	(903,262)
2024091903624	B	USDMXN	10/07/2024	150,000,000	19.3441	(2,901,615,000)
2024100203163	S	USDMXN	10/07/2024	(100,000,000)	19.45475	1,945,475,000
2024100203801	S	USDMXN	10/07/2024	(100,000,000)	19.43075	1,943,075,000



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024100303079	B	USDMXN	10/07/2024	2,000,000	19.52	(39,040,000)
2024100303080	B	USDMXN	10/07/2024	2,000,000	19.51991	(39,039,820)
2024100303110	B	USDMXN	10/07/2024	2,000,000	19.50254	(39,005,080)
2024100303155	B	USDMXN	10/07/2024	1,000,000	19.49221	(19,492,210)
2024100303245	B	USDMXN	10/07/2024	1,000,000	19.43815	(19,438,150)
2024100303248	B	USDMXN	10/07/2024	1,000,000	19.43882	(19,438,820)
2024100303360	B	USDMXN	10/07/2024	1,000,000	19.42947	(19,429,470)
2024100303604	B	USDMXN	10/07/2024	483,908	19.37197	(9,374,242)
2024100303673	B	USDMXN	10/07/2024	1,150,000	19.34333	(22,244,830)
2024100303679	B	USDMXN	10/07/2024	750,000	19.34365	(14,507,738)
2024100303030	S	USDMXN	10/07/2024	(1,000,000)	19.52361	19,523,610
2024100303034	S	USDMXN	10/07/2024	(1,000,000)	19.52857	19,528,570
2024100303039	S	USDMXN	10/07/2024	(1,000,000)	19.5532	19,553,200
2024100303055	S	USDMXN	10/07/2024	(2,000,000)	19.535	39,070,000
2024100303209	S	USDMXN	10/07/2024	(2,000,000)	19.44957	38,899,140
2024100303221	S	USDMXN	10/07/2024	(1,000,000)	19.4483	19,448,300
2024100303382	S	USDMXN	10/07/2024	(2,000,000)	19.40304	38,806,080
2024070303391	B	USDMXN	10/08/2024	30,000,000	18.399	(551,970,000)
2024100403349	B	USDMXN	10/08/2024	3,302,224	19.23436	(63,516,171)
2024100403615	B	USDMXN	10/08/2024	530,355	19.26964	(10,219,759)
2024100403659	B	USDMXN	10/08/2024	24,356	19.25925	(469,080)
2024100803063	S	USDMXN	10/08/2024	(2,000,000)	19.15254	38,305,080
2024100803349	S	USDMXN	10/08/2024	(7,500,000)	19.32	144,900,000
2024100803484	S	USDMXN	10/08/2024	(7,500,000)	19.33	144,975,000
2023082103454	B	USDMXN	10/09/2024	500,000	18.31428	(9,157,139)
2023082203073	B	USDMXN	10/09/2024	300,000	18.19582	(5,458,747)
2023082903175	B	USDMXN	10/09/2024	1,000,000	18.09384	(18,093,840)
2023091303099	B	USDMXN	10/09/2024	500,000	18.31131	(9,155,656)
2023091403628	B	USDMXN	10/09/2024	200,000	18.25755	(3,651,510)
2024090503803	BO	USDMXN	10/09/2024	19,400	19.98207	(387,652)
2024100703654	B	USDMXN	10/09/2024	145,625	19.2972	(2,810,158)
2024100803350	B	USDMXN	10/09/2024	7,500,000	19.3229	(144,921,750)
2024100803485	B	USDMXN	10/09/2024	7,500,000	19.3329	(144,996,750)
2024010803281	B	USDMXN	10/10/2024	10,000,000	17.592	(175,920,000)
2024100803622	B	USDMXN	10/10/2024	3,000,000	19.35024	(58,050,720)
2024100803624	B	USDMXN	10/10/2024	11,329	19.35698	(219,303)
2024100803641	B	USDMXN	10/10/2024	1,000,000	19.36865	(19,368,650)
2024100803644	B	USDMXN	10/10/2024	1,000,000	19.37616	(19,376,160)
2024100803015	S	USDMXN	10/10/2024	(1,000,000)	19.37957	19,379,570
2023070603507	SO	USDMXN	10/11/2024	(19,500)	18.67431	364,149
2023082503306	SO	USDMXN	10/11/2024	(19,500)	18.02433	351,474
2024040903045	B	USDMXN	10/11/2024	10,000,000	16.8055	(168,055,000)
2024040903047	B	USDMXN	10/11/2024	20,000,000	16.8055	(336,110,000)
2024040903053	S	USDMXN	10/11/2024	(10,000,000)	16.8055	168,055,000
2024040903057	S	USDMXN	10/11/2024	(20,000,000)	16.8055	336,110,000
2024080903625	SO	USDMXN	10/11/2024	(1,128,476)	19.01601	21,459,106
2024082703879	SO	USDMXN	10/11/2024	(200,000)	19.89865	3,979,730
2024091803034	S	USDMXN	10/11/2024	(415,720,470)	19.2437	8,000,000,000
2024092503095	B	USDMXN	10/11/2024	100,000,000	19.62848	(1,962,848,200)
2024092503515	B	USDMXN	10/11/2024	35,000,000	19.66724	(688,353,505)
2024100903422	B	USDMXN	10/11/2024	7,000,000	19.45661	(136,196,270)
2024100903472	S	USDMXN	10/11/2024	(622,193)	19.47615	12,117,921
2024100903691	S	USDMXN	10/11/2024	(307,944)	19.49291	6,002,731
2024101103232	B	USDMXN	10/11/2024	10,159,876	19.39	(197,000,000)
2023121903374	B	USDMXN	10/15/2024	1,668,877	17.9579	(29,969,527)
2023121903618	B	USDMXN	10/15/2024	1,479,948	17.95151	(26,567,292)
2024012403630	BO	USDMXN	10/15/2024	543,778	17.98343	(9,778,993)
2024041703543	BO	USDMXN	10/15/2024	543,000	17.4146	(9,456,130)
2024041703563	SO	USDMXN	10/15/2024	(543,000)	17.43211	9,465,634
2024041803394	SO	USDMXN	10/15/2024	(96,679)	17.62067	1,703,549
2024061103597	B	USDMXN	10/15/2024	5,000,000	18.88758	(94,437,890)
2024061403676	BO	USDMXN	10/15/2024	200,000	18.83453	(3,766,906)
2024071103661	BO	USDMXN	10/15/2024	50,000	18.0876	(904,380)
2024072303571	SO	USDMXN	10/15/2024	(141,889)	18.37338	2,606,980
2024101003542	S	USDMXN	10/15/2024	(495,161)	19.49787	9,654,585
2024101003580	S	USDMXN	10/15/2024	(4,000,000)	19.495	77,980,000
2024101103233	S	USDMXN	10/15/2024	(10,153,331)	19.4025	197,000,000
2023090603312	S	USDMXN	10/16/2024	(208,333)	18.85085	3,927,261
2023090803337	S	USDMXN	10/16/2024	(125,000)	18.81372	2,351,715

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023092603227	SO	USDMXN	10/16/2024	(166,667)	18.66639	3,111,065
2023100303502	SO	USDMXN	10/16/2024	(166,667)	19.09066	3,181,777
2023101703666	SO	USDMXN	10/16/2024	(833,333)	19.14555	15,954,623
2024081403796	B	USDMXN	10/16/2024	30,000,000	19.001	(570,030,000)
2024081603171	BO	USDMXN	10/16/2024	640,000	18.80999	(12,038,391)
2024081603210	BO	USDMXN	10/16/2024	35,670	18.80378	(670,731)
2024091303843	BO	USDMXN	10/16/2024	125,650	19.29952	(2,424,985)
2024092303106	B	USDMXN	10/16/2024	103,000,000	19.4255	(2,000,826,500)
2024100203399	B	USDMXN	10/16/2024	100,000,000	19.4492	(1,944,920,000)
2024101103690	B	USDMXN	10/16/2024	1,031,314	19.28053	(19,884,278)
2024101103005	S	USDMXN	10/16/2024	(3,000,000)	19.43908	58,317,240
2024101403513	B	USDMXN	10/16/2024	450,202	19.37472	(8,722,542)
2024101503166	S	USDMXN	10/16/2024	(150,000,000)	19.6	2,940,000,000
2024080703390	BO	USDMXN	10/17/2024	508,215	19.45134	(9,885,460)
2024082903439	BO	USDMXN	10/17/2024	1,155,309	19.9171	(23,010,410)
2024090503717	SO	USDMXN	10/17/2024	(318,497)	20.05111	6,386,218
2024091203129	B	USDMXN	10/17/2024	100,000,000	19.757	(1,975,700,000)
2024091203635	S	USDMXN	10/17/2024	(100,000,000)	19.6165	1,961,650,000
2024101503173	B	USDMXN	10/17/2024	150,000,000	19.63	(2,944,500,000)
2024101504024	S	USDMXN	10/17/2024	(2,805,461)	19.69467	55,252,637
2024101703257	B	USDMXN	10/17/2024	50,000,000	19.915	(995,750,000)
2024101703066	S	USDMXN	10/17/2024	(54,000,000)	19.918	1,075,572,000
2024101703255	S	USDMXN	10/17/2024	(50,000,000)	19.915	995,750,000
2024101703376	S	USDMXN	10/17/2024	(30,000,000)	19.95	598,500,000
2023082503307	SO	USDMXN	10/18/2024	(19,500)	18.04287	351,836
2024092503506	S	USDMXN	10/18/2024	(100,000,000)	19.6851	1,968,510,000
2024101603466	S	USDMXN	10/18/2024	(689,107)	19.9106	13,720,530
2024101703377	B	USDMXN	10/18/2024	30,000,000	19.9533	(598,599,000)
2024101703374	S	USDMXN	10/18/2024	(30,000,000)	19.95	598,500,000
2023101803170	SO	USDMXN	10/21/2024	(5,000,000)	19.48344	97,417,185
2023101803171	SO	USDMXN	10/21/2024	(500,000)	19.48337	9,741,684
2024071103667	BO	USDMXN	10/21/2024	50,000	18.10473	(905,237)
2024071703319	B	USDMXN	10/21/2024	50,000,000	18.017	(900,850,000)
2024091803640	B	USDMXN	10/21/2024	70,000,000	19.356	(1,354,920,000)
2024101703067	B	USDMXN	10/21/2024	54,000,000	19.9348	(1,076,479,200)
2024101703375	B	USDMXN	10/21/2024	30,000,000	19.9607	(598,821,000)
2024101703470	B	USDMXN	10/21/2024	4,000,000	19.3179	(77,271,600)
2024101703595	B	USDMXN	10/21/2024	444,530	19.88517	(8,839,559)
2024101803077	B	USDMXN	10/21/2024	101,497,082	19.705	(2,000,000,000)
2024101803390	B	USDMXN	10/21/2024	110,000,000	19.9	(2,189,000,000)
2024101803561	S	USDMXN	10/21/2024	(147,610)	19.8807	2,934,583
2024101803181	B	USDMXN	10/22/2024	1,000,000	19.82312	(19,823,120)
2024101803203	B	USDMXN	10/22/2024	1,000,000	19.82212	(19,822,120)
2024101803078	S	USDMXN	10/22/2024	(101,479,057)	19.7085	2,000,000,000
2024101803391	S	USDMXN	10/22/2024	(110,000,000)	19.9034	2,189,374,000
2024101803559	S	USDMXN	10/22/2024	(147,610)	19.8807	2,934,583
2023091503067	B	USDMXN	10/23/2024	250,000	18.27216	(4,568,041)
2023091903433	B	USDMXN	10/23/2024	250,000	18.278	(4,569,499)
2023092003161	B	USDMXN	10/23/2024	200,000	18.20791	(3,641,581)
2023101903333	S	USDMXN	10/23/2024	(4,500,000)	19.4	87,300,000
2023122203570	B	USDMXN	10/23/2024	600,000	17.85859	(10,715,155)
2024011203666	B	USDMXN	10/23/2024	78,724	17.66237	(1,390,453)
2024012303364	B	USDMXN	10/23/2024	190,235	18.17153	(3,456,863)
2024012403194	BO	USDMXN	10/23/2024	800,000	17.94123	(14,352,985)
2024072303569	SO	USDMXN	10/23/2024	(621,355)	18.39249	11,428,264
2024012203323	B	USDMXN	10/24/2024	10,000,000	17.928	(179,280,000)
2024012303657	S	USDMXN	10/24/2024	(50,000)	18.10838	905,419
2024072203534	S	USDMXN	10/24/2024	(50,000,000)	18.1935	909,675,000
2024082903445	BO	USDMXN	10/24/2024	126,527	19.94139	(2,523,124)
2024090503714	SO	USDMXN	10/24/2024	(122,393)	20.07821	2,457,432
2024102203112	B	USDMXN	10/24/2024	93,100	19.89259	(1,851,997)
2024102203241	B	USDMXN	10/24/2024	2,000,000	19.89335	(39,786,700)
2024102203125	S	USDMXN	10/24/2024	(2,000,000)	19.89082	39,781,640
2024102203242	S	USDMXN	10/24/2024	(10,000,000)	19.9	199,000,000
2024102203246	S	USDMXN	10/24/2024	(10,000,000)	19.9	199,000,000
2024102203524	S	USDMXN	10/24/2024	(10,000,000)	19.9	199,000,000
2024102403520	BO	USDMXN	10/24/2024	5,000,000	19.84338	(99,216,900)
2024102403529	BO	USDMXN	10/24/2024	5,000,000	19.83618	(99,180,900)
2023082503308	SO	USDMXN	10/25/2024	(19,500)	18.06142	352,198

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023092103377	S	USDMXN	10/25/2024	(19,500)	18.32718	357,380
2024072303152	S	USDMXN	10/25/2024	(50,000,000)	18.3165	915,825,000
2024082703880	SO	USDMXN	10/25/2024	(100,000)	19.94084	1,994,084
2024102303022	B	USDMXN	10/25/2024	2,000,000	19.99943	(39,998,860)
2024102303369	S	USDMXN	10/25/2024	(2,000,000)	19.89416	39,788,320
2024102303558	S	USDMXN	10/25/2024	(5,000,000)	19.86	99,300,000
2024102303571	S	USDMXN	10/25/2024	(5,000,000)	19.86	99,300,000
2024102303576	S	USDMXN	10/25/2024	(484,333)	19.86615	9,621,832
2024102303675	S	USDMXN	10/25/2024	(907,176)	19.82578	17,985,475
2024102303706	S	USDMXN	10/25/2024	(626,680)	19.8234	12,422,935
2024102403028	S	USDMXN	10/25/2024	(30,927,691)	19.8285	613,249,715
2023121503647	BO	USDMXN	10/28/2024	8,702	18.1299	(157,763)
2024071103666	BO	USDMXN	10/28/2024	50,000	18.12473	(906,236)
2024082203661	B	USDMXN	10/28/2024	50,000,000	19.6535	(982,675,000)
2024102403051	B	USDMXN	10/28/2024	1,000,000	19.83802	(19,838,020)
2024102403054	B	USDMXN	10/28/2024	1,000,000	19.83754	(19,837,540)
2024102403103	B	USDMXN	10/28/2024	60,000,000	19.85	(1,191,000,000)
2024102403262	B	USDMXN	10/28/2024	1,000,000	19.8327	(19,832,700)
2024102403508	B	USDMXN	10/28/2024	2,000,000	19.85	(39,700,000)
2024102403037	S	USDMXN	10/28/2024	(1,000,000)	19.87062	19,870,620
2024102403076	S	USDMXN	10/28/2024	(2,000,000)	19.86	39,720,000
2024102403091	S	USDMXN	10/28/2024	(1,000,000)	19.85873	19,858,730
2024102403392	S	USDMXN	10/28/2024	(3,000,000)	19.84	59,520,000
2024102403398	S	USDMXN	10/28/2024	(2,000,000)	19.84377	39,687,540
2024102403399	S	USDMXN	10/28/2024	(2,000,000)	19.845	39,690,000
2024102403572	S	USDMXN	10/28/2024	(28,289)	19.82009	560,694
2024102503289	S	USDMXN	10/28/2024	(20,000,000)	19.92	398,400,000
2024041803396	SO	USDMXN	10/29/2024	(96,514)	17.65945	1,704,384
2024052203408	SO	USDMXN	10/29/2024	(158,237)	17.06543	2,700,382
2024072303572	SO	USDMXN	10/29/2024	(141,589)	18.41269	2,607,034
2024102503290	B	USDMXN	10/29/2024	20,000,000	19.92315	(398,463,000)
2024102503587	B	USDMXN	10/29/2024	121,232	19.97653	(2,421,798)
2024102503652	B	USDMXN	10/29/2024	77,588	19.99173	(1,551,114)
2024102903153	B	USDMXN	10/29/2024	20,000,000	20	(400,000,000)
2024102903308	B	USDMXN	10/29/2024	30,000,000	20.01	(600,300,000)
2024102903343	B	USDMXN	10/29/2024	30,000,000	20	(600,000,000)
2024102903124	S	USDMXN	10/29/2024	(50,000,000)	20	1,000,000,000
2024040303293	SO	USDMXN	10/30/2024	(200,000)	17.08568	3,417,136
2024072603042	S	USDMXN	10/30/2024	(50,000,000)	18.7065	935,325,000
2024080103470	BON	USDMXN	10/30/2024	200,000,000	19.0865	(3,817,300,000)
2024082703239	SO	USDMXN	10/30/2024	(1,000,000)	19.74562	19,745,619
2024102803062	B	USDMXN	10/30/2024	2,000,000	20.05458	(40,109,160)
2024102803102	B	USDMXN	10/30/2024	2,000,000	20.03777	(40,075,540)
2024102803110	B	USDMXN	10/30/2024	68,000,000	20	(1,360,000,000)
2024102803124	B	USDMXN	10/30/2024	1,000,000	20.00993	(20,009,930)
2024102803148	B	USDMXN	10/30/2024	1,000,000	19.99805	(19,998,050)
2024102803275	B	USDMXN	10/30/2024	1,000,000	20.00843	(20,008,430)
2024102803364	B	USDMXN	10/30/2024	1,000,000	20.01107	(20,011,070)
2024102803177	S	USDMXN	10/30/2024	(2,000,000)	20.03	40,060,000
2024102803182	S	USDMXN	10/30/2024	(2,000,000)	20.04	40,080,000
2024102803591	S	USDMXN	10/30/2024	(2,000,000)	20.01	40,020,000
2024102903490	B	USDMXN	10/30/2024	35,000,000	20.043	(701,505,000)
2024102903154	S	USDMXN	10/30/2024	(20,000,000)	20.0033	400,066,000
2024102903309	S	USDMXN	10/30/2024	(30,000,000)	20.0133	600,399,000
2024102903344	S	USDMXN	10/30/2024	(30,000,000)	20.0033	600,099,000
2024103003336	B	USDMXN	10/30/2024	50,000,000	20.175	(1,008,750,000)
2024103003440	B	USDMXN	10/30/2024	50,000,000	20.16	(1,008,000,000)
2024103003322	S	USDMXN	10/30/2024	(100,000,000)	20.15	2,015,000,000
2024012903233	S	USDMXN	10/31/2024	(20,000,000)	17.99	359,800,000
2024012903245	S	USDMXN	10/31/2024	(10,000,000)	17.986	179,860,000
2024042603244	B	USDMXN	10/31/2024	30,000,000	17.6603	(529,809,000)
2024080903710	BO	USDMXN	10/31/2024	294,600	19.08015	(5,621,012)
2024102803723	S	USDMXN	10/31/2024	(3,000,000)	20.023	60,069,000
2024102903517	B	USDMXN	10/31/2024	3,000,000	20.06505	(60,195,150)
2024102903520	B	USDMXN	10/31/2024	4,000,000	20.07178	(80,287,120)
2024102903760	B	USDMXN	10/31/2024	155,684	20.06841	(3,124,330)
2024102903813	B	USDMXN	10/31/2024	5,000,000	18.9301	(94,650,500)
2024102903008	S	USDMXN	10/31/2024	(4,000,000)	20.045	80,180,000
2024102903009	S	USDMXN	10/31/2024	(1,000,000)	20.045	20,045,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024102903033	S	USDMXN	10/31/2024	(2,000,000)	20.02882	40,057,640
2024102903150	S	USDMXN	10/31/2024	(3,000,000)	19.99	59,970,000
2024102903160	S	USDMXN	10/31/2024	(1,000,000)	19.9944	19,994,400
2024102903188	S	USDMXN	10/31/2024	(1,000,000)	19.99336	19,993,360
2024102903189	S	USDMXN	10/31/2024	(1,000,000)	19.99502	19,995,020
2024102903201	S	USDMXN	10/31/2024	(1,000,000)	19.9923	19,992,300
2024102903218	S	USDMXN	10/31/2024	(3,000,000)	19.99086	59,972,580
2024102903491	S	USDMXN	10/31/2024	(35,000,000)	20.04628	701,619,625
2024102903814	S	USDMXN	10/31/2024	(282,543)	20.0845	5,674,744
2024103003323	B	USDMXN	10/31/2024	100,000,000	20.1529	(2,015,290,000)
2024103003337	S	USDMXN	10/31/2024	(50,000,000)	20.1781	1,008,905,000
2024103003441	S	USDMXN	10/31/2024	(50,000,000)	20.1632	1,008,160,000
2023082503309	SO	USDMXN	11/01/2024	(15,600)	18.07996	282,047
2023092103375	S	USDMXN	11/01/2024	(15,600)	18.34517	286,185
2023092503568	SO	USDMXN	11/01/2024	(15,600)	18.59884	290,142
2024080903708	BO	USDMXN	11/01/2024	152,000	19.08499	(2,900,918)
2024103003028	B	USDMXN	11/01/2024	131,051	20.15891	(2,641,844)
2024103003046	B	USDMXN	11/01/2024	1,000,000	20.1226	(20,122,600)
2024103003495	B	USDMXN	11/01/2024	2,000,000	20.17917	(40,358,340)
2024103003634	B	USDMXN	11/01/2024	2,000,000	20.18431	(40,368,620)
2024103003635	B	USDMXN	11/01/2024	60,181	20.18977	(1,215,043)
2024103003730	B	USDMXN	11/01/2024	43,050	20.16962	(868,302)
2024103003061	S	USDMXN	11/01/2024	(1,000,000)	20.09851	20,098,510
2024103003196	S	USDMXN	11/01/2024	(1,000,000)	20.18233	20,182,330
2024103003301	S	USDMXN	11/01/2024	(1,000,000)	20.18572	20,185,720
2024010303659	BO	USDMXN	11/04/2024	1,444	17.92624	(25,885)
2024013103492	B	USDMXN	11/04/2024	30,000,000	17.967	(539,010,000)
2024042903575	S	USDMXN	11/04/2024	(20,000,000)	17.53902	350,780,320
2024103103042	B	USDMXN	11/04/2024	1,000,000	20.07737	(20,077,370)
2024103103114	B	USDMXN	11/04/2024	1,000,000	20.05467	(20,054,670)
2024103103241	S	USDMXN	11/04/2024	(1,000,000)	20.04563	20,045,630
2024103103433	S	USDMXN	11/04/2024	(2,000,000)	20.06	40,120,000
2024103103527	S	USDMXN	11/04/2024	(23,846)	20.01474	477,271
2024010303660	SO	USDMXN	11/05/2024	(1,590)	17.90794	28,481
2024030603147	BO	USDMXN	11/05/2024	100,000	17.50477	(1,750,477)
2024110103100	B	USDMXN	11/05/2024	1,000,000	20.03157	(20,031,570)
2024110103107	B	USDMXN	11/05/2024	2,000,000	20.01017	(40,020,340)
2024110103349	B	USDMXN	11/05/2024	1,000,000	20.20325	(20,203,250)
2024110103412	B	USDMXN	11/05/2024	1,000,000	20.26319	(20,263,190)
2024110103707	B	USDMXN	11/05/2024	602,697	20.2782	(12,221,603)
2024110103031	S	USDMXN	11/05/2024	(1,000,000)	19.99854	19,998,540
2024110103034	S	USDMXN	11/05/2024	(1,000,000)	19.99501	19,995,010
2024110103072	S	USDMXN	11/05/2024	(1,000,000)	20.03077	20,030,770
2024110103330	S	USDMXN	11/05/2024	(1,000,000)	20.16039	20,160,390
2023110103618	B	USDMXN	11/06/2024	25,000,000	18.955	(473,875,000)
2024021303390	S	USDMXN	11/06/2024	(635,133)	17.9505	11,400,954
2024082103250	SO	USDMXN	11/06/2024	(585,216)	19.48992	11,405,813
2024110403073	B	USDMXN	11/06/2024	500,000	20.01562	(10,007,810)
2024110403138	B	USDMXN	11/06/2024	1,000,000	19.98974	(19,989,740)
2024110403178	B	USDMXN	11/06/2024	1,000,000	19.97946	(19,979,460)
2024110403433	B	USDMXN	11/06/2024	2,000,000	20.11963	(40,239,260)
2024110403692	B	USDMXN	11/06/2024	750,000	20.13064	(15,097,980)
2024110403721	B	USDMXN	11/06/2024	118,066	20.10709	(2,373,964)
2024110403061	S	USDMXN	11/06/2024	(50,000,000)	20.077	1,003,850,000
2024110403146	S	USDMXN	11/06/2024	(100,000,000)	19.975	1,997,500,000
2024110403195	S	USDMXN	11/06/2024	(2,000,000)	20.02557	40,051,140
2024110403301	S	USDMXN	11/06/2024	(1,000,000)	20.09955	20,099,550
2024110403306	S	USDMXN	11/06/2024	(1,000,000)	20.08961	20,089,610
2024110403570	S	USDMXN	11/06/2024	(172,804)	20.11877	3,476,599
2024110403648	S	USDMXN	11/06/2024	(1,000,000)	20.14	20,140,000
2023110303398	B	USDMXN	11/07/2024	10,000,000	18.50443	(185,044,340)
2024101703256	B	USDMXN	11/07/2024	50,000,000	19.9858	(999,290,000)
2024101703258	S	USDMXN	11/07/2024	(50,000,000)	19.9908	999,540,000
2024102903125	B	USDMXN	11/07/2024	50,000,000	20.0261	(1,001,305,000)
2024110403770	B	USDMXN	11/07/2024	850,000	20.11051	(17,093,934)
2024110503033	B	USDMXN	11/07/2024	3,000,000	20.11953	(60,358,590)
2024110503045	B	USDMXN	11/07/2024	2,000,000	20.12091	(40,241,820)
2024110503046	B	USDMXN	11/07/2024	2,000,000	20.11298	(40,225,960)
2024110503111	B	USDMXN	11/07/2024	2,000,000	20.18157	(40,363,140)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024110503316	B	USDMXN	11/07/2024	2,000,000	20.23027	(40,460,540)
2024110503496	B	USDMXN	11/07/2024	1,000,000	20.14	(20,140,000)
2024110503645	B	USDMXN	11/07/2024	136,039	20.07162	(2,730,515)
2024110503689	B	USDMXN	11/07/2024	44,452	20.08294	(892,731)
2024110503040	S	USDMXN	11/07/2024	(2,000,000)	20.13865	40,277,300
2024110503089	S	USDMXN	11/07/2024	(2,000,000)	20.15717	40,314,340
2024110503311	S	USDMXN	11/07/2024	(1,000,000)	20.32	20,320,000
2024110503480	S	USDMXN	11/07/2024	(2,000,000)	20.14023	40,280,460
2024110603075	B	USDMXN	11/07/2024	150,000,000	20.63	(3,094,500,000)
2023082503310	SO	USDMXN	11/08/2024	(15,600)	18.0985	282,337
2023092103373	S	USDMXN	11/08/2024	(15,600)	18.36368	286,473
2023092503569	SO	USDMXN	11/08/2024	(15,600)	18.61766	290,436
2023110303247	BO	USDMXN	11/08/2024	300,000	18.49545	(5,548,636)
2024080903454	BO	USDMXN	11/08/2024	250,000	19.08318	(4,770,795)
2024110503793	S	USDMXN	11/08/2024	(500,000)	20.36	10,180,000
2024110603420	B	USDMXN	11/08/2024	2,000,000	20.29228	(40,584,560)
2024110603421	B	USDMXN	11/08/2024	2,000,000	20.26693	(40,533,860)
2024110603423	B	USDMXN	11/08/2024	3,000,000	20.26554	(60,796,620)
2024110603443	B	USDMXN	11/08/2024	2,000,000	20.26399	(40,527,980)
2024110603447	B	USDMXN	11/08/2024	2,000,000	20.26193	(40,523,860)
2024110603000	S	USDMXN	11/08/2024	(500,000)	20.34702	10,173,510
2024110603076	S	USDMXN	11/08/2024	(150,000,000)	20.6334	3,095,010,000
2024110603079	S	USDMXN	11/08/2024	(1,000,000)	20.59	20,590,000
2024110603080	S	USDMXN	11/08/2024	(2,000,000)	20.6	41,200,000
2024110603480	S	USDMXN	11/08/2024	(2,000,000)	20.20607	40,412,140
2024110603497	S	USDMXN	11/08/2024	(2,000,000)	20.18003	40,360,060
2024110603661	S	USDMXN	11/08/2024	(699,165)	20.14919	14,087,604
2024110703447	B	USDMXN	11/08/2024	167,919	19.85	(3,333,192)
2024110703449	B	USDMXN	11/08/2024	1,877,431	19.85	(37,267,005)
2024110703450	B	USDMXN	11/08/2024	1,611,091	19.85	(31,980,156)
2024110703626	BO	USDMXN	11/08/2024	7,000,000	19.88234	(139,176,366)
2024110703630	BO	USDMXN	11/08/2024	5,000,000	19.84734	(99,236,685)
2024110703641	BO	USDMXN	11/08/2024	5,000,000	19.85234	(99,261,695)
2024110703697	BO	USDMXN	11/08/2024	5,000,000	19.82733	(99,136,655)
2024110703468	S	USDMXN	11/08/2024	(167,919)	19.85	3,333,192
2024110703469	S	USDMXN	11/08/2024	(1,877,431)	19.85	37,267,005
2024110703470	S	USDMXN	11/08/2024	(1,611,091)	19.85	31,980,156
2024110803082	BO	USDMXN	11/08/2024	2,000,000	20.04924	(40,098,484)
2024110803119	BO	USDMXN	11/08/2024	5,000,000	20.10144	(100,507,215)
2024110803397	BO	USDMXN	11/08/2024	1,000,000	20.20544	(20,205,439)
2024110803453	BO	USDMXN	11/08/2024	5,000,000	20.13044	(100,652,205)
2024030603149	BO	USDMXN	11/12/2024	100,000	17.5237	(1,752,370)
2024052203409	SO	USDMXN	11/12/2024	(222,274)	17.10009	3,800,905
2024080803071	B	USDMXN	11/12/2024	20,000,000	19.425	(388,500,000)
2024082703315	SO	USDMXN	11/12/2024	(191,070)	19.89858	3,802,022
2024102103328	SO	USDMXN	11/12/2024	(310,000)	20.0615	6,219,066
2024110703099	B	USDMXN	11/12/2024	2,000,000	19.80298	(39,605,960)
2024110703177	B	USDMXN	11/12/2024	2,000,000	19.79864	(39,597,280)
2024110703207	B	USDMXN	11/12/2024	1,000,000	19.80428	(19,804,280)
2024110703353	B	USDMXN	11/12/2024	3,000,000	19.85	(59,550,000)
2024110703590	B	USDMXN	11/12/2024	365,594	19.88219	(7,268,815)
2024110703612	B	USDMXN	11/12/2024	25,000	19.8528	(496,320)
2024110703227	S	USDMXN	11/12/2024	(2,000,000)	19.85	39,700,000
2024110703242	S	USDMXN	11/12/2024	(2,000,000)	19.85	39,700,000
2024110703244	S	USDMXN	11/12/2024	(1,000,000)	19.85	19,850,000
2024110703289	S	USDMXN	11/12/2024	(2,000,000)	19.88588	39,771,760
2024110703300	S	USDMXN	11/12/2024	(1,000,000)	19.87999	19,879,990
2024110703436	S	USDMXN	11/12/2024	(1,500,000)	19.87397	29,810,955
2024110703687	S	USDMXN	11/12/2024	(25,000)	19.83003	495,751
2024111203134	B	USDMXN	11/12/2024	70,000,000	20.46	(1,432,200,000)
2023082103451	B	USDMXN	11/13/2024	650,000	18.41642	(11,970,674)
2023082203070	BO	USDMXN	11/13/2024	450,000	18.31007	(8,239,532)
2023090603314	S	USDMXN	11/13/2024	(208,333)	18.9287	3,943,478
2023090803339	S	USDMXN	11/13/2024	(125,000)	18.88926	2,361,158
2023091303092	B	USDMXN	11/13/2024	500,000	18.43633	(9,218,165)
2023092603228	SO	USDMXN	11/13/2024	(166,667)	18.74556	3,124,261
2023100303503	SO	USDMXN	11/13/2024	(166,667)	19.16211	3,193,686
2023101703672	S	USDMXN	11/13/2024	(833,333)	19.2119	16,009,920
2024011203670	B	USDMXN	11/13/2024	58,267	17.72306	(1,032,669)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024012303368	B	USDMXN	11/13/2024	155,513	18.23225	(2,835,357)
2024110803044	B	USDMXN	11/13/2024	2,000,000	20.06653	(40,133,060)
2024110803093	B	USDMXN	11/13/2024	2,000,000	20.11598	(40,231,960)
2024110803532	B	USDMXN	11/13/2024	2,690,038	20.19239	(54,318,298)
2024110803034	S	USDMXN	11/13/2024	(1,000,000)	20.00069	20,000,690
2024110803040	S	USDMXN	11/13/2024	(1,000,000)	20.02893	20,028,930
2024110803089	S	USDMXN	11/13/2024	(2,000,000)	20.09366	40,187,320
2024111103147	B	USDMXN	11/13/2024	2,000,000	20.5009	(41,001,800)
2024111103172	B	USDMXN	11/13/2024	1,000,000	20.49058	(20,490,580)
2024111103217	B	USDMXN	11/13/2024	2,000,000	20.44271	(40,885,420)
2024111103056	S	USDMXN	11/13/2024	(2,000,000)	20.445	40,890,000
2024111103057	S	USDMXN	11/13/2024	(1,000,000)	20.455	20,455,000
2024111103062	S	USDMXN	11/13/2024	(2,000,000)	20.52643	41,052,860
2024111103306	S	USDMXN	11/13/2024	(2,000,000)	20.39474	40,789,480
2024111103308	S	USDMXN	11/13/2024	(1,000,000)	20.40117	20,401,170
2024111203135	S	USDMXN	11/13/2024	(70,000,000)	20.46345	1,432,441,500
2024021203128	B	USDMXN	11/14/2024	10,000,000	17.8375	(178,375,000)
2024082703881	SO	USDMXN	11/14/2024	(200,000)	20.00258	4,000,515
2024111203027	B	USDMXN	11/14/2024	2,000,000	20.40837	(40,816,740)
2024111203097	B	USDMXN	11/14/2024	2,000,000	20.45365	(40,907,300)
2024111203117	B	USDMXN	11/14/2024	2,000,000	20.46142	(40,922,840)
2024111203168	B	USDMXN	11/14/2024	3,000,000	20.56815	(61,704,450)
2024111203169	B	USDMXN	11/14/2024	2,500,000	20.56686	(51,417,150)
2024111203414	B	USDMXN	11/14/2024	1,000,000	20.62652	(20,626,520)
2024111203551	B	USDMXN	11/14/2024	100,000,000	20.585	(2,058,500,000)
2024111203026	S	USDMXN	11/14/2024	(2,000,000)	20.43902	40,878,040
2024111203089	S	USDMXN	11/14/2024	(2,000,000)	20.46401	40,928,020
2024111203099	S	USDMXN	11/14/2024	(1,000,000)	20.465	20,465,000
2024111203116	S	USDMXN	11/14/2024	(2,000,000)	20.4801	40,960,200
2024111203196	S	USDMXN	11/14/2024	(2,000,000)	20.55033	41,100,660
2024111203219	S	USDMXN	11/14/2024	(2,000,000)	20.545	41,090,000
2024111203250	S	USDMXN	11/14/2024	(2,000,000)	20.545	41,090,000
2024111203258	S	USDMXN	11/14/2024	(5,000,000)	20.55	102,750,000
2024111203264	S	USDMXN	11/14/2024	(2,000,000)	20.5497	41,099,400
2024111203353	S	USDMXN	11/14/2024	(1,246,826)	20.62586	25,716,857
2023082503311	SO	USDMXN	11/15/2024	(15,600)	18.11705	282,626
2023092103371	S	USDMXN	11/15/2024	(15,600)	18.38561	286,816
2023092503570	SO	USDMXN	11/15/2024	(15,600)	18.63647	290,729
2023110303262	BO	USDMXN	11/15/2024	300,000	18.5173	(5,555,190)
2023121903378	B	USDMXN	11/15/2024	1,544,003	18.04805	(27,866,244)
2023121903620	B	USDMXN	11/15/2024	1,369,211	18.04398	(24,706,011)
2024012403631	BO	USDMXN	11/15/2024	552,080	18.07289	(9,977,681)
2024021303044	B	USDMXN	11/15/2024	5,000,000	17.93436	(89,671,815)
2024071003590	BO	USDMXN	11/15/2024	250,000	18.18506	(4,546,264)
2024071003603	SO	USDMXN	11/15/2024	(250,000)	18.17765	4,544,411
2024071203375	BO	USDMXN	11/15/2024	250,000	18.02857	(4,507,144)
2024072203591	BO	USDMXN	11/15/2024	200,000	18.26365	(3,652,730)
2024111303054	B	USDMXN	11/15/2024	1,000,000	20.59262	(20,592,620)
2024111303058	B	USDMXN	11/15/2024	1,000,000	20.59123	(20,591,230)
2024111303215	B	USDMXN	11/15/2024	1,000,000	20.58745	(20,587,450)
2024111303265	B	USDMXN	11/15/2024	2,000,000	20.6	(41,200,000)
2024111303377	B	USDMXN	11/15/2024	2,000,000	20.58152	(41,163,040)
2024111303576	B	USDMXN	11/15/2024	10,000,000	20.475	(204,750,000)
2024111303581	B	USDMXN	11/15/2024	20,000,000	20.475	(409,500,000)
2024111303586	B	USDMXN	11/15/2024	20,000,000	20.48	(409,600,000)
2024111303024	S	USDMXN	11/15/2024	(1,000,000)	20.523	20,523,000
2024111303029	S	USDMXN	11/15/2024	(1,000,000)	20.52	20,520,000
2024111303040	S	USDMXN	11/15/2024	(1,000,000)	20.53383	20,533,830
2024111303060	S	USDMXN	11/15/2024	(151,112)	20.59237	3,111,760
2024111303220	S	USDMXN	11/15/2024	(1,000,000)	20.60797	20,607,970
2024111303250	S	USDMXN	11/15/2024	(1,000,000)	20.61106	20,611,060
2024111303254	S	USDMXN	11/15/2024	(1,000,000)	20.62735	20,627,350
2024111303470	S	USDMXN	11/15/2024	(1,000,000)	20.54385	20,543,850
2024111303486	S	USDMXN	11/15/2024	(1,000,000)	20.54647	20,546,470
2024111303609	S	USDMXN	11/15/2024	(495,000)	20.49229	10,143,684
2024111303685	S	USDMXN	11/15/2024	(3,000,000)	20.52	61,560,000
2024111303689	S	USDMXN	11/15/2024	(2,000,000)	20.52644	41,052,880
2024111403846	B	USDMXN	11/15/2024	5,000,000	20.39	(101,950,000)
2024010303614	BO	USDMXN	11/19/2024	6,588	17.9552	(118,289)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024021403274	S	USDMXN	11/19/2024	(20,000,000)	17.8795	357,590,000
2024030603150	BO	USDMXN	11/19/2024	100,000	17.54265	(1,754,265)
2024081503324	B	USDMXN	11/19/2024	30,000,000	18.923	(567,690,000)
2024091303616	B	USDMXN	11/19/2024	100,000,000	19.4125	(1,941,250,000)
2024111403074	B	USDMXN	11/19/2024	3,000,000	20.59507	(61,785,210)
2024111403080	B	USDMXN	11/19/2024	2,000,000	20.58463	(41,169,260)
2024111403122	B	USDMXN	11/19/2024	1,000,000	20.57839	(20,578,390)
2024111403178	B	USDMXN	11/19/2024	1,000,000	20.57408	(20,574,080)
2024111403371	B	USDMXN	11/19/2024	2,000,000	20.48398	(40,967,960)
2024111403532	B	USDMXN	11/19/2024	1,700,000	20.47331	(34,804,627)
2024111403541	B	USDMXN	11/19/2024	700,000	20.47253	(14,330,771)
2024111403607	B	USDMXN	11/19/2024	2,000,000	20.49018	(40,980,360)
2024111403694	B	USDMXN	11/19/2024	50,000,000	20.4	(1,020,000,000)
2024111403696	B	USDMXN	11/19/2024	50,000,000	20.39	(1,019,500,000)
2024111403698	B	USDMXN	11/19/2024	20,000,000	20.396	(407,920,000)
2024111403050	S	USDMXN	11/19/2024	(1,000,000)	20.62237	20,622,370
2024111403060	S	USDMXN	11/19/2024	(1,000,000)	20.6279	20,627,900
2024111403064	S	USDMXN	11/19/2024	(1,000,000)	20.6279	20,627,900
2024111403150	S	USDMXN	11/19/2024	(1,000,000)	20.56165	20,561,650
2024111403176	S	USDMXN	11/19/2024	(2,000,000)	20.57	41,140,000
2024111403309	S	USDMXN	11/19/2024	(1,000,000)	20.50759	20,507,590
2024111403321	S	USDMXN	11/19/2024	(1,000,000)	20.51675	20,516,750
2024111403611	S	USDMXN	11/19/2024	(2,000,000)	20.45224	40,904,480
2024111403847	S	USDMXN	11/19/2024	(5,000,000)	20.402	102,010,000
2024021303393	S	USDMXN	11/20/2024	(633,545)	17.98872	11,396,663
2024021503381	B	USDMXN	11/20/2024	20,000,000	17.844	(356,880,000)
2024021503829	B	USDMXN	11/20/2024	20,000,000	17.844	(356,880,000)
2024052103258	SO	USDMXN	11/20/2024	(666,316)	17.10965	11,400,432
2024081603175	BO	USDMXN	11/20/2024	874,000	18.91039	(16,527,681)
2024081603540	S	USDMXN	11/20/2024	(30,000,000)	18.909	567,270,000
2024082803364	SO	USDMXN	11/20/2024	(575,758)	19.8474	11,427,301
2024111403845	B	USDMXN	11/20/2024	1,000,000	20.41067	(20,410,670)
2024111503040	B	USDMXN	11/20/2024	1,000,000	20.45628	(20,456,280)
2024111503047	B	USDMXN	11/20/2024	1,000,000	20.47825	(20,478,250)
2024111503049	B	USDMXN	11/20/2024	2,000,000	20.46515	(40,930,300)
2024111503091	B	USDMXN	11/20/2024	2,000,000	20.44225	(40,884,500)
2024111503335	B	USDMXN	11/20/2024	2,000,000	20.35	(40,700,000)
2024111503353	B	USDMXN	11/20/2024	1,000,000	20.34632	(20,346,320)
2024111503707	B	USDMXN	11/20/2024	277,030	20.38594	(5,647,517)
2024111503790	B	USDMXN	11/20/2024	400,000	20.3883	(8,155,320)
2024111503872	B	USDMXN	11/20/2024	91,465	20.36581	(1,862,759)
2024111503032	S	USDMXN	11/20/2024	(1,000,000)	20.41136	20,411,360
2024111503195	S	USDMXN	11/20/2024	(1,000,000)	20.42628	20,426,280
2024111503212	S	USDMXN	11/20/2024	(1,000,000)	20.35571	20,355,710
2024111503214	S	USDMXN	11/20/2024	(2,000,000)	20.33312	40,666,240
2024111503299	S	USDMXN	11/20/2024	(1,000,000)	20.39234	20,392,340
2024111503319	S	USDMXN	11/20/2024	(1,000,000)	20.3867	20,386,700
2024111503390	S	USDMXN	11/20/2024	(1,000,000)	20.32761	20,327,610
2024111503599	S	USDMXN	11/20/2024	(1,000,000)	20.38	20,380,000
2024111503785	S	USDMXN	11/20/2024	(142,899)	20.3788	2,912,116
2024012303659	S	USDMXN	11/21/2024	(50,000)	18.18345	909,173
2024111203552	S	USDMXN	11/21/2024	(100,000,000)	20.6101	2,061,010,000
2024111903846	S	USDMXN	11/21/2024	(300,000)	20.09214	6,027,642
2024112103709	BO	USDMXN	11/21/2024	5,000,000	20.43095	(102,154,750)
2024112103713	BO	USDMXN	11/21/2024	5,000,000	20.42645	(102,132,250)
2023082503312	SO	USDMXN	11/22/2024	(15,600)	18.13559	282,915
2023092103369	S	USDMXN	11/22/2024	(15,600)	18.40242	287,078
2023092503571	SO	USDMXN	11/22/2024	(15,600)	18.65547	291,025
2023110303250	BO	USDMXN	11/22/2024	300,000	18.53795	(5,561,385)
2024112003121	B	USDMXN	11/22/2024	1,000,000	20.26497	(20,264,970)
2024112003128	B	USDMXN	11/22/2024	1,000,000	20.25098	(20,250,980)
2024112003133	B	USDMXN	11/22/2024	1,000,000	20.25299	(20,252,990)
2024112003205	B	USDMXN	11/22/2024	2,000,000	20.31269	(40,625,380)
2024112003291	B	USDMXN	11/22/2024	161,325	20.31869	(3,277,913)
2024112003621	B	USDMXN	11/22/2024	154,027	20.3152	(3,129,089)
2024112003058	S	USDMXN	11/22/2024	(1,000,000)	20.25311	20,253,110
2024112003155	S	USDMXN	11/22/2024	(1,000,000)	20.24167	20,241,670
2024112003156	S	USDMXN	11/22/2024	(1,000,000)	20.24518	20,245,180
2024112003199	S	USDMXN	11/22/2024	(1,000,000)	20.28059	20,280,590



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024112003201	S	USDMXN	11/22/2024	(1,000,000)	20.28496	20,284,960
2024112003225	S	USDMXN	11/22/2024	(1,000,000)	20.29873	20,298,730
2024112003226	S	USDMXN	11/22/2024	(1,000,000)	20.29514	20,295,140
2023121503649	BO	USDMXN	11/25/2024	8,663	18.21017	(157,758)
2024022103154	B	USDMXN	11/25/2024	20,000,000	17.822	(356,440,000)
2024112103043	B	USDMXN	11/25/2024	2,000,000	20.36	(40,720,000)
2024112103047	B	USDMXN	11/25/2024	1,000,000	20.34669	(20,346,690)
2024112103056	B	USDMXN	11/25/2024	1,000,000	20.3366	(20,336,600)
2024112103222	B	USDMXN	11/25/2024	2,000,000	20.36412	(40,728,240)
2024112103654	B	USDMXN	11/25/2024	3,000,000	20.445	(61,335,000)
2024112103656	B	USDMXN	11/25/2024	2,000,000	20.44498	(40,889,960)
2024112103671	B	USDMXN	11/25/2024	3,800,000	20.445	(77,691,000)
2024112103757	B	USDMXN	11/25/2024	1,000,000	20.40785	(20,407,850)
2024112103785	B	USDMXN	11/25/2024	148,683	20.4282	(3,037,322)
2024112103021	S	USDMXN	11/25/2024	(1,000,000)	20.37411	20,374,110
2024112103030	S	USDMXN	11/25/2024	(1,000,000)	20.38779	20,387,790
2024112103037	S	USDMXN	11/25/2024	(1,000,000)	20.3841	20,384,100
2024112103058	S	USDMXN	11/25/2024	(2,000,000)	20.35	40,700,000
2024112103059	S	USDMXN	11/25/2024	(2,000,000)	20.355	40,710,000
2024112103079	S	USDMXN	11/25/2024	(1,000,000)	20.32739	20,327,390
2024112103084	S	USDMXN	11/25/2024	(1,000,000)	20.32995	20,329,950
2024112103181	S	USDMXN	11/25/2024	(1,000,000)	20.34681	20,346,810
2024112103188	S	USDMXN	11/25/2024	(1,000,000)	20.35854	20,358,540
2024112103477	S	USDMXN	11/25/2024	(50,000,000)	20.42	1,021,000,000
2024112103504	S	USDMXN	11/25/2024	(146,615)	20.40095	2,991,078
2024112103738	S	USDMXN	11/25/2024	(98,458)	20.4202	2,010,537
2024112203100	B	USDMXN	11/25/2024	24,390,244	20.5	(500,000,000)
2024030603151	BO	USDMXN	11/26/2024	100,000	17.56129	(1,756,129)
2024052203344	SO	USDMXN	11/26/2024	(221,854)	17.12862	3,800,053
2024082203535	S	USDMXN	11/26/2024	(50,000,000)	19.74	987,000,000
2024082203662	S	USDMXN	11/26/2024	(50,000,000)	19.7405	987,025,000
2024092403039	B	USDMXN	11/26/2024	50,000,000	19.535	(976,750,000)
2024112203134	B	USDMXN	11/26/2024	1,000,000	20.49832	(20,498,320)
2024112203142	B	USDMXN	11/26/2024	1,000,000	20.505	(20,505,000)
2024112203371	B	USDMXN	11/26/2024	946,773	20.48282	(19,392,571)
2024112203522	B	USDMXN	11/26/2024	3,000,000	20.48	(61,440,000)
2024112203652	B	USDMXN	11/26/2024	430,000	20.4759	(8,804,637)
2024112203766	B	USDMXN	11/26/2024	532,309	20.49417	(10,909,229)
2024112203852	B	USDMXN	11/26/2024	79,491	20.41892	(1,623,116)
2024112203101	S	USDMXN	11/26/2024	(24,385,010)	20.5044	500,000,000
2024112203223	S	USDMXN	11/26/2024	(1,000,000)	20.47931	20,479,310
2024112203230	S	USDMXN	11/26/2024	(1,000,000)	20.506	20,506,000
2024112203233	S	USDMXN	11/26/2024	(1,000,000)	20.51976	20,519,760
2024112203326	S	USDMXN	11/26/2024	(1,000,000)	20.49064	20,490,640
2024112203334	S	USDMXN	11/26/2024	(2,000,000)	20.5	41,000,000
2024112203763	S	USDMXN	11/26/2024	(2,000,000)	20.48694	40,973,880
2023091903431	B	USDMXN	11/27/2024	250,000	18.38022	(4,595,056)
2023092003159	B	USDMXN	11/27/2024	300,000	18.31268	(5,493,803)
2023122203567	B	USDMXN	11/27/2024	600,000	17.96095	(10,776,568)
2024070903707	BO	USDMXN	11/27/2024	244,108	18.31568	(4,471,003)
2024082703536	BO	USDMXN	11/27/2024	1,567,751	19.9635	(31,297,802)
2024082703882	SO	USDMXN	11/27/2024	(100,000)	20.04309	2,004,309
2024092503425	B	USDMXN	11/27/2024	20,000,000	19.75177	(395,035,300)
2024102203571	BO	USDMXN	11/27/2024	63,300	20.07556	(1,270,783)
2024112503203	B	USDMXN	11/27/2024	2,000,000	20.315	(40,630,000)
2024112503206	B	USDMXN	11/27/2024	2,000,000	20.31	(40,620,000)
2024112503326	B	USDMXN	11/27/2024	4,794,000	20.32	(97,414,080)
2024112503336	B	USDMXN	11/27/2024	3,479,967	20.31037	(70,679,421)
2024112503340	B	USDMXN	11/27/2024	3,000,000	20.30976	(60,929,280)
2024112503707	B	USDMXN	11/27/2024	649,781	20.27739	(13,175,853)
2024112503057	S	USDMXN	11/27/2024	(1,000,000)	20.31065	20,310,650
2024112503058	S	USDMXN	11/27/2024	(1,000,000)	20.31067	20,310,670
2024112503137	S	USDMXN	11/27/2024	(1,000,000)	20.32	20,320,000
2024112503156	S	USDMXN	11/27/2024	(1,000,000)	20.33	20,330,000
2024112503447	S	USDMXN	11/27/2024	(3,000,000)	20.23913	60,717,390
2024112503596	S	USDMXN	11/27/2024	(280,311)	20.28607	5,686,405
2024112603728	BO	USDMXN	11/27/2024	5,000,000	20.6721	(103,360,500)
2024112603732	BO	USDMXN	11/27/2024	10,000,000	20.66865	(206,686,500)
2024112603736	BO	USDMXN	11/27/2024	3,000,000	20.66147	(61,984,401)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023082503313	SO	USDMXN	11/29/2024	(15,600)	18.15413	283,205
2023092103366	S	USDMXN	11/29/2024	(15,600)	18.41449	287,266
2023092503573	SO	USDMXN	11/29/2024	(15,600)	18.67557	291,339
2023110303251	BO	USDMXN	11/29/2024	300,000	18.5562	(5,566,859)
2024022603499	B	USDMXN	11/29/2024	9,000,000	17.8495	(160,645,500)
2024022603521	B	USDMXN	11/29/2024	10,000,000	17.8495	(178,495,000)
2024022603197	S	USDMXN	11/29/2024	(10,000,000)	17.86941	178,694,080
2024082703218	B	USDMXN	11/29/2024	50,000,000	19.948	(997,400,000)
2024102403104	S	USDMXN	11/29/2024	(60,000,000)	19.959	1,197,540,000
2024112603062	B	USDMXN	11/29/2024	2,000,000	20.6365	(41,273,000)
2024112603066	B	USDMXN	11/29/2024	1,000,000	20.644	(20,644,000)
2024112603231	B	USDMXN	11/29/2024	310,401	20.72156	(6,431,987)
2024112603398	B	USDMXN	11/29/2024	1,000,000	20.79883	(20,798,830)
2024112603038	S	USDMXN	11/29/2024	(1,000,000)	20.58152	20,581,520
2024112603046	S	USDMXN	11/29/2024	(1,000,000)	20.5908	20,590,800
2024112603337	S	USDMXN	11/29/2024	(2,000,000)	20.74	41,480,000
2024112603344	S	USDMXN	11/29/2024	(2,000,000)	20.74	41,480,000
2024112603377	S	USDMXN	11/29/2024	(1,000,000)	20.75593	20,755,930
2024112603533	S	USDMXN	11/29/2024	(3,000,000)	20.78	62,340,000
2024112603537	S	USDMXN	11/29/2024	(1,803,162)	20.7972	37,500,729
2024112603717	S	USDMXN	11/29/2024	(325,558)	20.67621	6,731,298
2024022803178	B	USDMXN	12/02/2024	15,000,000	17.84	(267,600,000)
2024042903678	S	USDMXN	12/02/2024	(30,000,000)	17.61967	528,590,220
2024112703004	B	USDMXN	12/02/2024	1,000,000	20.67548	(20,675,480)
2024112703005	B	USDMXN	12/02/2024	1,000,000	20.68294	(20,682,940)
2024112703142	B	USDMXN	12/02/2024	2,000,000	20.7	(41,400,000)
2024112703152	B	USDMXN	12/02/2024	1,000,000	20.67874	(20,678,740)
2024112703160	B	USDMXN	12/02/2024	1,000,000	20.66401	(20,664,010)
2024112703167	B	USDMXN	12/02/2024	1,000,000	20.65707	(20,657,070)
2024112703172	B	USDMXN	12/02/2024	1,000,000	20.63826	(20,638,260)
2024112703315	B	USDMXN	12/02/2024	1,000,000	20.62489	(20,624,890)
2024112703324	B	USDMXN	12/02/2024	1,000,000	20.57992	(20,579,920)
2024112703625	B	USDMXN	12/02/2024	30,432	20.63022	(627,822)
2024112703032	S	USDMXN	12/02/2024	(2,000,000)	20.69214	41,384,280
2024112703041	S	USDMXN	12/02/2024	(2,000,000)	20.7343	41,468,600
2024112703267	S	USDMXN	12/02/2024	(2,000,000)	20.65	41,300,000
2024112703322	S	USDMXN	12/02/2024	(1,000,000)	20.57234	20,572,340
2024112703327	S	USDMXN	12/02/2024	(1,000,000)	20.55438	20,554,380
2024112703396	S	USDMXN	12/02/2024	(1,000,000)	20.60737	20,607,370
2024112703499	S	USDMXN	12/02/2024	(345,444)	20.57258	7,106,667
2024112703574	S	USDMXN	12/02/2024	(1,000,000)	20.64505	20,645,050
2024112703591	S	USDMXN	12/02/2024	(1,000,000)	20.64563	20,645,630
2024112803727	B	USDMXN	12/02/2024	5,000,000	20.43	(102,150,000)
2024112903033	B	USDMXN	12/02/2024	100,000,000	20.4	(2,040,000,000)
2024112903921	B	USDMXN	12/02/2024	1,607,143	20.43	(32,833,928)
2024052303793	BO	USDMXN	12/03/2024	200,000	17.23658	(3,447,317)
2024112903009	B	USDMXN	12/03/2024	1,000,000	20.39911	(20,399,110)
2024112903035	B	USDMXN	12/03/2024	735,639	20.38709	(14,997,539)
2024112903118	B	USDMXN	12/03/2024	2,000,000	20.33	(40,660,000)
2024112903526	B	USDMXN	12/03/2024	1,000,000	20.33121	(20,331,210)
2024112903532	B	USDMXN	12/03/2024	1,000,000	20.32657	(20,326,570)
2024112903852	B	USDMXN	12/03/2024	3,392,857	20.43	(69,316,072)
2024112904046	B	USDMXN	12/03/2024	1,000,000	20.39355	(20,393,550)
2024112903034	S	USDMXN	12/03/2024	(100,000,000)	20.4057	2,040,570,000
2024112903086	S	USDMXN	12/03/2024	(1,000,000)	20.35421	20,354,210
2024112903089	S	USDMXN	12/03/2024	(1,000,000)	20.35681	20,356,810
2024112903090	S	USDMXN	12/03/2024	(50,000,000)	20.357	1,017,850,000
2024112903263	S	USDMXN	12/03/2024	(2,000,000)	20.2972	40,594,400
2024112903977	S	USDMXN	12/03/2024	(182,836)	20.35638	3,721,883
2024112903978	S	USDMXN	12/03/2024	(1,645,333)	20.35712	33,494,241
2023122003684	B	USDMXN	12/04/2024	68,541	18.14207	(1,243,479)
2024022903097	B	USDMXN	12/04/2024	10,000,000	17.807	(178,070,000)
2024032603665	SO	USDMXN	12/04/2024	(600,219)	17.30702	10,388,003
2024120203068	B	USDMXN	12/04/2024	1,000,000	20.5116	(20,511,600)
2024120203145	B	USDMXN	12/04/2024	2,000,000	20.4434	(40,886,800)
2024120203390	B	USDMXN	12/04/2024	1,000,000	20.38936	(20,389,360)
2024120203398	B	USDMXN	12/04/2024	1,000,000	20.39259	(20,392,590)
2024120203101	S	USDMXN	12/04/2024	(1,000,000)	20.45614	20,456,140
2024120203162	S	USDMXN	12/04/2024	(2,000,000)	20.48	40,960,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024120203393	S	USDMXN	12/04/2024	(50,000,000)	20.38	1,019,000,000
2024120203634	S	USDMXN	12/04/2024	(2,359,207)	20.38959	48,103,257
2024120203731	S	USDMXN	12/04/2024	(69,809)	20.39967	1,424,073
2024120303036	B	USDMXN	12/05/2024	1,000,000	20.38585	(20,385,850)
2024120303073	B	USDMXN	12/05/2024	1,000,000	20.36402	(20,364,020)
2024120303104	B	USDMXN	12/05/2024	1,000,000	20.3293	(20,329,300)
2024120303218	B	USDMXN	12/05/2024	502,960	20.31112	(10,215,681)
2024120303537	B	USDMXN	12/05/2024	2,000,000	20.33109	(40,662,180)
2024120303592	B	USDMXN	12/05/2024	2,000,000	20.336	(40,672,000)
2024120303613	B	USDMXN	12/05/2024	470,624	20.34426	(9,574,497)
2024120303738	B	USDMXN	12/05/2024	165,156	20.32124	(3,356,170)
2024120303028	S	USDMXN	12/05/2024	(1,000,000)	20.3689	20,368,900
2024120303133	S	USDMXN	12/05/2024	(2,000,000)	20.31453	40,629,060
2024120303322	S	USDMXN	12/05/2024	(1,000,000)	20.33575	20,335,750
2024120303324	S	USDMXN	12/05/2024	(1,000,000)	20.33631	20,336,310
2024120303674	S	USDMXN	12/05/2024	(5,000,000)	20.5	102,500,000
2023092103364	S	USDMXN	12/06/2024	(19,500)	18.43705	359,523
2023092503575	SO	USDMXN	12/06/2024	(19,500)	18.69358	364,525
2023110303252	BO	USDMXN	12/06/2024	300,000	18.57865	(5,573,594)
2024082703883	SO	USDMXN	12/06/2024	(100,000)	20.06974	2,006,974
2024110403147	B	USDMXN	12/06/2024	100,000,000	20.0803	(2,008,030,000)
2024112003319	BO	USDMXN	12/06/2024	10,000	20.35761	(203,576)
2024120403017	B	USDMXN	12/06/2024	1,000,000	20.3646	(20,364,600)
2024120403021	B	USDMXN	12/06/2024	2,000,000	20.3251	(40,650,200)
2024120403024	B	USDMXN	12/06/2024	1,000,000	20.3272	(20,327,200)
2024120403033	B	USDMXN	12/06/2024	1,000,000	20.32246	(20,322,460)
2024120403120	B	USDMXN	12/06/2024	1,000,000	20.3	(20,300,000)
2024120403673	B	USDMXN	12/06/2024	2,000,000	20.29805	(40,596,100)
2024120403698	B	USDMXN	12/06/2024	1,317,935	20.30259	(26,757,493)
2024120403016	S	USDMXN	12/06/2024	(1,000,000)	20.376	20,376,000
2024120403057	S	USDMXN	12/06/2024	(2,000,000)	20.314	40,628,000
2024120403062	S	USDMXN	12/06/2024	(2,000,000)	20.30708	40,614,160
2024120403116	S	USDMXN	12/06/2024	(1,000,000)	20.32519	20,325,190
2024120403514	S	USDMXN	12/06/2024	(2,336,579)	20.26152	47,342,640
2023120603118	S	USDMXN	12/09/2024	(5,000,000)	18.338	91,690,000
2024120503003	B	USDMXN	12/09/2024	1,000,000	20.25257	(20,252,570)
2024120503423	B	USDMXN	12/09/2024	1,000,000	20.21548	(20,215,480)
2024120503500	B	USDMXN	12/09/2024	5,000,000	20.2	(101,000,000)
2024120503504	B	USDMXN	12/09/2024	1,831,529	20.20002	(36,996,930)
2024120503529	B	USDMXN	12/09/2024	1,000,000	20.19368	(20,193,680)
2024120503678	B	USDMXN	12/09/2024	529,431	20.20808	(10,698,791)
2024120503022	S	USDMXN	12/09/2024	(1,000,000)	20.21835	20,218,350
2024120503262	S	USDMXN	12/09/2024	(1,000,000)	20.19762	20,197,620
2024120903499	B	USDMXN	12/09/2024	18,000,000	20.2	(363,600,000)
2024120503790	B	USDMXN	12/10/2024	979,609	20.20844	(19,796,370)
2024120603044	B	USDMXN	12/10/2024	2,000,000	20.22039	(40,440,780)
2024120603046	B	USDMXN	12/10/2024	2,000,000	20.19227	(40,384,540)
2024120603517	B	USDMXN	12/10/2024	2,167,784	20.21769	(43,827,583)
2024120603030	S	USDMXN	12/10/2024	(1,000,000)	20.15285	20,152,850
2024120603031	S	USDMXN	12/10/2024	(1,000,000)	20.15466	20,154,660
2024120603032	S	USDMXN	12/10/2024	(1,000,000)	20.15303	20,153,030
2024120603042	S	USDMXN	12/10/2024	(1,000,000)	20.19936	20,199,360
2024120603166	S	USDMXN	12/10/2024	(1,000,000)	20.22932	20,229,320
2024120903500	S	USDMXN	12/10/2024	(18,000,000)	20.2043	363,677,400
2023082103449	B	USDMXN	12/11/2024	500,000	18.4962	(9,248,099)
2023082203069	BO	USDMXN	12/11/2024	250,000	18.38872	(4,597,180)
2023091403624	B	USDMXN	12/11/2024	200,000	18.44461	(3,688,922)
2023091503064	B	USDMXN	12/11/2024	250,000	18.41398	(4,603,496)
2023091903428	B	USDMXN	12/11/2024	350,000	18.41517	(6,445,308)
2023092003155	B	USDMXN	12/11/2024	200,000	18.35134	(3,670,268)
2023122203564	B	USDMXN	12/11/2024	600,000	18.00067	(10,800,400)
2024120903215	B	USDMXN	12/11/2024	2,000,000	20.135	(40,270,000)
2024120903219	B	USDMXN	12/11/2024	1,000,000	20.13692	(20,136,920)
2024120903229	B	USDMXN	12/11/2024	1,000,000	20.13379	(20,133,790)
2024120903310	B	USDMXN	12/11/2024	1,000,000	20.17721	(20,177,210)
2024120903339	B	USDMXN	12/11/2024	1,000,000	20.17289	(20,172,890)
2024120903532	B	USDMXN	12/11/2024	2,000,000	20.18	(40,360,000)
2024120903576	B	USDMXN	12/11/2024	60,739	20.17687	(1,225,527)
2024120903059	S	USDMXN	12/11/2024	(1,000,000)	20.1604	20,160,400

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024120903191	S	USDMXN	12/11/2024	(1,000,000)	20.15791	20,157,910
2024120903290	S	USDMXN	12/11/2024	(2,000,000)	20.15	40,300,000
2024120903302	S	USDMXN	12/11/2024	(1,000,000)	20.1567	20,156,700
2024120903307	S	USDMXN	12/11/2024	(1,000,000)	20.16214	20,162,140
2024120903391	S	USDMXN	12/11/2024	(2,000,000)	20.1997	40,399,400
2024121103269	B	USDMXN	12/11/2024	9,935,420	20.13	(200,000,000)
2023092103362	S	USDMXN	12/13/2024	(19,500)	18.45506	359,874
2023092503577	SO	USDMXN	12/13/2024	(19,500)	18.71238	364,891
2023110303253	BO	USDMXN	12/13/2024	300,000	18.59859	(5,579,578)
2024082703884	SO	USDMXN	12/13/2024	(200,000)	20.09016	4,018,032
2024121003071	B	USDMXN	12/13/2024	1,000,000	20.22184	(20,221,840)
2024121003116	B	USDMXN	12/13/2024	1,000,000	20.29644	(20,296,440)
2024121003270	B	USDMXN	12/13/2024	14,813	20.27033	(300,274)
2024121003462	B	USDMXN	12/13/2024	2,000,000	20.2117	(40,423,400)
2024121003718	B	USDMXN	12/13/2024	30,000,000	20.175	(605,250,000)
2024121003065	S	USDMXN	12/13/2024	(1,000,000)	20.19343	20,193,430
2024121003590	S	USDMXN	12/13/2024	(2,000,000)	20.15102	40,302,040
2024121003609	S	USDMXN	12/13/2024	(2,000,000)	20.17407	40,348,140
2024121003616	S	USDMXN	12/13/2024	(2,000,000)	20.17247	40,344,940
2024121003720	S	USDMXN	12/13/2024	(20,000,000)	20.175	403,500,000
2024121003820	S	USDMXN	12/13/2024	(1,000,000)	20.1604	20,160,400
2024121003821	S	USDMXN	12/13/2024	(256,617)	20.16065	5,173,565
2024121103270	S	USDMXN	12/13/2024	(9,932,361)	20.1362	200,000,000
2024121303621	B	USDMXN	12/13/2024	49,677,099	20.13	(1,000,000,000)
2024121303618	S	USDMXN	12/13/2024	(60,000,000)	20.136	1,208,160,000
2025010703488	B	USDMXN	12/13/2024	10,000,000	17.446	(174,460,000)
2023121903382	B	USDMXN	12/16/2024	1,429,994	18.13569	(25,933,935)
2023121903622	B	USDMXN	12/16/2024	1,268,108	18.13064	(22,991,602)
2024012403632	BO	USDMXN	12/16/2024	595,842	18.1605	(10,820,790)
2024031303112	S	USDMXN	12/16/2024	(20,000,000)	17.481	349,620,000
2024090303753	BO	USDMXN	12/16/2024	120,000	20.1983	(2,423,795)
2024121103158	B	USDMXN	12/16/2024	3,000,000	20.18946	(60,568,380)
2024121103171	B	USDMXN	12/16/2024	2,000,000	20.15114	(40,302,280)
2024121103194	B	USDMXN	12/16/2024	1,000,000	20.14381	(20,143,810)
2024121103226	B	USDMXN	12/16/2024	1,000,000	20.14685	(20,146,850)
2024121103417	B	USDMXN	12/16/2024	1,000,000	20.14	(20,140,000)
2024121103583	B	USDMXN	12/16/2024	110,268	20.13768	(2,220,539)
2024121103819	B	USDMXN	12/16/2024	616,113	20.1176	(12,394,721)
2024121103076	S	USDMXN	12/16/2024	(1,000,000)	20.2159	20,215,900
2024121103082	S	USDMXN	12/16/2024	(1,000,000)	20.22784	20,227,840
2024121103084	S	USDMXN	12/16/2024	(1,000,000)	20.22355	20,223,550
2024121103254	S	USDMXN	12/16/2024	(3,000,000)	20.12262	60,367,860
2024121103273	S	USDMXN	12/16/2024	(3,000,000)	20.13686	60,410,580
2024121103406	S	USDMXN	12/16/2024	(1,000,000)	20.16162	20,161,620
2024121303619	B	USDMXN	12/16/2024	60,000,000	20.1462	(1,208,772,000)
2024121303622	S	USDMXN	12/16/2024	(49,652,433)	20.14	1,000,000,000
2024121303627	S	USDMXN	12/16/2024	(70,000,000)	20.117	1,408,190,000
2024091103149	BON	USDMXN	12/17/2024	200,000,000	20.2105	(4,042,100,000)
2024091203310	B	USDMXN	12/17/2024	100,000,000	19.819	(1,981,900,000)
2024121303058	B	USDMXN	12/17/2024	2,000,000	20.18484	(40,369,680)
2024121303628	B	USDMXN	12/17/2024	70,000,000	20.1208	(1,408,456,000)
2024121303894	B	USDMXN	12/17/2024	2,000,000	20.11793	(40,235,860)
2024121304038	B	USDMXN	12/17/2024	2,000,000	20.1422	(40,284,400)
2024121304077	B	USDMXN	12/17/2024	1,000,000	20.14888	(20,148,880)
2024121304094	B	USDMXN	12/17/2024	354,488	20.14969	(7,142,824)
2024121303028	S	USDMXN	12/17/2024	(1,000,000)	20.23691	20,236,910
2024121303029	S	USDMXN	12/17/2024	(1,000,000)	20.24642	20,246,420
2024121303617	S	USDMXN	12/17/2024	(2,000,000)	20.14	40,280,000
2023090603316	S	USDMXN	12/18/2024	(208,333)	19.02945	3,964,468
2023090803341	S	USDMXN	12/18/2024	(125,000)	18.98358	2,372,947
2023092603229	SO	USDMXN	12/18/2024	(166,667)	18.84453	3,140,755
2023100303504	SO	USDMXN	12/18/2024	(166,667)	19.25142	3,208,570
2023101703668	S	USDMXN	12/18/2024	(833,333)	19.30887	16,090,723
2024011203672	B	USDMXN	12/18/2024	58,325	17.82006	(1,039,355)
2024012303370	B	USDMXN	12/18/2024	179,208	18.33142	(3,285,142)
2024032603666	SO	USDMXN	12/18/2024	(598,940)	17.34365	10,387,804
2024061403398	S	USDMXN	12/18/2024	(15,000,000)	19.029	285,435,000
2024061703047	S	USDMXN	12/18/2024	(12,000,000)	19.153	229,836,000
2024091803046	S	USDMXN	12/18/2024	(74,720,755)	19.4917	1,456,434,547

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024091903025	B	USDMXN	12/18/2024	41,751,512	19.5344	(815,590,729)
2024102403029	B	USDMXN	12/18/2024	30,642,874	20.0128	(613,249,715)
2024121603068	B	USDMXN	12/18/2024	500,000	20.19134	(10,095,670)
2024121603109	B	USDMXN	12/18/2024	2,000,000	20.14726	(40,294,520)
2024121603254	B	USDMXN	12/18/2024	2,000,000	20.15924	(40,318,480)
2024121603255	B	USDMXN	12/18/2024	1,694,624	20.1611	(34,165,490)
2024121603292	B	USDMXN	12/18/2024	1,694,624	20.15238	(34,150,713)
2024121603293	B	USDMXN	12/18/2024	300,000	20.14688	(6,044,064)
2024121603851	B	USDMXN	12/18/2024	480,542	20.14759	(9,681,759)
2024121603074	S	USDMXN	12/18/2024	(2,000,000)	20.18721	40,374,420
2024121603155	S	USDMXN	12/18/2024	(3,000,000)	20.1699	60,509,700
2024121603239	S	USDMXN	12/18/2024	(2,000,000)	20.18346	40,366,920
2024121603389	S	USDMXN	12/18/2024	(7,700,000)	20.125	154,962,500
2024121603403	S	USDMXN	12/18/2024	(10,000,000)	20.115	201,150,000
2024121603414	S	USDMXN	12/18/2024	(10,000,000)	20.12	201,200,000
2024121603439	S	USDMXN	12/18/2024	(5,000,000)	20.11376	100,568,800
2024121603440	S	USDMXN	12/18/2024	(6,000,000)	20.125	120,750,000
2024121603462	S	USDMXN	12/18/2024	(5,000,000)	20.12	100,600,000
2024121603464	S	USDMXN	12/18/2024	(4,000,000)	20.11624	80,464,960
2024121603568	S	USDMXN	12/18/2024	(2,000,000)	20.12129	40,242,580
2024121603581	S	USDMXN	12/18/2024	(2,000,000)	20.1206	40,241,200
2024121603800	S	USDMXN	12/18/2024	(1,000,000)	20.12571	20,125,710
2024121603809	S	USDMXN	12/18/2024	(699,134)	20.13011	14,073,653
2024111403695	S	USDMXN	12/19/2024	(50,000,000)	20.508	1,025,400,000
2024111403697	S	USDMXN	12/19/2024	(50,000,000)	20.498	1,024,900,000
2024111403699	S	USDMXN	12/19/2024	(20,000,000)	20.504	410,080,000
2024121703092	B	USDMXN	12/19/2024	1,000,000	20.19729	(20,197,290)
2024121703095	B	USDMXN	12/19/2024	1,000,000	20.19747	(20,197,470)
2024121703192	B	USDMXN	12/19/2024	1,000,000	20.22792	(20,227,920)
2024121703620	B	USDMXN	12/19/2024	989,407	20.24242	(20,027,984)
2024121703653	B	USDMXN	12/19/2024	429,147	20.22651	(8,680,155)
2024121703665	B	USDMXN	12/19/2024	2,000,000	20.21924	(40,438,480)
2024121703666	B	USDMXN	12/19/2024	2,000,000	20.21757	(40,435,140)
2024121703277	S	USDMXN	12/19/2024	(2,000,000)	20.26	40,520,000
2024121703298	S	USDMXN	12/19/2024	(1,000,000)	20.2619	20,261,900
2024121703333	S	USDMXN	12/19/2024	(1,000,000)	20.26248	20,262,480
2024121703360	S	USDMXN	12/19/2024	(563,103)	20.27535	11,417,105
2024121703809	S	USDMXN	12/19/2024	(2,000,000)	20.20002	40,400,040
2024121703909	S	USDMXN	12/19/2024	(377,466)	20.17832	7,616,630
2023092103359	S	USDMXN	12/20/2024	(19,500)	18.47261	360,216
2023092503578	SO	USDMXN	12/20/2024	(19,500)	18.73128	365,260
2024021503491	B	USDMXN	12/20/2024	10,000,000	17.904	(179,040,000)
2024021503843	B	USDMXN	12/20/2024	10,000,000	17.904	(179,040,000)
2024031503182	B	USDMXN	12/20/2024	30,000,000	17.437	(523,110,000)
2024080803032	BO	USDMXN	12/20/2024	265,000	19.56518	(5,184,773)
2024121803021	S	USDMXN	12/20/2024	(3,000,000)	20.125	60,375,000
2024121803024	S	USDMXN	12/20/2024	(5,000,000)	20.13	100,650,000
2024121803025	S	USDMXN	12/20/2024	(2,000,000)	20.12942	40,258,840
2024121803032	S	USDMXN	12/20/2024	(1,000,000)	20.08893	20,088,930
2024121903630	B	USDMXN	12/23/2024	1,216,064	20.31251	(24,701,311)
2024121903711	B	USDMXN	12/23/2024	2,000,000	20.31	(40,620,000)
2024121903760	B	USDMXN	12/23/2024	5,000,000	20.32329	(101,616,450)
2024121903761	B	USDMXN	12/23/2024	1,000,000	20.31	(20,310,000)
2024121903765	B	USDMXN	12/23/2024	5,575,961	20.32	(113,303,529)
2024121903031	S	USDMXN	12/23/2024	(5,000,000)	20.36	101,800,000
2024121903695	S	USDMXN	12/23/2024	(1,000,000)	20.32504	20,325,040
2024121903812	B	USDMXN	12/24/2024	3,000,000	20.33186	(60,995,580)
2024122003767	B	USDMXN	12/24/2024	1,942,974	20.08204	(39,018,886)
2024122004056	B	USDMXN	12/24/2024	5,500,000	20.05	(110,275,000)
2024122004058	B	USDMXN	12/24/2024	4,306,649	20.05	(86,348,312)
2024012303661	S	USDMXN	12/26/2024	(50,000)	18.27966	913,983
2024112103478	B	USDMXN	12/26/2024	50,000,000	20.5345	(1,026,725,000)
2024122303821	B	USDMXN	12/26/2024	1,401,897	20.20869	(28,330,504)
2024122303669	S	USDMXN	12/26/2024	(512,892)	20.20977	10,365,424
2023092103357	S	USDMXN	12/27/2024	(19,500)	18.49271	360,608
2023092503579	SO	USDMXN	12/27/2024	(19,500)	18.75019	365,629
2024060703167	SO	USDMXN	12/30/2024	(200,000)	18.8047	3,760,941
2024071803388	SO	USDMXN	12/30/2024	(200,000)	18.482	3,696,400
2024082803367	SO	USDMXN	12/30/2024	(385,482)	19.98412	7,703,518



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024122603180	S	USDMXN	12/30/2024	(1,467,510)	20.19029	29,629,446
2024122603397	S	USDMXN	12/30/2024	(1,478,801)	20.22203	29,904,361
2024102803113	SON	USDMXN	12/31/2024	(68,000,000)	20.208	1,374,144,000
2024112603206	B	USDMXN	12/31/2024	100,000,000	20.825	(2,082,500,000)
2024122703085	S	USDMXN	12/31/2024	(2,000,000)	20.37019	40,740,380
2024091103753	BO	EURMXN	10/22/2024	1,400,000	21.9755	(30,765,696)
2024091103755	BO	EURMXN	10/22/2024	1,400,000	21.9755	(30,765,696)
2024111203033	BO	EURMXN	11/13/2024	1,000,000	21.7016	(21,701,604)
2024111203042	BO	EURMXN	11/13/2024	1,000,000	21.7016	(21,701,604)
2024111203043	SO	EURMXN	11/13/2024	(1,000,000)	21.72213	21,722,128
2024111203045	SO	EURMXN	11/13/2024	(1,000,000)	21.72213	21,722,128
2024121003492	B	EURMXN	12/11/2024	741,402	21.2135	(15,727,724)
2024121003520	S	EURMXN	12/11/2024	(741,402)	21.2071	15,722,979
2024111903684	BO	EURMXN	12/18/2024	1,000,000	21.44714	(21,447,135)
2024111903688	BO	EURMXN	12/18/2024	1,000,000	21.44714	(21,447,135)
2024111903842	SO	EURMXN	12/18/2024	(1,000,000)	21.41348	21,413,480
2024111903845	SO	EURMXN	12/18/2024	(1,000,000)	21.41348	21,413,480
2023110303157	B	USDMXN	10/02/2024	25,000,000	18.347	(458,675,000)
2023110303210	B	USDMXN	10/02/2024	25,969,641	18.347	(476,465,000)
2023110303162	S	USDMXN	10/02/2024	(25,000,000)	18.386	459,650,000
2024073103740	S	USDMXN	10/02/2024	(50,000,000)	18.739	936,950,000
2024092703197	B	USDMXN	10/02/2024	93,000,000	19.60633	(1,823,388,225)
2024092703199	B	USDMXN	10/02/2024	109,650	19.6229	(2,151,652)
2024092703626	S	USDMXN	10/02/2024	(50,000,000)	19.6829	984,145,000
2024093003204	B	USDMXN	10/02/2024	50,000,000	19.6093	(980,465,000)
2024093003308	B	USDMXN	10/02/2024	3,840,790	19.66431	(75,526,488)
2024093003404	B	USDMXN	10/02/2024	100,000,000	19.6266	(1,962,660,000)
2024093003065	S	USDMXN	10/02/2024	(30,014,417)	19.6457	589,654,230
2024093003424	S	USDMXN	10/02/2024	(100,000,000)	19.63	1,963,000,000
2024100203555	B	USDMXN	10/02/2024	19,042,717	19.43	(370,000,000)
2024100203218	S	USDMXN	10/02/2024	(30,000,000)	19.349	580,470,000
2024100203494	S	USDMXN	10/02/2024	(19,042,717)	19.43	370,000,000
2024100203531	S	USDMXN	10/02/2024	(19,042,717)	19.43	370,000,000
2024093003425	B	USDMXN	10/03/2024	100,000,000	19.63315	(1,963,315,000)
2024093003430	B	USDMXN	10/03/2024	358,000	19.6386	(7,030,619)
2024093003309	S	USDMXN	10/03/2024	(3,840,790)	19.6673	75,537,968
2024100203048	B	USDMXN	10/03/2024	131,807,349	19.5202	(2,572,905,808)
2024100203219	B	USDMXN	10/03/2024	30,000,000	19.35215	(580,564,500)
2024100203495	B	USDMXN	10/03/2024	19,039,876	19.4329	(370,000,000)
2024100203532	B	USDMXN	10/03/2024	19,039,876	19.4329	(370,000,000)
2024100203459	S	USDMXN	10/03/2024	(23,000,000)	19.42	446,660,000
2024100203471	S	USDMXN	10/03/2024	(244,296)	19.42256	4,744,856
2024100203556	S	USDMXN	10/03/2024	(19,039,876)	19.4329	370,000,000
2024100203460	B	USDMXN	10/04/2024	23,000,000	19.42335	(446,737,050)
2024100203472	B	USDMXN	10/04/2024	244,296	19.4259	(4,745,671)
2024100203063	S	USDMXN	10/04/2024	(30,000,000)	19.51	585,300,000
2024100203065	S	USDMXN	10/04/2024	(70,000,000)	19.51	1,365,700,000
2024100203081	S	USDMXN	10/04/2024	(50,000,000)	19.447	972,350,000
2024100203712	S	USDMXN	10/04/2024	(1,550,000)	19.44132	30,134,046
2024100303262	B	USDMXN	10/04/2024	51,347,000	19.475	(999,982,825)
2024100303276	B	USDMXN	10/04/2024	47,996	19.43766	(932,921)
2024100303500	B	USDMXN	10/04/2024	24,000,000	19.32	(463,680,000)
2023100403235	S	USDMXN	10/07/2024	(10,000,000)	19.138	191,380,000
2024040303230	B	USDMXN	10/07/2024	30,000,000	17.059	(511,770,000)
2024070203767	B	USDMXN	10/07/2024	70,000,000	18.525	(1,296,750,000)
2024090303057	B	USDMXN	10/07/2024	30,000,000	19.9895	(599,685,000)
2024100303263	S	USDMXN	10/07/2024	(51,347,000)	19.4847	1,000,480,891
2024100303277	S	USDMXN	10/07/2024	(47,996)	19.4469	933,365
2024100303501	S	USDMXN	10/07/2024	(24,000,000)	19.3292	463,900,800
2024100403311	S	USDMXN	10/07/2024	(5,766,492)	19.20078	110,721,120
2024100403312	B	USDMXN	10/08/2024	5,766,492	19.204	(110,739,712)
2024100403424	B	USDMXN	10/08/2024	50,000,000	19.285	(964,250,000)
2024100403582	B	USDMXN	10/08/2024	50,000,000	19.27	(963,500,000)
2024100403585	B	USDMXN	10/08/2024	30,000,000	19.266	(577,980,000)
2024100403196	S	USDMXN	10/08/2024	(20,000,000)	19.175	383,500,000
2024100703345	S	USDMXN	10/08/2024	(226,000,000)	19.315	4,365,190,000
2024100703390	S	USDMXN	10/08/2024	(95,070)	19.30853	1,835,666
2024100703346	B	USDMXN	10/09/2024	226,000,000	19.31815	(4,365,901,900)
2024100703391	B	USDMXN	10/09/2024	95,070	19.3118	(1,835,978)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024100803043	S	USDMXN	10/09/2024	(97,887,000)	19.41	1,899,986,670
2024100803045	S	USDMXN	10/09/2024	(198,093,000)	19.41	3,844,985,130
2024100803064	S	USDMXN	10/09/2024	(70,028)	19.39693	1,358,333
2024100803087	S	USDMXN	10/09/2024	(20,000)	19.37763	387,553
2024070803435	S	USDMXN	10/10/2024	(50,000,000)	18.2525	912,625,000
2024093003267	B	USDMXN	10/10/2024	100,000,000	19.695	(1,969,500,000)
2024100803044	B	USDMXN	10/10/2024	97,887,000	19.41315	(1,900,295,014)
2024100803046	B	USDMXN	10/10/2024	198,093,000	19.41315	(3,845,609,123)
2024100803065	B	USDMXN	10/10/2024	70,028	19.4002	(1,358,563)
2024100803088	B	USDMXN	10/10/2024	20,000	19.3809	(387,618)
2024100803017	S	USDMXN	10/10/2024	(50,000,000)	19.321	966,050,000
2024100803059	S	USDMXN	10/10/2024	(40,000,000)	19.395	775,800,000
2024100803579	S	USDMXN	10/10/2024	(100,000,000)	19.34	1,934,000,000
2024100903039	S	USDMXN	10/10/2024	(83,409,884)	19.4	1,618,151,746
2024100903153	S	USDMXN	10/10/2024	(51,500,000)	19.415	999,872,500
2024100903161	S	USDMXN	10/10/2024	(51,500,000)	19.415	999,872,500
2024100903164	S	USDMXN	10/10/2024	(10,000,000)	19.415	194,150,000
2024100903167	S	USDMXN	10/10/2024	(140,839)	19.40446	2,732,904
2024100903574	S	USDMXN	10/10/2024	(8,500,000)	19.48	165,580,000
2024010903628	S	USDMXN	10/11/2024	(10,000,000)	17.7625	177,625,000
2024100903103	B	USDMXN	10/11/2024	906,000	19.39796	(17,574,552)
2024100903154	B	USDMXN	10/11/2024	51,500,000	19.4181	(1,000,032,150)
2024100903162	B	USDMXN	10/11/2024	51,500,000	19.4181	(1,000,032,150)
2024100903165	B	USDMXN	10/11/2024	10,000,000	19.4181	(194,181,000)
2024100903168	B	USDMXN	10/11/2024	140,839	19.4077	(2,733,360)
2024100903381	B	USDMXN	10/11/2024	231,000,000	19.427	(4,487,637,000)
2024100903575	B	USDMXN	10/11/2024	8,500,000	19.4831	(165,606,350)
2024100903383	S	USDMXN	10/11/2024	(150,000,000)	19.427	2,914,050,000
2024100903605	S	USDMXN	10/11/2024	(30,000,000)	19.475	584,250,000
2024101003354	B	USDMXN	10/11/2024	153,000,000	19.54	(2,989,620,000)
2024101003370	B	USDMXN	10/11/2024	623,879	19.52146	(12,179,017)
2023101003200	S	USDMXN	10/15/2024	(15,000,000)	19.12	286,800,000
2024030703491	BO	USDMXN	10/15/2024	540,000	17.44867	(9,422,281)
2024041103459	B	USDMXN	10/15/2024	5,000,000	16.943	(84,715,000)
2024041103468	B	USDMXN	10/15/2024	15,000,000	16.943	(254,145,000)
2024050603502	BO	USDMXN	10/15/2024	160,000	17.30158	(2,768,253)
2024050603509	BO	USDMXN	10/15/2024	160,000	17.30158	(2,768,253)
2024071003332	B	USDMXN	10/15/2024	50,000,000	18.0835	(904,175,000)
2024091003470	S	USDMXN	10/15/2024	(50,000,000)	20.162	1,008,100,000
2024101003095	S	USDMXN	10/15/2024	(70,000,000)	19.48	1,363,600,000
2024101003355	S	USDMXN	10/15/2024	(153,000,000)	19.5523	2,991,501,900
2024101003371	S	USDMXN	10/15/2024	(623,879)	19.5334	12,186,469
2024101103343	B	USDMXN	10/15/2024	140,000,000	19.4	(2,716,000,000)
2024101103346	B	USDMXN	10/15/2024	130,000,000	19.4	(2,522,000,000)
2024101103351	B	USDMXN	10/15/2024	91,403	19.34365	(1,768,062)
2024101503372	S	USDMXN	10/15/2024	(50,000,000)	19.65	982,500,000
202401103135	B	USDMXN	10/16/2024	15,000,000	17.79	(266,850,000)
2024101103344	S	USDMXN	10/16/2024	(140,000,000)	19.40315	2,716,441,000
2024101103347	S	USDMXN	10/16/2024	(130,000,000)	19.40315	2,522,409,500
2024101103352	S	USDMXN	10/16/2024	(91,403)	19.3467	1,768,341
2024101503041	B	USDMXN	10/16/2024	77,909,398	19.61	(1,527,803,296)
2024101503058	B	USDMXN	10/16/2024	153,000,000	19.66	(3,007,980,000)
2024101503373	B	USDMXN	10/16/2024	50,000,000	19.6532	(982,660,000)
2024101503517	B	USDMXN	10/16/2024	4,104,990	19.69879	(80,863,341)
2024101503259	S	USDMXN	10/16/2024	(93,000,000)	19.575	1,820,475,000
2024101503294	S	USDMXN	10/16/2024	(93,000,000)	19.585	1,821,405,000
2024092603044	B	USDMXN	10/17/2024	35,000,000	19.58	(685,300,000)
2024092603049	B	USDMXN	10/17/2024	35,000,000	19.6	(686,000,000)
2024101503260	B	USDMXN	10/17/2024	93,000,000	19.57825	(1,820,777,250)
2024101503295	B	USDMXN	10/17/2024	93,000,000	19.58825	(1,821,707,250)
2024101503059	S	USDMXN	10/17/2024	(153,000,000)	19.6632	3,008,469,600
2024101503068	S	USDMXN	10/17/2024	(778,000)	19.62577	15,268,849
2024101503518	S	USDMXN	10/17/2024	(4,104,990)	19.7019	80,876,095
2024101603341	S	USDMXN	10/17/2024	(100,573,268)	19.886	2,000,000,000
2024101603350	S	USDMXN	10/17/2024	(35,000,000)	19.89	696,150,000
2024101603365	S	USDMXN	10/17/2024	(350,688)	19.91554	6,984,149
2023101603180	B	USDMXN	10/18/2024	15,000,000	19.114	(286,710,000)
2023101603182	B	USDMXN	10/18/2024	5,000,000	19.123	(95,615,000)
2023101603184	B	USDMXN	10/18/2024	20,000,000	19.113	(382,260,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023101603188	B	USDMXN	10/18/2024	10,000,000	19.094	(190,940,000)
2024011603730	B	USDMXN	10/18/2024	10,000,000	18.009	(180,090,000)
2024041603328	B	USDMXN	10/18/2024	10,000,000	17.509	(175,090,000)
2024071603274	B	USDMXN	10/18/2024	30,000,000	17.9118	(537,354,000)
2024071603276	B	USDMXN	10/18/2024	30,000,000	17.9118	(537,354,000)
2024092503321	S	USDMXN	10/18/2024	(100,000,000)	19.6497	1,964,970,000
2024101603032	B	USDMXN	10/18/2024	100,000,000	19.87	(1,987,000,000)
2024101603342	B	USDMXN	10/18/2024	100,556,328	19.88935	(2,000,000,000)
2024101603351	B	USDMXN	10/18/2024	35,000,000	19.89335	(696,267,250)
2024101603366	B	USDMXN	10/18/2024	350,688	19.9193	(6,985,467)
2024101603367	B	USDMXN	10/18/2024	16,000	19.92105	(318,737)
2024101603126	S	USDMXN	10/18/2024	(30,000,000)	19.9	597,000,000
2024101603180	S	USDMXN	10/18/2024	(30,000,000)	19.872	596,160,000
2024101603335	S	USDMXN	10/18/2024	(20,000,000)	19.87	397,400,000
2024101703070	S	USDMXN	10/18/2024	(44,000,000)	19.92	876,480,000
2024101703080	S	USDMXN	10/18/2024	(300,964)	19.92962	5,998,106
2024101703135	S	USDMXN	10/18/2024	(60,000,000)	19.92	1,195,200,000
2024011703369	B	USDMXN	10/21/2024	10,000,000	18.055	(180,550,000)
2024061803284	S	USDMXN	10/21/2024	(70,000,000)	18.77	1,313,900,000
2024101703071	B	USDMXN	10/21/2024	44,000,000	19.9328	(877,043,200)
2024101703081	B	USDMXN	10/21/2024	300,964	19.9442	(6,002,494)
2024101703136	B	USDMXN	10/21/2024	60,000,000	19.9328	(1,195,968,000)
2024101703076	S	USDMXN	10/21/2024	(300,964)	19.9408	6,001,470
2024101703091	S	USDMXN	10/21/2024	(50,000,000)	19.957	997,850,000
2024101703093	S	USDMXN	10/21/2024	(30,000,000)	19.965	598,950,000
2024101703422	S	USDMXN	10/21/2024	(50,000,000)	19.952	997,600,000
2024101703425	S	USDMXN	10/21/2024	(30,000,000)	19.952	598,560,000
2024101703506	S	USDMXN	10/21/2024	(20,000,000)	19.888	397,760,000
2024101703558	S	USDMXN	10/21/2024	(30,000,000)	19.88	596,400,000
2024101703566	S	USDMXN	10/21/2024	(30,000,000)	19.88	596,400,000
2024101703791	S	USDMXN	10/21/2024	(30,000,000)	19.88	596,400,000
2024101803036	S	USDMXN	10/21/2024	(133,793,215)	19.69	2,634,388,407
2024011803559	S	USDMXN	10/22/2024	(10,000,000)	17.983	179,830,000
2024102103556	B	USDMXN	10/22/2024	204,000,000	19.98	(4,075,920,000)
2024102103561	B	USDMXN	10/22/2024	383,076	19.98038	(7,654,008)
2024102103557	S	USDMXN	10/23/2024	(204,000,000)	19.9837	4,076,674,800
2024102103562	S	USDMXN	10/23/2024	(383,076)	19.9837	7,655,282
2024102203377	B	USDMXN	10/23/2024	50,240,148	19.9044	(1,000,000,000)
2024102203430	B	USDMXN	10/23/2024	219,000,000	19.891	(4,356,129,000)
2024102203440	B	USDMXN	10/23/2024	133,853	19.90959	(2,664,960)
2024102203030	B	USDMXN	10/24/2024	50,000,000	19.8415	(992,075,000)
2024102203448	B	USDMXN	10/24/2024	30,000,000	19.897	(596,910,000)
2024102203450	B	USDMXN	10/24/2024	30,000,000	19.897	(596,910,000)
2024102203452	B	USDMXN	10/24/2024	20,000,000	19.897	(397,940,000)
2024102203378	S	USDMXN	10/24/2024	(50,231,063)	19.908	1,000,000,000
2024102203431	S	USDMXN	10/24/2024	(219,000,000)	19.8946	4,356,917,400
2024102203441	S	USDMXN	10/24/2024	(133,853)	19.913	2,665,417
2024102303090	B	USDMXN	10/24/2024	125,000,000	19.96	(2,495,000,000)
2024102303468	B	USDMXN	10/24/2024	246,570	19.86608	(4,898,371)
2024102303472	B	USDMXN	10/24/2024	39,000,000	19.867	(774,813,000)
2024090903187	SO	USDMXN	10/25/2024	(379,554)	20.0235	7,600,000
2024092303339	B	USDMXN	10/25/2024	100,000,000	19.56	(1,956,000,000)
2024102303080	B	USDMXN	10/25/2024	50,000,000	19.962	(998,100,000)
2024102303329	B	USDMXN	10/25/2024	50,000,000	19.92	(996,000,000)
2024102303439	B	USDMXN	10/25/2024	50,000,000	19.892	(994,600,000)
2024102303091	S	USDMXN	10/25/2024	(125,000,000)	19.9636	2,495,450,000
2024102303448	S	USDMXN	10/25/2024	(30,000,000)	19.885	596,550,000
2024102303469	S	USDMXN	10/25/2024	(246,570)	19.8695	4,899,214
2024102303473	S	USDMXN	10/25/2024	(39,000,000)	19.87025	774,939,750
2024062503355	S	USDMXN	10/28/2024	(30,000,000)	18.509	555,270,000
2024082203114	B	USDMXN	10/28/2024	50,000,000	19.6185	(980,925,000)
2024090903627	SO	USDMXN	10/28/2024	(881,923)	20.0375	17,671,532
2024092403437	S	USDMXN	10/28/2024	(40,000,000)	19.4891	779,564,000
2024092503328	S	USDMXN	10/28/2024	(30,000,000)	19.707	591,210,000
2024102803432	S	USDMXN	10/29/2024	(68,000,000)	20.007	1,360,476,000
2024102803443	S	USDMXN	10/29/2024	(68,485)	20.00439	1,369,998
2024102803433	B	USDMXN	10/30/2024	68,000,000	20.01028	(1,360,698,700)
2024102803444	B	USDMXN	10/30/2024	68,485	20.0078	(1,370,231)
2024102903122	S	USDMXN	10/30/2024	(422,672)	19.98424	8,446,779

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024103003072	S	USDMXN	10/30/2024	(80,000,000)	20.11	1,608,800,000
2024102903123	B	USDMXN	10/31/2024	422,672	19.9877	(8,448,242)
2024102903320	S	USDMXN	10/31/2024	(30,000,000)	19.991	599,730,000
2024102903592	S	USDMXN	10/31/2024	(15,000,000)	20.075	301,125,000
2024103003073	B	USDMXN	10/31/2024	80,000,000	20.1133	(1,609,064,000)
2024103003160	B	USDMXN	10/31/2024	134,000,000	20.17	(2,702,780,000)
2024103003162	B	USDMXN	10/31/2024	477,247	20.14291	(9,613,145)
2024103003042	S	USDMXN	10/31/2024	(85,814,570)	20.1471	1,728,914,728
2024103103081	S	USDMXN	10/31/2024	(25,000,000)	20.064	501,600,000
2024073003847	S	USDMXN	11/01/2024	(50,000,000)	19.028	951,400,000
2024073003849	S	USDMXN	11/01/2024	(50,000,000)	19.027	951,350,000
2024103003069	B	USDMXN	11/01/2024	684,000	20.13635	(13,773,263)
2024103003417	B	USDMXN	11/01/2024	100,000,000	20.175	(2,017,500,000)
2024103003161	S	USDMXN	11/01/2024	(134,000,000)	20.1734	2,703,235,600
2024103003163	S	USDMXN	11/01/2024	(477,247)	20.1461	9,614,666
2024103003422	S	USDMXN	11/01/2024	(100,000,000)	20.175	2,017,500,000
2024103103082	B	USDMXN	11/01/2024	25,000,000	20.06735	(501,683,750)
2024103103561	B	USDMXN	11/01/2024	100,000,000	20.005	(2,000,500,000)
2024103103563	B	USDMXN	11/01/2024	181,000,000	20.005	(3,620,905,000)
2024103103601	B	USDMXN	11/01/2024	419,007	20.00761	(8,383,334)
2024110103182	B	USDMXN	11/01/2024	85,000,000	20.02	(1,701,700,000)
2024110103185	S	USDMXN	11/01/2024	(85,000,000)	20.02	1,701,700,000
2024092703627	B	USDMXN	11/04/2024	50,000,000	19.7836	(989,180,000)
2024103103279	B	USDMXN	11/04/2024	50,000,000	20.047	(1,002,350,000)
2024103103776	B	USDMXN	11/04/2024	20,000,000	20.014	(400,280,000)
2024103103562	S	USDMXN	11/04/2024	(100,000,000)	20.0148	2,001,480,000
2024103103564	S	USDMXN	11/04/2024	(181,000,000)	20.0147	3,622,660,700
2024103103602	S	USDMXN	11/04/2024	(419,007)	20.0176	8,387,520
2024110103154	B	USDMXN	11/04/2024	52,000,000	20.028	(1,041,456,000)
2024110103156	B	USDMXN	11/04/2024	100,000,000	20.028	(2,002,800,000)
2024110103159	B	USDMXN	11/04/2024	341,612	20.02817	(6,841,868)
2024110103186	B	USDMXN	11/04/2024	85,000,000	20.0297	(1,702,524,500)
2024110103183	S	USDMXN	11/04/2024	(85,000,000)	20.0297	1,702,524,500
2024110103164	B	USDMXN	11/05/2024	80,000,000	20.04	(1,603,200,000)
2024110103155	S	USDMXN	11/05/2024	(52,000,000)	20.0313	1,041,627,600
2024110103157	S	USDMXN	11/05/2024	(100,000,000)	20.0313	2,003,130,000
2024110103160	S	USDMXN	11/05/2024	(341,612)	20.0312	6,842,902
2024110403450	B	USDMXN	11/05/2024	49,000,000	20.12	(985,880,000)
2024110403458	B	USDMXN	11/05/2024	792,428	20.1405	(15,959,906)
2024110403467	B	USDMXN	11/06/2024	30,000,000	20.125	(603,750,000)
2024110403174	S	USDMXN	11/06/2024	(25,000,000)	19.97	499,250,000
2024110403176	S	USDMXN	11/06/2024	(30,000,000)	19.97	599,100,000
2024110403451	S	USDMXN	11/06/2024	(49,000,000)	20.1232	986,036,800
2024110403459	S	USDMXN	11/06/2024	(792,428)	20.1433	15,962,125
2024110403601	S	USDMXN	11/06/2024	(50,000,000)	20.13	1,006,500,000
2024110403610	S	USDMXN	11/06/2024	(20,000,000)	20.123	402,460,000
2024110403652	S	USDMXN	11/06/2024	(20,000,000)	20.12	402,400,000
2024110503304	B	USDMXN	11/06/2024	50,000,000	20.27	(1,013,500,000)
2024110503306	B	USDMXN	11/06/2024	183,000,000	20.337	(3,721,671,000)
2024110503313	B	USDMXN	11/06/2024	280,014	20.25146	(5,670,700)
2024110503050	B	USDMXN	11/07/2024	50,000,000	20.127	(1,006,350,000)
2024110503305	S	USDMXN	11/07/2024	(50,000,000)	20.27325	1,013,662,500
2024110503307	S	USDMXN	11/07/2024	(183,000,000)	20.34025	3,722,265,750
2024110503314	S	USDMXN	11/07/2024	(280,014)	20.2542	5,671,467
2024110703054	S	USDMXN	11/07/2024	(45,000,000)	19.78	890,100,000
2024110603107	S	USDMXN	11/08/2024	(50,000,000)	20.5876	1,029,380,000
2024110603730	S	USDMXN	11/08/2024	(15,000,000)	20.2	303,000,000
2024110703055	B	USDMXN	11/08/2024	45,000,000	19.7831	(890,239,500)
2024110703414	B	USDMXN	11/08/2024	118,000,000	19.83	(2,339,940,000)
2024110703416	B	USDMXN	11/08/2024	100,000,000	19.83	(1,983,000,000)
2024110703418	B	USDMXN	11/08/2024	50,000,000	19.83	(991,500,000)
2024110703425	B	USDMXN	11/08/2024	259,908	19.84132	(5,156,928)
2024110803388	B	USDMXN	11/08/2024	12,583,272	20.265	(255,000,000)
2024110803415	B	USDMXN	11/08/2024	36,910,930	20.265	(748,000,000)
2024110803425	B	USDMXN	11/08/2024	505,798	20.17647	(10,205,222)
2024110803071	S	USDMXN	11/08/2024	(50,000,000)	20.015	1,000,750,000
2024110803145	S	USDMXN	11/08/2024	(50,000,000)	20.0309	1,001,545,000
2024050703072	B	USDMXN	11/12/2024	60,000,000	17.351	(1,041,060,000)
2024050703081	B	USDMXN	11/12/2024	30,000,000	17.352	(520,560,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024050703084	B	USDMXN	11/12/2024	50,000,000	17.35	(867,500,000)
2024050803316	B	USDMXN	11/12/2024	20,000,000	17.4	(348,000,000)
2024050803424	B	USDMXN	11/12/2024	20,000,000	17.389	(347,780,000)
2024110703254	B	USDMXN	11/12/2024	50,000,000	19.849	(992,450,000)
2024110703286	B	USDMXN	11/12/2024	80,000,000	19.845	(1,587,600,000)
2024110703035	S	USDMXN	11/12/2024	(50,000,000)	19.789	989,450,000
2024110703415	S	USDMXN	11/12/2024	(118,000,000)	19.8433	2,341,509,400
2024110703417	S	USDMXN	11/12/2024	(100,000,000)	19.8433	1,984,330,000
2024110703419	S	USDMXN	11/12/2024	(50,000,000)	19.8433	992,165,000
2024110703426	S	USDMXN	11/12/2024	(259,908)	19.8543	5,160,301
2024110803072	B	USDMXN	11/12/2024	50,000,000	20.028	(1,001,400,000)
2024110803146	B	USDMXN	11/12/2024	50,000,000	20.0439	(1,002,195,000)
2024110803372	S	USDMXN	11/12/2024	(120,000,000)	20.255	2,430,600,000
2024110803382	S	USDMXN	11/12/2024	(206,753)	20.24889	4,186,519
2024110803389	S	USDMXN	11/12/2024	(12,574,957)	20.2784	255,000,000
2024110803416	S	USDMXN	11/12/2024	(36,886,539)	20.2784	748,000,000
2024110803426	S	USDMXN	11/12/2024	(505,798)	20.18788	10,210,993
2024110803443	S	USDMXN	11/12/2024	(32,706)	20.17559	659,860
2024050903035	S	USDMXN	11/13/2024	(30,000,000)	17.419	522,570,000
2024110803320	B	USDMXN	11/13/2024	15,000,000	20.142	(302,130,000)
2024110803373	B	USDMXN	11/13/2024	120,000,000	20.2584	(2,431,008,000)
2024110803383	B	USDMXN	11/13/2024	206,753	20.2531	(4,187,389)
2024110803444	B	USDMXN	11/13/2024	32,706	20.1798	(659,998)
2024111203389	B	USDMXN	11/13/2024	96,936,797	20.632	(2,000,000,000)
2024111203597	S	USDMXN	11/13/2024	(105,000,000)	20.63	2,166,150,000
2024111203604	S	USDMXN	11/13/2024	(348,421)	20.64195	7,192,084
2024111303223	S	USDMXN	11/13/2024	(17,900,000)	20.58	368,382,000
2023111003316	S	USDMXN	11/14/2024	(5,000,000)	18.85	94,250,000
2024092603626	BO	USDMXN	11/14/2024	623,135	19.79823	(12,336,972)
2024092603628	BO	USDMXN	11/14/2024	623,135	19.79823	(12,336,972)
2024101603033	S	USDMXN	11/14/2024	(100,000,000)	19.9575	1,995,750,000
2024101703077	B	USDMXN	11/14/2024	300,964	20.03068	(6,028,522)
2024110503052	S	USDMXN	11/14/2024	(50,000,000)	20.1515	1,007,575,000
2024111203598	B	USDMXN	11/14/2024	105,000,000	20.63355	(2,166,522,750)
2024111203605	B	USDMXN	11/14/2024	348,421	20.6456	(7,193,355)
2024111203390	S	USDMXN	11/14/2024	(96,920,356)	20.6355	2,000,000,000
2024111203587	S	USDMXN	11/14/2024	(30,000,000)	20.62	618,600,000
2024111303067	B	USDMXN	11/14/2024	97,513,408	20.51	(2,000,000,000)
2024111303224	B	USDMXN	11/14/2024	17,900,000	20.5835	(368,444,650)
2024111303327	B	USDMXN	11/14/2024	9,000,000	20.605	(185,445,000)
2024111303334	B	USDMXN	11/14/2024	254,011	20.56952	(5,224,885)
2024111403070	S	USDMXN	11/14/2024	(30,000,000)	20.6	618,000,000
2024081303069	S	USDMXN	11/15/2024	(51,815,888)	19.2991	1,000,000,000
2024111303151	B	USDMXN	11/15/2024	250,000,000	20.627	(5,156,750,000)
2024111303374	B	USDMXN	11/15/2024	50,000,000	20.581	(1,029,050,000)
2024111303068	S	USDMXN	11/15/2024	(97,496,770)	20.5135	2,000,000,000
2024111303239	S	USDMXN	11/15/2024	(50,000,000)	20.608	1,030,400,000
2024111303241	S	USDMXN	11/15/2024	(70,000,000)	20.608	1,442,560,000
2024111303328	S	USDMXN	11/15/2024	(9,000,000)	20.60845	185,476,050
2024111303335	S	USDMXN	11/15/2024	(254,011)	20.5725	5,225,641
2024111403061	B	USDMXN	11/15/2024	194,174,757	20.6	(4,000,000,000)
2024111403071	B	USDMXN	11/15/2024	30,000,000	20.60375	(618,112,500)
2024111403563	S	USDMXN	11/15/2024	(58,651,000)	20.46	1,199,999,460
2024111403598	S	USDMXN	11/15/2024	(57,119)	20.48562	1,170,111
2024111403603	S	USDMXN	11/15/2024	(152,000,000)	20.5	3,116,000,000
2024021403251	S	USDMXN	11/19/2024	(20,000,000)	17.871	357,420,000
2024021403293	S	USDMXN	11/19/2024	(10,000,000)	17.88	178,800,000
2024021403295	S	USDMXN	11/19/2024	(10,000,000)	17.88	178,800,000
2024101603127	B	USDMXN	11/19/2024	30,000,000	20.0062	(600,186,000)
2024101603181	B	USDMXN	11/19/2024	30,000,000	19.9792	(599,376,000)
2024111403564	B	USDMXN	11/19/2024	58,651,000	20.4748	(1,200,867,495)
2024111403599	B	USDMXN	11/19/2024	57,119	20.5026	(1,171,081)
2024111403604	B	USDMXN	11/19/2024	152,000,000	20.5149	(3,118,264,800)
2024111403062	S	USDMXN	11/19/2024	(194,037,236)	20.6146	4,000,000,000
2024111403085	S	USDMXN	11/19/2024	(50,000,000)	20.577	1,028,850,000
2024111403477	S	USDMXN	11/19/2024	(50,000,000)	20.482	1,024,100,000
2024111503126	B	USDMXN	11/19/2024	97,847,358	20.44	(2,000,000,000)
2024111503437	S	USDMXN	11/19/2024	(56,000,000)	20.34	1,139,040,000
2024111503439	S	USDMXN	11/19/2024	(195,434,000)	20.415	3,989,785,110

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024111503462	S	USDMXN	11/19/2024	(4,912,434)	20.33855	99,911,789
2024111903078	S	USDMXN	11/19/2024	(20,000,000)	20.25	405,000,000
2024111903823	S	USDMXN	11/19/2024	(25,000,000)	20.11	502,750,000
2024111503438	B	USDMXN	11/20/2024	56,000,000	20.34365	(1,139,244,400)
2024111503440	B	USDMXN	11/20/2024	195,434,000	20.41865	(3,990,498,444)
2024111503463	B	USDMXN	11/20/2024	4,912,434	20.3423	(99,930,210)
2024111503127	S	USDMXN	11/20/2024	(97,829,649)	20.4437	2,000,000,000
2024111903079	B	USDMXN	11/20/2024	20,000,000	20.25353	(405,070,500)
2024111903824	B	USDMXN	11/20/2024	25,000,000	20.11382	(502,845,500)
2024111903750	S	USDMXN	11/20/2024	(155,000,000)	20.126	3,119,530,000
2024111903766	S	USDMXN	11/20/2024	(63,288)	20.11743	1,273,188
2024112003005	S	USDMXN	11/20/2024	(60,000,000)	20.2	1,212,000,000
2024051703578	B	USDMXN	11/21/2024	20,000,000	17.1035	(342,070,000)
2024061803285	B	USDMXN	11/21/2024	70,000,000	18.865	(1,320,550,000)
2024101703092	B	USDMXN	11/21/2024	50,000,000	20.07	(1,003,500,000)
2024101703559	B	USDMXN	11/21/2024	30,000,000	19.9955	(599,865,000)
2024111903474	B	USDMXN	11/21/2024	30,000,000	20.085	(602,550,000)
2024111903590	B	USDMXN	11/21/2024	70,000,000	20.125	(1,408,750,000)
2024111903597	B	USDMXN	11/21/2024	40,000,000	20.1725	(806,900,000)
2024111903751	B	USDMXN	11/21/2024	155,000,000	20.1296	(3,120,088,000)
2024111903767	B	USDMXN	11/21/2024	63,288	20.1211	(1,273,421)
2024112003006	B	USDMXN	11/21/2024	60,000,000	20.20365	(1,212,219,000)
2024112003126	B	USDMXN	11/21/2024	137,751,100	20.275	(2,792,903,556)
2024112003024	S	USDMXN	11/21/2024	(150,000,000)	20.23	3,034,500,000
2024112003278	S	USDMXN	11/21/2024	(100,000,000)	20.295	2,029,500,000
2024112003460	S	USDMXN	11/21/2024	(178,000,000)	20.31	3,615,180,000
2024112003463	S	USDMXN	11/21/2024	(50,000,000)	20.31	1,015,500,000
2024112003467	S	USDMXN	11/21/2024	(949,758)	20.31795	19,297,129
2024112103270	S	USDMXN	11/21/2024	(49,127,978)	20.355	1,000,000,000
2024112103276	S	USDMXN	11/21/2024	(26,381,121)	20.382	537,700,000
2024022003659	S	USDMXN	11/22/2024	(20,000,000)	17.835	356,700,000
2024112003025	B	USDMXN	11/22/2024	150,000,000	20.2336	(3,035,040,000)
2024112003279	B	USDMXN	11/22/2024	100,000,000	20.29875	(2,029,875,000)
2024112003461	B	USDMXN	11/22/2024	178,000,000	20.3139	(3,615,874,200)
2024112003464	B	USDMXN	11/22/2024	50,000,000	20.3139	(1,015,695,000)
2024112003468	B	USDMXN	11/22/2024	949,758	20.3222	(19,301,169)
2024112003301	S	USDMXN	11/22/2024	(30,000,000)	20.314	609,420,000
2024112003434	S	USDMXN	11/22/2024	(849,000)	20.31116	17,244,175
2024112103271	B	USDMXN	11/22/2024	49,113,019	20.3612	(1,000,000,000)
2024112103277	B	USDMXN	11/22/2024	26,372,063	20.389	(537,700,000)
2024112103496	S	USDMXN	11/22/2024	(75,000,000)	20.42	1,531,500,000
2024112103502	S	USDMXN	11/22/2024	(250,000,000)	20.42	5,105,000,000
2024112103517	S	USDMXN	11/22/2024	(54,000,000)	20.43	1,103,220,000
2024112103634	S	USDMXN	11/22/2024	(50,000,000)	20.42	1,021,000,000
2024112103639	S	USDMXN	11/22/2024	(72,977)	20.42129	1,490,288
2024112203716	B	USDMXN	11/22/2024	50,000,000	20.45	(1,022,500,000)
2024112203714	S	USDMXN	11/22/2024	(50,000,000)	20.45	1,022,500,000
2024050703048	S	USDMXN	11/25/2024	(96,612,950)	17.375	1,678,650,000
2024062003357	B	USDMXN	11/25/2024	30,000,000	18.879	(566,370,000)
2024090903193	SO	USDMXN	11/25/2024	(377,762)	20.1185	7,600,000
2024102303440	S	USDMXN	11/25/2024	(50,000,000)	20.002	1,000,100,000
2024112103215	B	USDMXN	11/25/2024	78,433,607	20.357	(1,596,672,939)
2024112103497	B	USDMXN	11/25/2024	75,000,000	20.4355	(1,532,662,500)
2024112103503	B	USDMXN	11/25/2024	250,000,000	20.4355	(5,108,875,000)
2024112103518	B	USDMXN	11/25/2024	54,000,000	20.4455	(1,104,057,000)
2024112103635	B	USDMXN	11/25/2024	50,000,000	20.4355	(1,021,775,000)
2024112103640	B	USDMXN	11/25/2024	72,977	20.4417	(1,491,777)
2024112103259	S	USDMXN	11/25/2024	(50,000,000)	20.322	1,016,100,000
2024112103494	S	USDMXN	11/25/2024	(100,000,000)	20.417	2,041,700,000
2024112103499	S	USDMXN	11/25/2024	(50,000,000)	20.42	1,021,000,000
2024112103514	S	USDMXN	11/25/2024	(50,000,000)	20.42	1,021,000,000
2024112103524	S	USDMXN	11/25/2024	(100,000,000)	20.416	2,041,600,000
2024112103652	S	USDMXN	11/25/2024	(220,000)	20.44509	4,497,920
2024112203715	B	USDMXN	11/25/2024	50,000,000	20.4665	(1,023,325,000)
2024112203717	S	USDMXN	11/25/2024	(50,000,000)	20.4655	1,023,275,000
2024112503429	B	USDMXN	11/25/2024	271,270,037	20.275	(5,500,000,000)
2024112503433	S	USDMXN	11/25/2024	(271,270,037)	20.275	5,500,000,000
2024051303107	S	USDMXN	11/26/2024	(96,090,699)	17.31	1,663,330,000
2024062403531	B	USDMXN	11/26/2024	30,000,000	18.3535	(550,605,000)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024090903628	SO	USDMXN	11/26/2024	(1,200,960)	20.1252	24,169,560
2024112103217	B	USDMXN	11/26/2024	81,708,012	20.357	(1,663,330,000)
2024112203106	S	USDMXN	11/26/2024	(50,000,000)	20.52	1,026,000,000
2024112203110	S	USDMXN	11/26/2024	(50,000,000)	20.475	1,023,750,000
2024112203214	S	USDMXN	11/26/2024	(10,000,000)	20.49	204,900,000
2024112203218	S	USDMXN	11/26/2024	(10,000,000)	20.49	204,900,000
2024112503660	B	USDMXN	11/26/2024	24,635,396	20.296	(500,000,000)
2024112503664	B	USDMXN	11/26/2024	63,066,614	20.296	(1,280,000,000)
2024112503670	B	USDMXN	11/26/2024	149,000,000	20.282	(3,022,018,000)
2024112503672	B	USDMXN	11/26/2024	653,977	20.28433	(13,265,489)
2024112503666	S	USDMXN	11/26/2024	(149,000,000)	20.282	3,022,018,000
2024112603244	S	USDMXN	11/26/2024	(10,000,000)	20.695	206,950,000
2024022303511	B	USDMXN	11/27/2024	20,000,000	17.858	(357,160,000)
2024052303273	S	USDMXN	11/27/2024	(96,747,419)	17.1925	1,663,330,000
2024062503359	B	USDMXN	11/27/2024	30,000,000	18.5975	(557,925,000)
2024112503252	B	USDMXN	11/27/2024	81,756,205	20.345	(1,663,330,000)
2024112503667	B	USDMXN	11/27/2024	149,000,000	20.2915	(3,023,433,500)
2024112503661	S	USDMXN	11/27/2024	(24,623,870)	20.3055	500,000,000
2024112503665	S	USDMXN	11/27/2024	(63,037,108)	20.3055	1,280,000,000
2024112503671	S	USDMXN	11/27/2024	(149,000,000)	20.2915	3,023,433,500
2024112503673	S	USDMXN	11/27/2024	(653,977)	20.2899	13,269,132
2024112603245	B	USDMXN	11/27/2024	10,000,000	20.71	(207,100,000)
2024112603279	B	USDMXN	11/27/2024	181,000,000	20.75	(3,755,750,000)
2024112603287	B	USDMXN	11/27/2024	113,029	20.74009	(2,344,225)
2024022603461	B	USDMXN	11/29/2024	25,000,000	17.8555	(446,387,500)
2024022603650	B	USDMXN	11/29/2024	10,000,000	17.8355	(178,355,000)
2024022703745	S	USDMXN	11/29/2024	(10,000,000)	17.8085	178,085,000
2024052303588	B	USDMXN	11/29/2024	15,000,000	17.1765	(257,647,500)
2024052903448	B	USDMXN	11/29/2024	15,000,000	17.429	(261,435,000)
2024052903465	B	USDMXN	11/29/2024	15,000,000	17.4325	(261,487,500)
2024082703666	B	USDMXN	11/29/2024	50,000,000	20.009	(1,000,450,000)
2024102903321	B	USDMXN	11/29/2024	30,000,000	20.092	(602,760,000)
2024112603280	S	USDMXN	11/29/2024	(181,000,000)	20.771	3,759,551,000
2024112603288	S	USDMXN	11/29/2024	(113,029)	20.7492	2,345,255
2024112603733	S	USDMXN	11/29/2024	(181,000)	20.68681	3,744,313
2024112703331	B	USDMXN	11/29/2024	67,000,000	20.63	(1,382,210,000)
2024112703485	B	USDMXN	11/29/2024	943,204	20.55398	(19,386,594)
2023112903795	S	USDMXN	12/02/2024	(8,000,000)	18.3	146,400,000
2024112103495	B	USDMXN	12/02/2024	100,000,000	20.4445	(2,044,450,000)
2024112103525	B	USDMXN	12/02/2024	100,000,000	20.4435	(2,044,350,000)
2024112503434	B	USDMXN	12/02/2024	270,955,982	20.2985	(5,500,000,000)
2024112503430	S	USDMXN	12/02/2024	(270,955,982)	20.2985	5,500,000,000
2024112703112	S	USDMXN	12/02/2024	(200,000,000)	20.72	4,144,000,000
2024112703332	S	USDMXN	12/02/2024	(67,000,000)	20.6495	1,383,516,500
2024112703486	S	USDMXN	12/02/2024	(943,204)	20.564	19,396,042
2024120203001	B	USDMXN	12/02/2024	110,000,000	20.57	(2,262,700,000)
2024120203084	S	USDMXN	12/02/2024	(40,000,000)	20.475	819,000,000
2024093003268	S	USDMXN	12/03/2024	(100,000,000)	19.8615	1,986,150,000
2024112103216	S	USDMXN	12/03/2024	(78,313,580)	20.3882	1,596,672,939
2024112903212	S	USDMXN	12/03/2024	(30,000,000)	20.2935	608,805,000
2024120203085	B	USDMXN	12/03/2024	40,000,000	20.4787	(819,148,000)
2024120203511	B	USDMXN	12/03/2024	346,000,000	20.396	(7,057,016,000)
2024120203538	B	USDMXN	12/03/2024	346,547	20.38019	(7,062,687)
2024120203002	S	USDMXN	12/03/2024	(110,000,000)	20.5736	2,263,096,000
2024120303672	B	USDMXN	12/03/2024	100,000,000	20.34	(2,034,000,000)
2024120303670	S	USDMXN	12/03/2024	(100,000,000)	20.34	2,034,000,000
2024022903840	S	USDMXN	12/04/2024	(30,000,000)	17.787	533,610,000
2024100203064	B	USDMXN	12/04/2024	30,000,000	19.6975	(590,925,000)
2024100203066	B	USDMXN	12/04/2024	70,000,000	19.6975	(1,378,825,000)
2024100203082	B	USDMXN	12/04/2024	50,000,000	19.6345	(981,725,000)
2024112103218	S	USDMXN	12/04/2024	(81,584,175)	20.3879	1,663,330,000
2024120203436	B	USDMXN	12/04/2024	100,000,000	20.387	(2,038,700,000)
2024120203512	S	USDMXN	12/04/2024	(346,000,000)	20.3999	7,058,365,400
2024120203539	S	USDMXN	12/04/2024	(346,547)	20.383	7,063,662
2024120303031	B	USDMXN	12/04/2024	34,392,964	20.353	(700,000,000)
2024120303140	B	USDMXN	12/04/2024	100,000,000	20.33	(2,033,000,000)
2024120303192	B	USDMXN	12/04/2024	106,000,000	20.29	(2,150,740,000)
2024120303200	B	USDMXN	12/04/2024	421,500	20.29754	(8,555,424)
2024120303671	B	USDMXN	12/04/2024	100,000,000	20.3436	(2,034,360,000)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024120303673	S	USDMXN	12/04/2024	(100,000,000)	20.3436	2,034,360,000
2024120403025	S	USDMXN	12/04/2024	(15,000,000)	20.325	304,875,000
2024070203765	S	USDMXN	12/05/2024	(30,000,000)	18.6925	560,775,000
2024110103165	S	USDMXN	12/05/2024	(80,000,000)	20.145	1,611,600,000
2024112503253	S	USDMXN	12/05/2024	(81,615,800)	20.38	1,663,330,000
2024120303431	B	USDMXN	12/05/2024	30,000,000	20.32	(609,600,000)
2024120303032	S	USDMXN	12/05/2024	(34,386,206)	20.357	700,000,000
2024120303141	S	USDMXN	12/05/2024	(100,000,000)	20.3339	2,033,390,000
2024120303193	S	USDMXN	12/05/2024	(106,000,000)	20.2937	2,151,132,200
2024120303201	S	USDMXN	12/05/2024	(421,500)	20.301	8,556,881
2024120403026	B	USDMXN	12/05/2024	15,000,000	20.3284	(304,926,000)
2024120403141	B	USDMXN	12/05/2024	100,000,000	20.295	(2,029,500,000)
2024120403143	B	USDMXN	12/05/2024	100,000,000	20.295	(2,029,500,000)
2024120403161	B	USDMXN	12/05/2024	200,000,000	20.29	(4,058,000,000)
2024120403283	B	USDMXN	12/05/2024	5,894,116	20.2631	(119,433,050)
2024120503053	B	USDMXN	12/05/2024	50,000,000	20.21	(1,010,500,000)
2024120503051	S	USDMXN	12/05/2024	(50,000,000)	20.21	1,010,500,000
2024120403348	B	USDMXN	12/06/2024	50,000,000	20.27	(1,013,500,000)
2024120403441	B	USDMXN	12/06/2024	45,000,000	20.275	(912,375,000)
2024120403468	B	USDMXN	12/06/2024	20,000,000	20.265	(405,300,000)
2024120403142	S	USDMXN	12/06/2024	(100,000,000)	20.2983	2,029,830,000
2024120403144	S	USDMXN	12/06/2024	(100,000,000)	20.2983	2,029,830,000
2024120403162	S	USDMXN	12/06/2024	(200,000,000)	20.2934	4,058,680,000
2024120403284	S	USDMXN	12/06/2024	(5,894,116)	20.2657	119,448,392
2024120503174	B	USDMXN	12/06/2024	22,294,335	20.1845	(450,000,000)
2024120503188	B	USDMXN	12/06/2024	215,000,000	20.175	(4,337,625,000)
2024120503216	B	USDMXN	12/06/2024	154,780	20.16377	(3,120,948)
2024120603633	B	USDMXN	12/06/2024	98,960,910	20.21	(2,000,000,000)
2024120603403	S	USDMXN	12/06/2024	(53,200,000)	20.24	1,076,768,000
2024120603592	S	USDMXN	12/06/2024	(98,960,910)	20.21	2,000,000,000
2024120603601	S	USDMXN	12/06/2024	(98,960,910)	20.21	2,000,000,000
2024060503731	S	USDMXN	12/09/2024	(75,000,000)	18.088	1,356,600,000
2024060503733	S	USDMXN	12/09/2024	(20,000,000)	18.0905	361,810,000
2024110603108	B	USDMXN	12/09/2024	50,000,000	20.7001	(1,035,005,000)
2024110603126	S	USDMXN	12/09/2024	(50,000,000)	20.721	1,036,050,000
2024112703113	B	USDMXN	12/09/2024	200,000,000	20.758	(4,151,600,000)
2024120503052	B	USDMXN	12/09/2024	50,000,000	20.2242	(1,011,210,000)
2024120503054	S	USDMXN	12/09/2024	(50,000,000)	20.2242	1,011,210,000
2024120503175	S	USDMXN	12/09/2024	(22,281,971)	20.1957	450,000,000
2024120503189	S	USDMXN	12/09/2024	(215,000,000)	20.1864	4,340,076,000
2024120503217	S	USDMXN	12/09/2024	(154,780)	20.1741	3,122,547
2024120603285	B	USDMXN	12/09/2024	494,559,842	20.22	(10,000,000,000)
2024120603404	B	USDMXN	12/09/2024	53,200,000	20.258	(1,077,725,600)
2024120603593	B	USDMXN	12/09/2024	98,909,523	20.2205	(2,000,000,000)
2024120603602	B	USDMXN	12/09/2024	98,909,523	20.2205	(2,000,000,000)
2024120603327	S	USDMXN	12/09/2024	(247,218,789)	20.225	5,000,000,000
2024120603341	S	USDMXN	12/09/2024	(100,000,000)	20.24	2,024,000,000
2024120603518	S	USDMXN	12/09/2024	(100,000,000)	20.215	2,021,500,000
2024120603553	S	USDMXN	12/09/2024	(863,048)	20.21006	17,442,259
2024120603634	S	USDMXN	12/09/2024	(98,909,523)	20.2205	2,000,000,000
2024120903247	S	USDMXN	12/09/2024	(62,000,000)	20.127	1,247,874,000
2024060603006	B	USDMXN	12/10/2024	50,000,000	18.114	(905,700,000)
2024100803018	B	USDMXN	12/10/2024	50,000,000	19.5092	(975,460,000)
2024100803060	B	USDMXN	12/10/2024	40,000,000	19.5845	(783,380,000)
2024100803580	B	USDMXN	12/10/2024	100,000,000	19.529	(1,952,900,000)
2024120603519	B	USDMXN	12/10/2024	100,000,000	20.2205	(2,022,050,000)
2024120603554	B	USDMXN	12/10/2024	863,048	20.21631	(17,447,653)
2024120603768	S	USDMXN	12/10/2024	(475,000)	20.1725	9,581,938
2024120903206	B	USDMXN	12/10/2024	79,239,352	20.15	(1,596,672,939)
2024120903248	B	USDMXN	12/10/2024	62,000,000	20.1325	(1,248,215,000)
2024120903698	B	USDMXN	12/10/2024	49,382,716	20.25	(1,000,000,000)
2024120903316	S	USDMXN	12/10/2024	(627,400)	20.16979	12,654,529
2024120903398	S	USDMXN	12/10/2024	(50,000,000)	20.2	1,010,000,000
2024120903488	S	USDMXN	12/10/2024	(104,000,000)	20.2	2,100,800,000
2024120903555	S	USDMXN	12/10/2024	(90,000,000)	20.175	1,815,750,000
2024120903557	S	USDMXN	12/10/2024	(110,000,000)	20.175	2,219,250,000
2024120903696	S	USDMXN	12/10/2024	(49,407,115)	20.24	1,000,000,000
2024120903705	S	USDMXN	12/10/2024	(49,407,115)	20.24	1,000,000,000
2024070903120	B	USDMXN	12/11/2024	50,000,000	18.3905	(919,525,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024100903606	B	USDMXN	12/11/2024	30,000,000	19.6649	(589,947,000)
2024100903382	S	USDMXN	12/11/2024	(231,000,000)	19.616	4,531,296,000
2024120203437	S	USDMXN	12/11/2024	(100,000,000)	20.4147	2,041,470,000
2024120903209	B	USDMXN	12/11/2024	82,535,106	20.153	(1,663,330,000)
2024120903317	B	USDMXN	12/11/2024	627,400	20.1763	(12,658,614)
2024120903399	B	USDMXN	12/11/2024	50,000,000	20.2057	(1,010,285,000)
2024120903489	B	USDMXN	12/11/2024	104,000,000	20.206	(2,101,424,000)
2024120903556	B	USDMXN	12/11/2024	90,000,000	20.181	(1,816,290,000)
2024120903558	B	USDMXN	12/11/2024	110,000,000	20.181	(2,219,910,000)
2024120903697	B	USDMXN	12/11/2024	49,392,961	20.2458	(1,000,000,000)
2024120903706	B	USDMXN	12/11/2024	49,393,692	20.2455	(1,000,000,000)
2024120903699	S	USDMXN	12/11/2024	(49,369,307)	20.2555	1,000,000,000
2024120903708	S	USDMXN	12/11/2024	(272,000)	20.23906	5,505,024
2024121003133	B	USDMXN	12/11/2024	54,228,598	20.2845	(1,100,000,000)
2024121003409	B	USDMXN	12/11/2024	30,000,000	20.213	(606,390,000)
2024121003458	B	USDMXN	12/11/2024	741,402	20.20849	(14,982,610)
2024121003107	S	USDMXN	12/11/2024	(165,000,000)	20.237	3,339,105,000
2024121003112	S	USDMXN	12/11/2024	(30,000,000)	20.19	605,700,000
2024121003120	S	USDMXN	12/11/2024	(914,892)	20.28351	18,557,215
2024121003139	S	USDMXN	12/11/2024	(165,000,000)	20.246	3,340,590,000
2024121103030	B	USDMXN	12/11/2024	84,241,824	20.18	(1,700,000,000)
2024121103034	B	USDMXN	12/11/2024	14,866,204	20.18	(300,000,000)
2024121103201	S	USDMXN	12/11/2024	(98,902,186)	20.222	2,000,000,000
2024030803687	B	USDMXN	12/13/2024	26,000,000	17.498	(454,948,000)
2024030803699	S	USDMXN	12/13/2024	(10,000,000)	17.5315	175,315,000
2024061003232	B	USDMXN	12/13/2024	70,000,000	18.9555	(1,326,885,000)
2024061003547	B	USDMXN	12/13/2024	20,000,000	18.822	(376,440,000)
2024061103773	B	USDMXN	12/13/2024	20,000,000	19.065	(381,300,000)
2024061103799	B	USDMXN	12/13/2024	10,000,000	19.065	(190,650,000)
2024061103807	B	USDMXN	12/13/2024	20,000,000	19.065	(381,300,000)
2024091003364	B	USDMXN	12/13/2024	50,000,000	20.323	(1,016,150,000)
2024110703287	S	USDMXN	12/13/2024	(80,000,000)	19.95	1,596,000,000
2024120403349	S	USDMXN	12/13/2024	(50,000,000)	20.2945	1,014,725,000
2024121003108	B	USDMXN	12/13/2024	165,000,000	20.2482	(3,340,953,000)
2024121003113	B	USDMXN	12/13/2024	30,000,000	20.2012	(606,036,000)
2024121003121	B	USDMXN	12/13/2024	914,892	20.295	(18,567,732)
2024121003140	B	USDMXN	12/13/2024	165,000,000	20.257	(3,342,405,000)
2024121003134	S	USDMXN	12/13/2024	(54,199,207)	20.2955	1,100,000,000
2024121003312	S	USDMXN	12/13/2024	(50,000,000)	20.282	1,014,100,000
2024121003410	S	USDMXN	12/13/2024	(30,000,000)	20.2228	606,684,000
2024121003459	S	USDMXN	12/13/2024	(741,402)	20.2149	14,987,363
2024121003613	S	USDMXN	12/13/2024	(100,000,000)	20.185	2,018,500,000
2024121003688	S	USDMXN	12/13/2024	(70,000,000)	20.18	1,412,600,000
2024121003741	S	USDMXN	12/13/2024	(100,000,000)	20.182	2,018,200,000
2024121003773	S	USDMXN	12/13/2024	(50,000,000)	20.18	1,009,000,000
2024121003809	S	USDMXN	12/13/2024	(30,000)	20.15051	604,515
2024121103202	B	USDMXN	12/13/2024	98,870,406	20.2285	(2,000,000,000)
2024121103629	B	USDMXN	12/13/2024	125,000,000	20.138	(2,517,250,000)
2024121103635	B	USDMXN	12/13/2024	23,000,000	20.133	(463,059,000)
2024121103649	B	USDMXN	12/13/2024	87,057	20.12404	(1,751,931)
2024121103031	S	USDMXN	12/13/2024	(84,215,950)	20.1862	1,700,000,000
2024121103035	S	USDMXN	12/13/2024	(14,861,638)	20.1862	300,000,000
2024030703499	BO	USDMXN	12/16/2024	590,000	17.6113	(10,390,667)
2024031303186	S	USDMXN	12/16/2024	(20,000,000)	17.477	349,540,000
2024050603504	BO	USDMXN	12/16/2024	129,000	17.47374	(2,254,112)
2024050603515	BO	USDMXN	12/16/2024	129,000	17.47374	(2,254,112)
2024061203191	B	USDMXN	12/16/2024	20,000,000	19.44	(388,800,000)
2024061203194	B	USDMXN	12/16/2024	20,000,000	19.4405	(388,810,000)
2024101003096	B	USDMXN	12/16/2024	70,000,000	19.674	(1,377,180,000)
2024111303240	B	USDMXN	12/16/2024	50,000,000	20.7207	(1,036,035,000)
2024111303242	B	USDMXN	12/16/2024	70,000,000	20.7207	(1,450,449,000)
2024121103630	S	USDMXN	12/16/2024	(125,000,000)	20.1473	2,518,412,500
2024121103636	S	USDMXN	12/16/2024	(23,000,000)	20.1423	463,272,900
2024121103650	S	USDMXN	12/16/2024	(87,057)	20.1313	1,752,563
2024121603269	S	USDMXN	12/16/2024	(20,000,000)	20.174	403,480,000
2024111303152	S	USDMXN	12/17/2024	(250,000,000)	20.7424	5,185,600,000
2024120903207	S	USDMXN	12/17/2024	(79,101,954)	20.185	1,596,672,939
2024121603265	B	USDMXN	12/17/2024	100,000,000	20.16	(2,016,000,000)
2024121603270	B	USDMXN	12/17/2024	20,000,000	20.1778	(403,556,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024121603352	B	USDMXN	12/17/2024	735,091	20.13159	(14,798,554)
2024121603637	B	USDMXN	12/17/2024	45,000,000	20.118	(905,310,000)
2024121603697	B	USDMXN	12/17/2024	45,000,000	20.118	(905,310,000)
2024121703117	S	USDMXN	12/17/2024	(30,000,000)	20.19	605,700,000
2023121403720	B	USDMXN	12/18/2024	15,000,000	18.2055	(273,082,500)
2023121803264	B	USDMXN	12/18/2024	30,000,000	18.303	(549,090,000)
2023121803267	S	USDMXN	12/18/2024	(30,000,000)	18.32335	549,700,635
2024022903038	B	USDMXN	12/18/2024	50,000,000	17.842	(892,100,000)
2024060403089	B	USDMXN	12/18/2024	20,000,000	18.368	(367,360,000)
2024061103033	S	USDMXN	12/18/2024	(56,000,000)	18.96	1,061,760,000
2024061403729	B	USDMXN	12/18/2024	30,000,000	19.006	(570,180,000)
2024071003089	B	USDMXN	12/18/2024	23,000,000	18.2917	(420,709,100)
2024071603409	S	USDMXN	12/18/2024	(97,000,000)	18.1145	1,757,106,500
2024082703119	B	USDMXN	12/18/2024	75,049	19.987	(1,500,000)
2024082703041	S	USDMXN	12/18/2024	(40,496,230)	19.972	808,790,697
2024091003064	S	USDMXN	12/18/2024	(39,601,920)	20.3823	807,178,219
2024091003196	S	USDMXN	12/18/2024	(39,017,479)	20.3823	795,265,962
2024092403012	B	USDMXN	12/18/2024	24,000,000	19.59	(470,160,000)
2024092403047	S	USDMXN	12/18/2024	(15,756,935)	19.6023	308,872,158
2024092603220	S	USDMXN	12/18/2024	(58,020,813)	19.7963	1,148,597,424
2024093003066	B	USDMXN	12/18/2024	29,656,051	19.8831	(589,654,230)
2024100203049	S	USDMXN	12/18/2024	(130,256,564)	19.7526	2,572,905,808
2024100903040	B	USDMXN	12/18/2024	82,502,779	19.6133	(1,618,151,746)
2024101503042	S	USDMXN	12/18/2024	(77,130,619)	19.808	1,527,803,296
2024101803037	B	USDMXN	12/18/2024	132,477,856	19.8855	(2,634,388,407)
2024103003043	B	USDMXN	12/18/2024	85,121,250	20.3112	(1,728,914,728)
2024103003722	BO	USDMXN	12/18/2024	1,000,000	20.33469	(20,334,691)
2024103003723	BO	USDMXN	12/18/2024	1,000,000	20.33619	(20,336,191)
2024103003725	BO	USDMXN	12/18/2024	1,000,000	20.33469	(20,334,691)
2024103003728	BO	USDMXN	12/18/2024	1,000,000	20.33619	(20,336,191)
2024103103511	SO	USDMXN	12/18/2024	(1,000,000)	20.13812	20,138,119
2024103103512	SO	USDMXN	12/18/2024	(1,000,000)	20.13612	20,136,119
2024103103516	SO	USDMXN	12/18/2024	(1,000,000)	20.13812	20,138,119
2024103103518	SO	USDMXN	12/18/2024	(1,000,000)	20.13612	20,136,119
2024110603750	BO	USDMXN	12/18/2024	2,010,000	20.33	(40,863,300)
2024110603726	SO	USDMXN	12/18/2024	(2,000,000)	20.26774	40,535,476
2024110603729	SO	USDMXN	12/18/2024	(2,000,000)	20.26774	40,535,476
2024110803360	BO	USDMXN	12/18/2024	2,000,000	20.39874	(40,797,484)
2024110803365	BO	USDMXN	12/18/2024	2,000,000	20.39874	(40,797,484)
2024111203397	SO	USDMXN	12/18/2024	(1,000,000)	20.74207	20,742,067
2024111203399	SO	USDMXN	12/18/2024	(1,000,000)	20.74887	20,748,867
2024112003214	BO	USDMXN	12/18/2024	1,000,000	20.39092	(20,390,921)
2024112003215	BO	USDMXN	12/18/2024	760,000	20.3872	(15,494,274)
2024112003219	BO	USDMXN	12/18/2024	1,000,000	20.39092	(20,390,921)
2024112003221	BO	USDMXN	12/18/2024	760,000	20.3872	(15,494,274)
2024112003429	BO	USDMXN	12/18/2024	240,000	20.42196	(4,901,271)
2024112003431	BO	USDMXN	12/18/2024	240,000	20.42196	(4,901,271)
2024120603328	B	USDMXN	12/18/2024	246,844,098	20.2557	(5,000,000,000)
2024120603342	B	USDMXN	12/18/2024	100,000,000	20.2805	(2,028,050,000)
2024120603286	S	USDMXN	12/18/2024	(493,729,634)	20.254	10,000,000,000
2024120903210	S	USDMXN	12/18/2024	(82,400,178)	20.186	1,663,330,000
2024121603266	S	USDMXN	12/18/2024	(100,000,000)	20.1637	2,016,370,000
2024121603353	S	USDMXN	12/18/2024	(735,091)	20.1341	14,800,397
2024121603638	S	USDMXN	12/18/2024	(45,000,000)	20.1217	905,476,500
2024121603698	S	USDMXN	12/18/2024	(45,000,000)	20.1217	905,476,500
2024121703118	B	USDMXN	12/18/2024	30,000,000	20.194	(605,820,000)
2024121703135	B	USDMXN	12/18/2024	50,000,000	20.165	(1,008,250,000)
2024121703141	B	USDMXN	12/18/2024	250,000,000	20.188	(5,047,000,000)
2024121703144	B	USDMXN	12/18/2024	150,000,000	20.204	(3,030,600,000)
2024121703156	B	USDMXN	12/18/2024	1,824,844	20.22229	(36,902,523)
2024121703328	B	USDMXN	12/18/2024	247,096,615	20.235	(5,000,000,000)
2024121703323	S	USDMXN	12/18/2024	(247,096,615)	20.235	5,000,000,000
2024121803055	S	USDMXN	12/18/2024	(25,000,000)	20.1	502,500,000
2023121503135	S	USDMXN	12/19/2024	(15,000,000)	18.2625	273,937,500
2024111403086	B	USDMXN	12/19/2024	50,000,000	20.6875	(1,034,375,000)
2024111403478	B	USDMXN	12/19/2024	50,000,000	20.592	(1,029,600,000)
2024121703729	B	USDMXN	12/19/2024	1,320,000	20.22794	(26,700,881)
2024121703136	S	USDMXN	12/19/2024	(50,000,000)	20.1691	1,008,455,000
2024121703142	S	USDMXN	12/19/2024	(250,000,000)	20.1922	5,048,050,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024121703145	S	USDMXN	12/19/2024	(150,000,000)	20.2082	3,031,230,000
2024121703157	S	USDMXN	12/19/2024	(1,824,844)	20.2257	36,908,742
2024121803056	B	USDMXN	12/19/2024	25,000,000	20.1105	(502,762,500)
2024121803332	B	USDMXN	12/19/2024	148,883,375	20.15	(3,000,000,000)
2024121803334	B	USDMXN	12/19/2024	100,000,000	20.15	(2,015,000,000)
2024121803361	B	USDMXN	12/19/2024	100,000,000	20.16	(2,016,000,000)
2024121803371	B	USDMXN	12/19/2024	133,000,000	20.15	(2,679,950,000)
2024121803376	B	USDMXN	12/19/2024	370,528	20.14172	(7,463,080)
2024121903379	B	USDMXN	12/19/2024	24,521,824	20.39	(500,000,000)
2024031503194	B	USDMXN	12/20/2024	20,000,000	17.4325	(348,650,000)
2024031503328	B	USDMXN	12/20/2024	30,000,000	17.421	(522,630,000)
2024061703602	B	USDMXN	12/20/2024	35,000,000	19.144	(670,040,000)
2024121003313	B	USDMXN	12/20/2024	50,000,000	20.3175	(1,015,875,000)
2024121003614	B	USDMXN	12/20/2024	100,000,000	20.219	(2,021,900,000)
2024121003689	B	USDMXN	12/20/2024	70,000,000	20.214	(1,414,980,000)
2024121003774	B	USDMXN	12/20/2024	50,000,000	20.214	(1,010,700,000)
2024121803333	S	USDMXN	12/20/2024	(148,794,762)	20.162	3,000,000,000
2024121803335	S	USDMXN	12/20/2024	(100,000,000)	20.162	2,016,200,000
2024121803362	S	USDMXN	12/20/2024	(100,000,000)	20.172	2,017,200,000
2024121803372	S	USDMXN	12/20/2024	(133,000,000)	20.162	2,681,546,000
2024121803377	S	USDMXN	12/20/2024	(370,528)	20.1445	7,464,110
2024121803735	S	USDMXN	12/20/2024	(107,000)	20.34658	2,177,084
2024121903044	B	USDMXN	12/20/2024	13,153,236	20.36	(267,799,883)
2024121903541	B	USDMXN	12/20/2024	43,000,000	20.397	(877,071,000)
2024121903552	B	USDMXN	12/20/2024	657,198	20.32267	(13,356,011)
2024121903380	S	USDMXN	12/20/2024	(24,513,409)	20.397	500,000,000
2023122003713	B	USDMXN	12/23/2024	20,000,000	18.177	(363,540,000)
2024031903512	B	USDMXN	12/23/2024	60,000,000	17.576	(1,054,560,000)
2024032003124	S	USDMXN	12/23/2024	(10,000,000)	17.5405	175,405,000
2024032003200	S	USDMXN	12/23/2024	(30,000,000)	17.52	525,600,000
2024041003568	S	USDMXN	12/23/2024	(60,000,000)	17.11	1,026,600,000
2024060603733	B	USDMXN	12/23/2024	14,000,000	18.142	(253,988,000)
2024061803279	B	USDMXN	12/23/2024	30,000,000	18.944	(568,320,000)
2024101703094	B	USDMXN	12/23/2024	30,000,000	20.183	(605,490,000)
2024101703423	B	USDMXN	12/23/2024	50,000,000	20.17	(1,008,500,000)
2024101703426	B	USDMXN	12/23/2024	30,000,000	20.17	(605,100,000)
2024101703507	B	USDMXN	12/23/2024	20,000,000	20.1055	(402,110,000)
2024101703567	B	USDMXN	12/23/2024	30,000,000	20.0955	(602,865,000)
2024101703792	B	USDMXN	12/23/2024	30,000,000	20.0955	(602,865,000)
2024111903329	S	USDMXN	12/23/2024	(100,000,000)	20.325	2,032,500,000
2024121603453	B	USDMXN	12/23/2024	100,000,000	20.146	(2,014,600,000)
2024121603397	S	USDMXN	12/23/2024	(100,000,000)	20.146	2,014,600,000
2024121903189	S	USDMXN	12/23/2024	(226,000)	20.48548	4,629,718
2024121903471	S	USDMXN	12/23/2024	(50,000,000)	20.395	1,019,750,000
2024121903542	S	USDMXN	12/23/2024	(43,000,000)	20.41	877,630,000
2024121903553	S	USDMXN	12/23/2024	(657,198)	20.32568	13,357,989
2024122003642	S	USDMXN	12/23/2024	(50,000,000)	20.072	1,003,600,000
2024122003655	S	USDMXN	12/23/2024	(116,802)	20.08819	2,346,348
2024121603398	B	USDMXN	12/24/2024	100,000,000	20.1498	(2,014,980,000)
2024121603454	S	USDMXN	12/24/2024	(100,000,000)	20.1498	2,014,980,000
2024122003643	B	USDMXN	12/24/2024	50,000,000	20.0765	(1,003,825,000)
2024122003656	B	USDMXN	12/24/2024	116,802	20.094	(2,347,026)
2024122003745	S	USDMXN	12/24/2024	(20,000,000)	20.08	401,600,000
2024122303366	S	USDMXN	12/24/2024	(7,855,133)	20.23509	158,949,295
2024062403539	S	USDMXN	12/26/2024	(30,000,000)	18.442	553,260,000
2024090903200	SO	USDMXN	12/26/2024	(375,962)	20.2148	7,600,000
2024090903629	SO	USDMXN	12/26/2024	(405,051)	20.21626	8,188,615
2024090903697	SO	USDMXN	12/26/2024	(405,051)	20.2203	8,190,253
2024090903699	SO	USDMXN	12/26/2024	(405,051)	20.2203	8,190,253
2024092303340	S	USDMXN	12/26/2024	(100,000,000)	19.7465	1,974,650,000
2024092703247	SON	USDMXN	12/26/2024	(150,000,000)	19.9018	2,985,270,000
2024102303081	S	USDMXN	12/26/2024	(50,000,000)	20.1775	1,008,875,000
2024102303330	S	USDMXN	12/26/2024	(50,000,000)	20.1355	1,006,775,000
2024112203107	B	USDMXN	12/26/2024	50,000,000	20.629	(1,031,450,000)
2024121703324	B	USDMXN	12/26/2024	246,734,469	20.2647	(5,000,000,000)
2024121703329	S	USDMXN	12/26/2024	(246,734,469)	20.2647	5,000,000,000
2024122303230	B	USDMXN	12/26/2024	247,770,069	20.18	(5,000,000,000)
2024122303367	B	USDMXN	12/26/2024	7,855,133	20.2443	(159,021,672)
2024122303226	S	USDMXN	12/26/2024	(247,770,069)	20.18	5,000,000,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024122403132	B	USDMXN	12/26/2024	120,000,000	20.177	(2,421,240,000)
2024122403137	B	USDMXN	12/26/2024	602,311	20.17847	(12,153,713)
2024062503621	S	USDMXN	12/27/2024	(25,000,000)	18.6631	466,577,500
2024092503006	B	USDMXN	12/27/2024	30,000,000	19.693	(590,790,000)
2024112503382	B	USDMXN	12/27/2024	100,000,000	20.395	(2,039,500,000)
2024121903100	B	USDMXN	12/27/2024	48,000,000	20.47	(982,560,000)
2024122403133	S	USDMXN	12/27/2024	(120,000,000)	20.1806	2,421,672,000
2024122403138	S	USDMXN	12/27/2024	(602,311)	20.1795	12,154,331
2024122603216	S	USDMXN	12/27/2024	(22,000,000)	20.185	444,070,000
2024122603223	S	USDMXN	12/27/2024	(417,551)	20.14523	8,411,665
2024122603217	B	USDMXN	12/30/2024	22,000,000	20.1954	(444,298,800)
2024122603224	B	USDMXN	12/30/2024	417,551	20.1625	(8,418,875)
2024122703150	S	USDMXN	12/30/2024	(9,940,862)	20.22583	201,062,207
2024122703059	B	USDMXN	12/31/2024	50,000,000	20.31	(1,015,500,000)
2024122703061	B	USDMXN	12/31/2024	20,000,000	20.31	(406,200,000)
2024122703063	B	USDMXN	12/31/2024	100,000,000	20.34	(2,034,000,000)
2024122703143	B	USDMXN	12/31/2024	3,717,000	20.24449	(75,248,769)
2024122703151	B	USDMXN	12/31/2024	9,940,862	20.2306	(201,109,595)
2024122703216	B	USDMXN	12/31/2024	25,000,000	20.232	(505,800,000)
2024122703056	S	USDMXN	12/31/2024	(233,874,938)	20.31	4,750,000,000
2024123003542	S	USDMXN	12/31/2024	(73,000,000)	20.59	1,503,070,000
2024123003548	S	USDMXN	12/31/2024	(267,336)	20.60503	5,508,463

## LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SOB970	17/10/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SOB971	29/10/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SOB972	02/11/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SOB973	04/11/2027	Unwound	390,000,000	mxn	390,000,000	390,000,000	
SOB974	17/04/2029	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SOB975	26/09/2029	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNU162	30/12/2025	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNU163	26/12/2025	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNU164	24/12/2025	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SNU165	04/12/2025	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SNU166	26/12/2025	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNU167	23/12/2025	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNU168	29/12/2025	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNU169	04/12/2025	Unwound	390,000,000	mxn	390,000,000	390,000,000	
SNU170	24/12/2025	Unwound	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SNU171	26/12/2025	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNU172	24/10/2029	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SNU173	24/12/2025	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNU174	30/12/2025	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNU175	19/10/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNU176	25/10/2029	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNU177	28/10/2031	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNU178	26/10/2034	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SNU179	11/01/2034	Unwound	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SNU180	29/10/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNU181	17/10/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNU182	02/11/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNU183	26/09/2029	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNU184	04/11/2027	Unwound	390,000,000	mxn	390,000,000	390,000,000	
SNU185	17/04/2029	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNU027	17/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNU028	17/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNT738	24/12/2025	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SNT739	26/12/2025	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT740	26/12/2025	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT741	04/12/2025	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SNT742	30/12/2025	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT743	24/12/2025	Unwound	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SNT744	23/12/2025	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNT745	26/12/2025	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNT746	04/12/2025	Unwound	390,000,000	mxn	390,000,000	390,000,000	
SNT747	29/12/2025	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT748	30/12/2025	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNT749	24/12/2025	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT472	19/09/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT473	16/10/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT474	22/10/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT482	25/10/2029	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT483	24/10/2029	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SNT484	19/10/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT485	28/10/2031	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT486	26/10/2034	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SNT487	11/01/2034	Unwound	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SNT488	29/10/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNT489	17/10/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNT490	02/11/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT491	04/11/2027	Unwound	390,000,000	mxn	390,000,000	390,000,000	
SNT492	17/04/2029	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNT493	26/09/2029	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT287	07/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT288	20/06/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT289	20/07/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT290	06/07/2034	Unwound	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	
SNT291	03/07/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT292	27/07/2028	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT293	23/07/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNT294	05/08/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT295	03/08/2028	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SNT296	07/08/2029	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	



Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SNT297	13/08/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT298	14/08/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT299	15/08/2031	Unwound	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SNT300	26/08/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT301	26/08/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT302	20/08/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT303	30/08/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT304	27/08/2029	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT305	03/09/2029	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT307	11/09/2034	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT308	08/09/2034	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SNT253	03/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT254	19/02/2026	Unwound	315,000,000	mxn	315,000,000	315,000,000	
SNT255	08/02/2034	Unwound	92,000,000	mxn	92,000,000	92,000,000	
SNT256	16/02/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT257	13/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT258	14/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT259	16/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT260	27/02/2026	Unwound	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	
SNT261	03/03/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT262	04/03/2027	Unwound	680,000,000	mxn	680,000,000	680,000,000	
SNT263	28/02/2029	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT264	09/03/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT265	24/03/2027	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNT266	09/03/2034	Unwound	125,000,000	mxn	125,000,000	125,000,000	
SNT267	25/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT268	29/03/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT269	29/03/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT270	09/04/2029	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT271	03/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT272	03/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT273	10/04/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNT274	13/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT275	12/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT276	24/04/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNT277	03/05/2027	Unwound	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SNT278	02/05/2029	Unwound	190,000,000	mxn	190,000,000	190,000,000	
SNT279	04/05/2029	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SNT280	14/05/2026	Unwound	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SNT281	02/05/2034	Unwound	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	
SNT282	04/05/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT283	11/06/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT284	22/05/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT285	08/05/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT286	08/06/2029	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNT235	05/11/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT236	29/09/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT237	21/10/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT238	08/10/2026	Unwound	340,000,000	mxn	340,000,000	340,000,000	
SNT239	22/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT240	07/12/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNT241	20/01/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT242	28/11/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT243	10/01/2034	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT244	19/01/2028	Unwound	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	
SNT245	11/01/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT246	13/01/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT247	05/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT248	18/01/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT249	06/02/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SNT250	10/02/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT251	12/02/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT252	02/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT232	04/08/2028	Unwound	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SNT233	11/08/2028	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT234	10/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT198	23/12/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT199	06/01/2028	Unwound	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SNT200	03/01/2030	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT201	03/01/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT202	03/01/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT203	17/01/2028	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT204	07/01/2033	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT205	18/01/2033	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT206	29/01/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT207	26/01/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT208	01/02/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT209	11/02/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT210	19/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SNT211	17/02/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT212	22/02/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT213	18/02/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT214	24/02/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT215	25/02/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT216	02/03/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT217	13/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT218	19/03/2027	Unwound	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SNT219	15/03/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT220	16/04/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT221	22/04/2026	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SNT222	08/05/2028	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT223	30/05/2028	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNT224	31/05/2028	Unwound	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SNT225	02/06/2028	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNT226	31/05/2030	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SNT227	07/07/2028	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SNT228	16/06/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT229	10/07/2028	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SNT230	05/07/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT231	27/07/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT161	08/09/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT162	11/09/2031	Unwound	95,000,000	mxn	95,000,000	95,000,000	
SNT163	15/09/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT164	15/09/2031	Unwound	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	
SNT165	15/09/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT166	29/09/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT167	03/10/2031	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNT168	29/09/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT169	23/10/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT170	17/11/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT171	15/01/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT172	04/02/2027	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT173	15/01/2032	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT174	04/02/2027	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT175	05/03/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT176	12/03/2027	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT177	12/03/2027	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT178	16/03/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT179	24/03/2026	Unwound	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SNT180	16/04/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT181	12/05/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT182	10/05/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT183	29/04/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT184	05/05/2032	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT185	07/06/2027	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNT186	09/06/2032	Unwound	155,000,000	mxn	155,000,000	155,000,000	
SNT187	15/06/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT188	23/06/2026	Unwound	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SNT189	02/07/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT190	12/07/2032	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT191	31/07/2026	Unwound	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SNT192	21/07/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT193	03/08/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT194	28/08/2026	Unwound	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SNT195	15/10/2026	Unwound	245,000,000	mxn	245,000,000	245,000,000	
SNT196	06/08/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT197	14/12/2026	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SNT152	17/04/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT153	18/04/2031	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SNT154	04/04/2031	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNT155	30/04/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT156	18/05/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT157	25/04/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT158	30/04/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT159	30/04/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT160	03/08/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT145	10/05/2028	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT146	10/05/2028	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT147	07/03/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT148	18/12/2029	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT149	15/01/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT150	25/03/2026	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNT151	31/03/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNT126	24/09/2027	Unwound	365,000,000	mxn	365,000,000	365,000,000	
SNT127	21/09/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNT128	24/09/2027	Unwound	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	
SNT129	28/09/2026	Unwound	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000	
SNT130	27/09/2029	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT131	02/10/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SNT132	03/10/2029	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SNT133	07/10/2027	Unwound	365,000,000	mxn	365,000,000	365,000,000	
SNT134	05/10/2034	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT135	09/10/2034	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNT136	29/10/2027	Unwound	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SNT137	11/10/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT138	23/10/2034	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNT139	30/10/2029	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNT140	04/11/2026	Unwound	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SNT141	03/11/2034	Unwound	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SNT142	13/11/2029	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT089	27/06/2029	Unwound	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	
SNT090	19/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT091	07/07/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNT092	19/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT093	09/07/2029	Unwound	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	
SNT094	04/07/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT095	17/07/2026	Unwound	490,000,000	mxn	490,000,000	490,000,000	
SNT096	13/07/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNT097	27/07/2029	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
SNT098	12/07/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNT099	31/07/2026	Unwound	515,000,000	mxn	515,000,000	515,000,000	
SNT100	30/07/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNT101	09/08/2027	Unwound	355,000,000	mxn	355,000,000	355,000,000	
SNT102	31/08/2026	Unwound	325,000,000	mxn	325,000,000	325,000,000	
SNT103	24/08/2029	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNT104	30/08/2027	Unwound	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	
SNT105	06/09/2027	Unwound	1,140,000,000	mxn	1,140,000,000	1,140,000,000	
SNT106	03/06/2027	Unwound	410,900,000	mxn	410,900,000	410,900,000	
SNT107	22/10/2029	Unwound	245,000,000	mxn	245,000,000	245,000,000	
SNT108	25/09/2026	Unwound	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SNT109	14/09/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT110	25/09/2026	Unwound	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SNT111	15/09/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT112	24/09/2029	Unwound	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	
SNT113	15/09/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT114	28/09/2026	Unwound	535,000,000	mxn	535,000,000	535,000,000	
SNT115	26/09/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNT116	30/09/2027	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNT117	04/10/2028	Unwound	570,000,000	mxn	570,000,000	570,000,000	
SNT118	07/10/2026	Unwound	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SNT119	08/10/2026	Unwound	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SNT120	03/10/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNT121	16/10/2026	Unwound	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SNT122	05/11/2026	Unwound	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SNT123	24/10/2034	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT124	07/11/2034	Unwound	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	
SNT125	24/09/2027	Unwound	365,000,000	mxn	365,000,000	365,000,000	
SNT055	26/09/2031	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNT056	05/10/2026	Unwound	245,000,000	mxn	245,000,000	245,000,000	
SNT057	22/10/2031	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNT058	30/10/2031	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT059	05/01/2032	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNT060	19/02/2026	Unwound	295,000,000	mxn	295,000,000	295,000,000	
SNT061	09/01/2032	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SNT062	05/02/2027	Unwound	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SNT063	30/01/2035	Unwound	49,000,000	mxn	49,000,000	49,000,000	
SNT064	17/02/2027	Unwound	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SNT065	28/09/2026	Unwound	465,000,000	mxn	465,000,000	465,000,000	
SNT066	12/07/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT067	07/02/2029	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT068	08/02/2029	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT069	08/02/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNT070	15/02/2034	Unwound	65,000,000	mxn	65,000,000	65,000,000	
SNT071	25/02/2026	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNT072	04/03/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SNT073	06/03/2029	Unwound	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SNT074	03/04/2029	Unwound	205,000,000	mxn	205,000,000	205,000,000	
SNT075	07/03/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT076	27/04/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SNT077	11/04/2031	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SNT078	03/04/2031	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SNT079	26/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT080	28/04/2031	Unwound	165,000,000	mxn	165,000,000	165,000,000	
SNT081	05/05/2027	Unwound	325,000,000	mxn	325,000,000	325,000,000	
SNT082	12/05/2026	Unwound	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SNT083	11/05/2027	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SNT084	14/05/2026	Unwound	460,000,000	mxn	460,000,000	460,000,000	
SNT085	08/06/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SNT086	10/06/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNT087	26/06/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNT088	07/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT018	21/07/2028	Unwound	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SNT019	10/06/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT020	21/06/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT021	22/07/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT022	18/02/2026	Unwound	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	
SNT023	21/02/2029	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SNT024	19/03/2026	Unwound	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	
SNT025	28/02/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT026	30/03/2034	Unwound	125,000,000	mxn	125,000,000	125,000,000	
SNT027	18/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT028	04/05/2026	Unwound	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	
SNT029	24/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT030	06/05/2026	Unwound	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	
SNT031	03/05/2028	Unwound	255,000,000	mxn	255,000,000	255,000,000	
SNT032	04/05/2029	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SNT033	08/05/2026	Unwound	465,000,000	mxn	465,000,000	465,000,000	
SNT034	04/06/2026	Unwound	480,000,000	mxn	480,000,000	480,000,000	
SNT035	24/05/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT036	29/05/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT037	14/06/2028	Unwound	275,000,000	mxn	275,000,000	275,000,000	
SNT038	07/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNT039	25/06/2029	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
SNT040	07/07/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNT041	03/08/2026	Unwound	520,000,000	mxn	520,000,000	520,000,000	
SNT042	26/07/2027	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SNT043	10/07/2029	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNT044	06/08/2029	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
SNT045	02/08/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNT046	10/08/2028	Unwound	165,000,000	mxn	165,000,000	165,000,000	
SNT047	18/08/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNT048	25/08/2028	Unwound	175,000,000	mxn	175,000,000	175,000,000	
SNT049	31/08/2026	Unwound	535,000,000	mxn	535,000,000	535,000,000	
SNT050	31/08/2026	Unwound	1,080,000,000	mxn	1,080,000,000	1,080,000,000	
SNT051	04/09/2028	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNT052	04/09/2028	Unwound	890,000,000	mxn	890,000,000	890,000,000	
SNT053	01/03/2029	Unwound	267,500,000	mxn	267,500,000	267,500,000	
SNT054	30/01/2026	Unwound	2,075,000,000	mxn	2,075,000,000	2,075,000,000	
SNT010	02/10/2026	Unwound	490,000,000	mxn	490,000,000	490,000,000	
SNT011	29/01/2032	Unwound	142,000,000	mxn	142,000,000	142,000,000	
SNT012	28/10/2031	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNT013	24/09/2031	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNT014	03/01/2033	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SNT015	03/02/2028	Unwound	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	
SNT016	18/02/2026	Unwound	355,000,000	mxn	355,000,000	355,000,000	
SNT017	05/02/2030	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNS979	17/10/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNS980	07/11/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS981	07/10/2030	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNS982	24/01/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNS983	24/01/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNS984	10/02/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNS985	13/02/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS986	19/02/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS987	24/02/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS988	26/03/2029	Unwound	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	
SNS964	16/07/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS965	09/07/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNS966	26/07/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS967	17/07/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNS968	24/07/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS969	05/08/2030	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNS970	02/08/2030	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNS971	07/08/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNS972	14/08/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNS973	19/08/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS974	11/09/2030	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNS975	29/08/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS976	16/09/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNS977	19/08/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS978	12/09/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNS963	05/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS961	17/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS962	19/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS923	16/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS924	16/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS925	16/03/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	







Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SNS356	06/04/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS357	14/06/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS358	16/06/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS359	06/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS361	06/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS362	07/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS363	07/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS364	06/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS365	07/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS366	11/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS328	25/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS329	24/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS330	24/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS331	21/01/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS332	26/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS333	10/02/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS334	08/02/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS335	02/01/2026	Unwound	1,250,000,000	mxn	1,250,000,000	1,250,000,000	
SNS336	25/02/2027	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SNS337	29/01/2027	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SNS338	26/01/2029	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SNS339	11/11/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS340	09/12/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS341	26/11/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS342	29/11/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS343	09/12/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNS344	04/01/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS345	04/01/2030	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS346	14/01/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNS347	07/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNR285	13/11/2029	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNR284	07/11/2034	Unwound	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	
SNR065	03/11/2034	Unwound	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SNQ904	26/09/2029	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNQ903	17/04/2029	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNQ757	11/01/2034	Unwound	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SNQ494	28/10/2031	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNQ495	13/05/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNQ493	11/05/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNQ491	18/01/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNQ492	03/08/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNQ489	15/03/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNQ490	18/01/2033	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNQ488	05/07/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
EA0801	02/04/2025	Unwound		mxn			101,840,000
EA0802	02/04/2025	Unwound		mxn			101,840,000
SNP954	05/11/2026	Unwound	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SNP939	26/10/2034	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SNP768	04/11/2027	Unwound	390,000,000	mxn	390,000,000	390,000,000	
SNP675	04/11/2026	Unwound	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SNP370	30/10/2029	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNP371	24/10/2034	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNP342	28/10/2031	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNP149	23/10/2034	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNP099	02/11/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNO865	29/10/2027	Unwound	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SNO668	25/10/2029	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNO657	29/10/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNO651	19/10/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNO431	24/10/2029	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SNO313	17/10/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SNO165	22/10/2029	Unwound	245,000,000	mxn	245,000,000	245,000,000	
SNO132	25/10/2027	Unwound	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	
SNN908	22/10/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNN547	15/10/2031	Unwound	195,000,000	mxn	195,000,000	195,000,000	
SNN516	11/10/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNN152	09/10/2034	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNN946	19/10/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNM878	16/10/2026	Unwound	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SNM717	16/10/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNM650	05/10/2034	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNM023	08/10/2029	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNL880	09/10/2026	Unwound	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SNL803	29/09/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNL630	08/10/2026	Unwound	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SNL629	07/10/2027	Unwound	365,000,000	mxn	365,000,000	365,000,000	
SNL277	07/10/2026	Unwound	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SNL255	04/10/2028	Unwound	570,000,000	mxn	570,000,000	570,000,000	
SNL257	03/10/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SNL251	03/10/2029	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
C97179	25/10/2028	Unwound		mxn/usd	350,850,000	19,182,613	
SNK928	02/10/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNK140	30/09/2027	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SNK118	27/09/2029	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNJ732	26/09/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNJ715	07/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNJ714	07/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNJ713	07/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNJ710	06/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNJ706	06/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNJ703	06/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNJ702	11/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNJ684	11/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNJ682	11/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNJ680	16/06/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNJ460	08/04/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNJ457	05/05/2032	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNJ458	27/07/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNJ459	09/06/2027	Unwound	265,000,000	mxn	265,000,000	265,000,000	
SNJ455	12/05/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SNJ456	17/02/2027	Unwound	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SNJ449	18/02/2026	Unwound	355,000,000	mxn	355,000,000	355,000,000	
SNJ406	24/09/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNJ400	04/08/2026	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNJ399	06/12/2039	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNJ396	18/12/2029	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNJ397	16/03/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNJ393	04/07/2028	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNJ394	26/07/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNJ395	15/01/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNJ392	09/03/2032	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNJ267	28/09/2026	Unwound	535,000,000	mxn	535,000,000	535,000,000	
SNJ265	24/09/2029	Unwound	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	
SNJ266	28/09/2026	Unwound	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000	
SNJ148	02/02/2029	Unwound	98,971,745	mxn	98,971,745	98,971,745	
SNJ143	02/02/2029	Unwound	78,162,127	mxn	78,162,127	78,162,127	
SNJ144	02/02/2029	Unwound	305,723,270	mxn	305,723,270	305,723,270	
SNI933	24/09/2027	Unwound	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	
SNI886	15/09/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNI860	15/09/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNI861	21/09/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNI857	25/09/2026	Unwound	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SNI858	24/09/2027	Unwound	365,000,000	mxn	365,000,000	365,000,000	
SNI855	25/09/2026	Unwound	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SNI856	24/09/2027	Unwound	365,000,000	mxn	365,000,000	365,000,000	
SNI665	14/09/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SNI558	19/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNI415	18/09/2031	Unwound	155,000,000	mxn	155,000,000	155,000,000	
SNI277	19/09/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNI203	19/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNI126	17/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNI116	17/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNI111	17/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH904	14/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH903	17/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH897	17/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH894	17/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH864	11/09/2034	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNH643	08/09/2034	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SNH624	13/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH611	14/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH359	13/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH244	11/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH238	07/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH089	07/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH083	07/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNH072	07/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG677	11/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG621	05/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG611	05/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG608	04/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG598	04/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG595	04/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG420	07/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG412	07/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG354	07/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG351	07/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG345	01/09/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SNG030	05/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG022	05/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNG010	03/06/2027	Unwound	410,900,000	mxn	410,900,000	410,900,000	
SNG009	01/03/2029	Unwound	267,500,000	mxn	267,500,000	267,500,000	
SNF731	04/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNF726	04/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNF713	04/09/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SNF635	06/09/2027	Unwound	1,140,000,000	mxn	1,140,000,000	1,140,000,000	
SNF636	04/09/2028	Unwound	890,000,000	mxn	890,000,000	890,000,000	
SNF623	04/09/2028	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SNF533	03/09/2029	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SNF298	03/09/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNE810	31/08/2026	Unwound	325,000,000	mxn	325,000,000	325,000,000	
SNE753	31/08/2026	Unwound	1,080,000,000	mxn	1,080,000,000	1,080,000,000	
SNE714	30/08/2027	Unwound	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	
SNE712	31/08/2026	Unwound	535,000,000	mxn	535,000,000	535,000,000	
SNE710	27/08/2029	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNE681	30/08/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNE670	30/08/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNE572	25/08/2028	Unwound	175,000,000	mxn	175,000,000	175,000,000	
SNE570	24/08/2029	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SNE482	24/08/2029	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SNE295	10/02/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNE121	26/08/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNE045	26/08/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SND935	20/08/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SND801	21/08/2029	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SND420	15/08/2031	Unwound	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SNC926	18/08/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNA732	13/08/2027	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SNA686	14/08/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNA681	13/08/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SNA537	10/08/2028	Unwound	165,000,000	mxn	165,000,000	165,000,000	
SNA412	06/08/2029	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SNA409	03/08/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNA309	02/08/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SNA301	06/08/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SNA115	07/08/2029	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SMZ981	09/08/2027	Unwound	355,000,000	mxn	355,000,000	355,000,000	
SMZ980	06/08/2029	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
SMZ966	06/08/2029	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMZ521	30/07/2029	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMZ518	27/07/2029	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMZ510	26/07/2029	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMZ439	03/08/2028	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SMZ392	05/08/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SMZ146	01/08/2029	Unwound	125,000,000	mxn	125,000,000	125,000,000	
SMY787	30/07/2029	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SMY788	03/08/2026	Unwound	520,000,000	mxn	520,000,000	520,000,000	
SMY744	30/07/2029	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMY657	31/07/2026	Unwound	515,000,000	mxn	515,000,000	515,000,000	
SMY589	27/07/2029	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
SMY530	27/07/2029	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMY361	26/07/2029	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMY348	29/07/2027	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SMY319	27/07/2028	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SMX743	26/07/2027	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SMX686	26/07/2027	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SMX356	14/07/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SMW950	13/07/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SMW946	06/07/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SMW933	23/07/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SMW932	22/07/2027	Unwound	340,000,000	mxn	340,000,000	340,000,000	
SMW903	23/07/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SMW817	21/07/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SMW770	12/07/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SMW559	11/07/2034	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SMW495	20/07/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SMW227	18/02/2029	Unwound	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	
SMW204	17/07/2026	Unwound	490,000,000	mxn	490,000,000	490,000,000	
SMW165	16/07/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SMV930	06/07/2034	Unwound	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	
E97507	29/11/2024	Unwound		mxn			45,430,000
E97506	29/11/2024	Unwound		mxn			45,430,000
SMV703	09/07/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SMV592	10/07/2029	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SMV593	04/07/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SMV364	09/07/2029	Unwound	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	
SMV328	09/07/2029	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SMV313	10/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SMV311	03/07/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SMU698	09/07/2026	Unwound	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SMU569	07/07/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SMU294	07/07/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SMT642	27/06/2029	Unwound	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	
SMT418	20/06/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SMT352	19/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SMT350	19/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SMT348	25/06/2029	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
E97226	03/12/2026	Unwound		mxn			252,985,000
E97225	03/12/2026	Unwound		mxn			252,985,000
SMS849	26/06/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SMR094	07/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SMR092	07/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SMR093	14/06/2028	Unwound	275,000,000	mxn	275,000,000	275,000,000	
SMQ929	07/06/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SMQ154	08/06/2029	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SMP765	11/06/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SMP501	10/06/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SLQ097	29/05/2034	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SLQ096	08/06/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SLP577	04/06/2026	Unwound	480,000,000	mxn	480,000,000	480,000,000	
SLP409	04/06/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SLP405	31/05/2029	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SLP330	24/05/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLP015	23/05/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLO846	22/05/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SLO847	01/06/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SLO728	01/06/2026	Unwound	700,000,000	mxn	700,000,000	700,000,000	
SLO437	19/05/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLN553	12/05/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLM460	15/05/2029	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SLJ431	08/05/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SLJ402	18/05/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SLJ253	05/05/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLJ182	05/05/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SLJ090	14/05/2026	Unwound	460,000,000	mxn	460,000,000	460,000,000	
SLI841	14/05/2026	Unwound	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SLI826	04/05/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLI503	11/05/2027	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SLI430	02/05/2034	Unwound	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	
SLI422	12/05/2026	Unwound	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SLI353	11/05/2027	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SLI331	11/05/2027	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SLI240	11/05/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SLI079	08/05/2026	Unwound	460,000,000	mxn	460,000,000	460,000,000	
SLI070	08/05/2026	Unwound	465,000,000	mxn	465,000,000	465,000,000	
SLI069	04/05/2029	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SLH967	04/05/2029	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SLH924	07/05/2026	Unwound	460,000,000	mxn	460,000,000	460,000,000	
SLH817	03/05/2028	Unwound	255,000,000	mxn	255,000,000	255,000,000	
SLH818	05/05/2027	Unwound	325,000,000	mxn	325,000,000	325,000,000	
SLH757	06/05/2026	Unwound	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	
SLH756	26/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLH426	02/05/2029	Unwound	190,000,000	mxn	190,000,000	190,000,000	
SLH288	28/04/2031	Unwound	165,000,000	mxn	165,000,000	165,000,000	
SLH289	24/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLH221	03/05/2027	Unwound	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SLH203	29/04/2029	Unwound	206,000,000	mxn	206,000,000	206,000,000	
SLH191	04/05/2026	Unwound	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	
SLG851	30/04/2027	Unwound	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SLG138	27/04/2027	Unwound	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SLG034	18/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLF878	27/04/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SLF675	24/04/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SLF507	24/04/2026	Unwound	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SLF376	23/04/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SLF346	23/04/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SLF252	13/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLF053	12/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLF052	21/04/2027	Unwound	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SLE655	10/04/2034	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SLE543	11/04/2031	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SLE388	10/04/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SLE276	10/04/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SLD946	16/04/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SLD685	05/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLD010	03/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SLC998	03/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLC867	03/04/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLC829	09/04/2029	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SLC663	10/04/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SLC193	03/04/2031	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SLC192	30/03/2034	Unwound	125,000,000	mxn	125,000,000	125,000,000	
SLB912	29/03/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SLB818	29/03/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SLB737	03/04/2029	Unwound	205,000,000	mxn	205,000,000	205,000,000	
SLB467	27/03/2034	Unwound	125,000,000	mxn	125,000,000	125,000,000	
SLB258	08/04/2027	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SLA350	29/03/2027	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SLA177	25/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SLA092	24/03/2027	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SKZ915	23/03/2027	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SKZ494	10/03/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKZ314	19/03/2026	Unwound	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	
SKZ146	09/03/2034	Unwound	125,000,000	mxn	125,000,000	125,000,000	
SKY221	07/03/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKX887	09/03/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SKX349	28/02/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKX350	06/03/2029	Unwound	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SKW951	08/03/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
E94569	12/11/2024	Unwound		mxn			78,310,000
E94564	12/11/2024	Unwound		mxn			78,310,000
SKW553	04/03/2027	Unwound	680,000,000	mxn	680,000,000	680,000,000	
SKW487	25/02/2026	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	
SKW314	04/03/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SKW252	28/02/2029	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SKW240	03/03/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SKW203	28/02/2029	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SKV936	21/02/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SKV845	02/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SKV534	27/02/2026	Unwound	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	
SKV533	26/02/2027	Unwound	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SKV435	17/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKV413	27/02/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SKV204	16/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKV042	15/02/2034	Unwound	65,000,000	mxn	65,000,000	65,000,000	
SKV043	21/02/2029	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SKU991	23/02/2028	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKU816	26/02/2029	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SKU813	26/02/2029	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
M00247439	26/02/2029	Unwound		mxn			30,000,000
SKU795	14/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKU780	26/02/2029	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SKU622	19/02/2029	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKU613	13/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKU556	13/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKU283	16/02/2029	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SKU266	16/02/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SKU093	19/02/2026	Unwound	315,000,000	mxn	315,000,000	315,000,000	
SKT986	08/02/2034	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SKT987	18/02/2026	Unwound	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	
SKT970	17/02/2027	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SKT844	08/02/2034	Unwound	92,000,000	mxn	92,000,000	92,000,000	
SKT843	17/02/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SKT677	12/02/2029	Unwound	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SKT604	16/02/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SKT420	13/02/2026	Unwound	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SKT282	03/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKT273	12/02/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SKT169	08/02/2029	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKT077	02/02/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKS820	07/02/2029	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKS795	10/02/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SKS604	06/02/2029	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SKS307	05/02/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SKS193	06/02/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SKS194	02/02/2029	Unwound	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SKR989	05/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SKR930	05/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SKP356	20/01/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKO948	18/01/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKO695	17/01/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKO247	13/01/2034	Unwound	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	
SKO248	13/01/2034	Unwound	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SKO210	13/01/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKO148	27/12/2028	Unwound	5,200,000	usd	5,200,000	5,200,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SKO039	27/12/2028	Unwound	2,250,000	usd	2,250,000	2,250,000	
SKN974	12/01/2034	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKN826	19/01/2028	Unwound	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	
SKN797	11/01/2034	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKN446	20/01/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SKN362	10/01/2034	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SKN065	16/01/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SKL685	08/01/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SKL311	29/12/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKH675	01/12/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKH251	09/12/2026	Unwound	190,000,000	mxn	190,000,000	190,000,000	
SKH209	09/12/2026	Unwound	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	
SKG789	28/11/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKG764	07/12/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SKF712	22/11/2033	Unwound	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
P19325	19/06/2027	Unwound		mxn			420,000,000
SKD950	10/11/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
E91723	21/11/2024	Unwound		mxn			26,600,000
E91720	21/11/2024	Unwound		mxn			26,600,000
E91686	13/11/2024	Unwound		mex			14,626,700
E91685	13/11/2024	Unwound		mex			14,626,700
SKC457	06/11/2028	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SKC127	05/11/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SKB138	21/10/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJY236	06/10/2028	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SJY051	29/09/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SJY011	08/10/2026	Unwound	340,000,000	mxn	340,000,000	340,000,000	
SJX186	22/09/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SJX182	22/09/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SJX178	26/09/2030	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SJV709	19/09/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SJT871	09/09/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SJS220	11/09/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SJR481	29/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJR480	29/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJQ263	22/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJP879	18/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJP554	16/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJP262	12/08/2033	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SJO574	11/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJO153	10/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJN557	05/08/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJN537	14/08/2026	Unwound	315,000,000	mxn	315,000,000	315,000,000	
SJN536	11/08/2028	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SJM755	07/08/2026	Unwound	335,000,000	mxn	335,000,000	335,000,000	
SJM756	04/08/2028	Unwound	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SJL839	03/08/2026	Unwound	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SJL541	22/07/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJL248	29/07/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SJK418	21/07/2028	Unwound	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SJJ916	12/07/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJJ815	18/07/2028	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJJ537	20/07/2026	Unwound	17,000,000	mxn	17,000,000	17,000,000	
SJJ033	11/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJJ032	11/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJJ031	11/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJI852	10/07/2028	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SJI815	04/07/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJI627	07/07/2028	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SJI595	07/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJI593	07/07/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJI590	07/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJI460	06/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJI308	06/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJI293	06/07/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJH847	28/09/2026	Unwound	465,000,000	mxn	465,000,000	465,000,000	
SJH813	27/06/2033	Unwound	35,000,000	mxn	35,000,000	35,000,000	
SJH147	21/06/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJG447	16/06/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJF632	10/06/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJF583	16/06/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJF461	14/06/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJF186	14/06/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJE355	06/06/2030	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SJE110	05/06/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJD632	05/06/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJD397	31/05/2030	Unwound	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SJD385	02/06/2028	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SJD073	31/05/2028	Unwound	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	



Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SJC853	30/05/2028	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SIP845	14/05/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SIP734	14/05/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SIP027	12/05/2026	Unwound	7,900,000	mxn	7,900,000	7,900,000	
SIP022	12/05/2026	Unwound	7,900,000	mxn	7,900,000	7,900,000	
SIO848	08/05/2028	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SIO517	10/05/2026	Unwound	114,000,000	mxn	114,000,000	114,000,000	
M00057709	27/04/2028	Unwound		usd		7,712,000	
M00057710	27/04/2028	Unwound		usd		2,360,000	
M00057708	27/04/2028	Unwound		usd		170,000	
M00057707	27/04/2028	Unwound		usd		4,330,000	
SIM924	28/04/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SIM908	27/04/2028	Unwound	2,360,000	usd	2,360,000	2,360,000	
SIM903	27/04/2028	Unwound	7,712,000	usd	7,712,000	7,712,000	
SIM902	27/04/2028	Unwound	170,000	usd	170,000	170,000	
SIM900	27/04/2028	Unwound	4,330,000	usd	4,330,000	4,330,000	
SIM867	27/04/2028	Unwound	7,712,000	usd	7,712,000	7,712,000	
SIM863	27/04/2028	Unwound	170,000	usd	170,000	170,000	
SIM852	27/04/2028	Unwound	2,360,000	usd	2,360,000	2,360,000	
SIM844	27/04/2028	Unwound	4,330,000	usd	4,330,000	4,330,000	
SIM807	27/04/2028	Unwound	14,572,000	usd	14,572,000	14,572,000	
SIM805	27/04/2028	Unwound	14,572,000	usd	14,572,000	14,572,000	
SIM400	22/04/2026	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SIK622	16/04/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SIK613	15/06/2028	Unwound	47,460,000	mxn	47,460,000	47,460,000	
SIK081	04/04/2033	Unwound	185,000,000	mxn	185,000,000	185,000,000	
SIJ934	06/04/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIJ707	19/03/2030	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIJ706	19/03/2030	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIJ705	06/04/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIJ609	31/03/2033	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SIH350	25/03/2026	Unwound	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SIG608	19/03/2027	Unwound	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SIG601	16/03/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIG595	16/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIG575	16/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIG569	16/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIG555	19/03/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SIG338	16/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIG337	16/03/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIG301	16/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIG291	16/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
P18785	17/03/2026	Unwound		mxn			17,000,000
P18783	17/03/2026	Unwound		mxn			17,000,000
P18782	17/03/2026	Unwound		mxn			17,000,000
SIF327	13/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SIF262	04/03/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SIE779	07/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIE778	07/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIE712	02/03/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SIE604	02/03/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SIE142	07/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIE139	07/03/2028	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SID553	25/02/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SID430	24/02/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SIC755	21/02/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SIC639	18/02/2033	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SIC515	22/02/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SIC316	17/02/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SIB322	08/01/2026	Unwound	989,187,500	mxn	989,187,500	989,187,500	
SIB288	11/02/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SIB199	19/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SIB160	19/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SIA427	08/02/2030	Unwound	190,000,000	mxn	190,000,000	190,000,000	
SHZ894	30/01/2035	Unwound	49,000,000	mxn	49,000,000	49,000,000	
SHZ893	05/02/2030	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHZ656	31/01/2033	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHZ479	03/02/2028	Unwound	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	
SHZ471	05/02/2027	Unwound	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SHZ411	01/02/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHY526	26/01/2033	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SHY244	29/01/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SHX078	21/01/2028	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHW586	04/01/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHW268	17/01/2028	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHW105	07/01/2033	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHW066	14/01/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHV868	04/01/2030	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHV858	09/12/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SHV373	03/01/2033	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SHV355	03/01/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SHV318	13/01/2028	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SHV307	13/01/2028	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
MZF010	13/01/2028	Unwound		mxn		70,000,000	
SHV260	03/01/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SHV233	03/01/2033	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SHV026	04/01/2030	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHU866	06/01/2028	Unwound	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SHU861	03/01/2030	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHU717	04/01/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHU534	04/01/2028	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHT940	23/12/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SHT787	22/12/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SHT323	14/12/2026	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SHS674	09/12/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHS077	09/12/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHS069	09/12/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHR387	26/11/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHR386	29/11/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHQ996	29/11/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHQ812	26/11/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHP670	11/11/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHP088	11/11/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
E82925	12/11/2025	Unwound		mxn			45,755,000
E82924	12/11/2025	Unwound		mxn			45,755,000
SHO018	29/10/2027	Unwound	60,751,036	mxn	60,751,036	60,751,036	
P18516	29/10/2027	Unwound		mxn			114,109,600
P18515	29/10/2027	Unwound		mxn			60,751,036
SHN872	29/10/2027	Unwound	114,109,600	mxn	114,109,600	114,109,600	
SHL455	15/10/2026	Unwound	245,000,000	mxn	245,000,000	245,000,000	
SHG444	28/08/2026	Unwound	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SHD797	09/08/2032	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHD778	09/08/2032	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHD667	09/08/2032	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHD601	06/08/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SHD502	06/08/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SHB938	26/02/2027	Unwound	18,400,000	mxn	18,400,000	18,400,000	
SHB927	31/07/2026	Unwound	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SHB228	21/07/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SHA111	12/07/2032	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SGZ965	09/07/2032	Unwound	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SGY954	02/07/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SGY401	30/06/2025	Unwound	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SGX857	26/02/2027	Unwound	60,448,799	mxn	60,448,799	60,448,799	
SGX606	26/02/2027	Unwound	60,448,799	mxn	60,448,799	60,448,799	
SGX602	26/02/2027	Unwound	60,448,799	mxn	60,448,799	60,448,799	
MUY782	26/02/2027	Unwound		mxn		60,448,799	
SGX446	26/02/2027	Unwound	21,600,000	mxn	21,600,000	21,600,000	
SGX436	16/06/2032	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SGX317	23/06/2026	Unwound	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SGW920	10/06/2032	Unwound	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SGW901	15/06/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGW492	09/06/2032	Unwound	155,000,000	mxn	155,000,000	155,000,000	
SGW258	15/06/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SGW256	07/06/2032	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGV163	07/06/2027	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SGV003	31/05/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SGR170	12/05/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SGP643	10/05/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SGP281	29/04/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SGO807	05/05/2026	Unwound	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	
SGO547	26/04/2032	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SGN617	19/04/2032	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SGN411	26/02/2027	Unwound	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SGN409	26/02/2027	Unwound	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	
MTR991	26/02/2027	Unwound		mxn		75,000,000	
SGN363	26/02/2027	Unwound	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	
MTR983	26/02/2027	Unwound		mxn		20,000,000	
SGN359	26/02/2027	Unwound	95,000,000	mxn	95,000,000	95,000,000	
SGN358	26/02/2027	Unwound	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SGN289	16/04/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SGK594	30/03/2032	Unwound	345,000,000	mxn	345,000,000	345,000,000	
SGJ567	25/03/2032	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SGH733	26/03/2029	Unwound	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	
SGH178	26/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SGG123	24/03/2026	Unwound	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SGE773	29/01/2032	Unwound	142,000,000	mxn	142,000,000	142,000,000	
SGE428	12/03/2027	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SGE426	12/03/2027	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGD817	28/02/2027	Unwound	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SGD809	28/02/2027	Unwound	44,000,000	mxn	44,000,000	44,000,000	
SGD204	05/03/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGD029	05/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SGD021	26/02/2032	Unwound	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	
SGA744	05/01/2032	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SGA743	09/01/2032	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SGA282	13/02/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SGA142	19/02/2026	Unwound	295,000,000	mxn	295,000,000	295,000,000	
SFZ837	26/01/2029	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SFZ827	29/01/2027	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SFY436	04/02/2027	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SFY437	04/02/2027	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SFY342	20/02/2026	Unwound	75,500,000	mxn	75,500,000	75,500,000	
SFY314	20/02/2026	Unwound	75,500,000	mxn	75,500,000	75,500,000	
SFX781	23/01/2032	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SFX686	26/01/2029	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SFX684	29/01/2027	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SFW778	15/01/2032	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SFW488	15/01/2032	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SFE629	26/11/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SFC466	17/11/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SFA370	30/10/2031	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SEZ147	23/10/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SEY764	22/10/2031	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SEY401	05/10/2026	Unwound	245,000,000	mxn	245,000,000	245,000,000	
SEW267	03/10/2031	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SEV634	29/09/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SEV632	29/09/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SEV445	26/09/2031	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SEV442	02/10/2026	Unwound	490,000,000	mxn	490,000,000	490,000,000	
SEV108	24/09/2031	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SES977	15/09/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SES962	15/09/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SES948	15/09/2031	Unwound	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	
SES405	11/09/2031	Unwound	95,000,000	mxn	95,000,000	95,000,000	
SER756	08/09/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SEG820	03/08/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
MOE913	13/07/2028	Unwound		usd		2,100,000	
SED383	13/07/2028	Unwound	2,100,000	usd	2,100,000	2,100,000	
SED382	13/07/2028	Unwound	2,100,000	usd	2,100,000	2,100,000	
SEC912	30/06/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDX750	21/05/2026	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDW355	10/05/2028	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW349	10/05/2028	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SDW309	08/05/2028	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SDV666	13/02/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDV587	20/02/2026	Unwound	47,500,000	mxn	47,500,000	47,500,000	
SDV525	10/02/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV454	07/02/2031	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDV466	07/02/2031	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV445	21/01/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDV283	21/01/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDV313	21/01/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDV231	14/01/2028	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV187	16/09/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV120	12/09/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDV060	11/09/2030	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV061	18/05/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDV018	15/05/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDV036	02/01/2026	Unwound	1,250,000,000	mxn	1,250,000,000	1,250,000,000	
SDV041	22/09/2025	Unwound	2,750,000	mxn	2,750,000	2,750,000	
SDU986	24/01/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU991	24/01/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU881	29/08/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDU844	28/08/2030	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU750	25/02/2027	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SDU676	25/02/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDU682	30/04/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDU648	30/04/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU649	30/04/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU655	21/08/2030	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU665	25/02/2027	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDU596	19/08/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDU616	19/08/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDU543	16/08/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDU545	25/04/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDU557	08/02/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDU562	10/02/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDU447	31/01/2025	Unwound	17,000,000	mxn	17,000,000	17,000,000	
SDU469	14/08/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU484	15/08/2030	Unwound	170,000,000	mxn	170,000,000	170,000,000	
SDU407	31/01/2025	Unwound	29,600,000	mxn	29,600,000	29,600,000	
SDU411	27/04/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDU337	08/02/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDU340	10/02/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDU351	10/02/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDU374	07/08/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU295	02/01/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDU311	05/08/2030	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU334	02/08/2030	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SDU336	18/04/2031	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU285	02/01/2026	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SDU205	02/08/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDU217	02/08/2027	Unwound	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SDU232	17/04/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU159	26/07/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDU122	24/07/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDU139	25/07/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDU025	17/07/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDT980	16/07/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDT990	16/07/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDT857	11/07/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT829	07/04/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT782	10/07/2030	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT789	10/07/2030	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SDT711	04/04/2031	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SDT721	09/07/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT687	22/09/2025	Unwound	3,040,000	mxn	3,040,000	3,040,000	
SDT508	30/01/2026	Unwound	2,075,000,000	mxn	2,075,000,000	2,075,000,000	
SDT441	31/03/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDT460	31/03/2031	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT357	28/03/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDT261	24/03/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDT165	25/03/2026	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	
SDS918	19/03/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDS955	07/11/2030	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDS863	25/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS869	26/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS904	31/01/2025	Unwound	18,400,000	mxn	18,400,000	18,400,000	
SDS819	28/02/2029	Unwound	35,300,000	mxn	35,300,000	35,300,000	
SDS842	31/01/2025	Unwound	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDS849	24/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS859	24/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS779	07/03/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDS783	24/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS788	24/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS797	25/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS804	26/03/2027	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS806	28/02/2029	Unwound	32,700,000	mxn	32,700,000	32,700,000	
SDS700	06/03/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDS575	25/10/2030	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SDS533	24/10/2030	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDS536	24/10/2030	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SDS267	17/10/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDS207	24/02/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDS157	21/02/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDS117	19/02/2031	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SDS067	07/10/2030	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	
SDR959	23/09/2030	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDR944	20/02/2026	Unwound	47,500,000	mxn	47,500,000	47,500,000	
SDR917	29/10/2028	Unwound	142,500,000	mxn	142,500,000	142,500,000	

## RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o	Cobertura o Negocio	Nocional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores
				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	275,167,069,429	Compra	Divisas	Divisas	280,596,167,534	268,774,352,916	270,927,901,194	4,239,168,235	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	(275,535,940,588)	Venta	Divisas	Divisas	(280,468,209,296)	(269,116,034,280)	(271,304,570,765)	(4,231,369,822)	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,807,497,076	Compra	Acción	Acción	93,336,742	135,401,614	-	2,807,497,076	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Acción	Acción	(88,244,859)	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	10,736,280,374	Compra	Divisas	Divisas	658,787,714	524,992,473	8,456,471,580	2,279,808,794	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	10,736,280,374	Venta	Divisas	Divisas	(519,269,600)	(390,614,672)	8,571,327,530	2,164,952,844	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,576,685,000	Compra	Índice	Índice	308,417,560	266,773,444	-	3,576,685,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,838,460,000	Venta	Índice	Índice	(130,263,597)	(102,722,563)	-	1,838,460,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	47,776,234,207	Compra	Tasas	Tasas	436,938,162	557,526,873	1,719,000,000	40,517,179,032	5,540,055,175	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	47,224,902,973	Venta	Tasas	Tasas	(428,231,863)	(549,547,030)	1,879,000,000	39,984,727,676	5,361,175,297	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,403,748,538	Compra	Acción NE	Acción NE	(2,801,163)	(101,392,890)	-	1,403,748,538	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,403,748,538	Venta	Acción NE	Acción NE	(2,290,719)	(34,008,724)	-	1,403,748,538	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	157,660,000	Compra	Índice NE	Índice NE	20,344,759	9,259,948	-	157,660,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,895,885,000	Venta	Índice NE	Índice NE	(198,498,722)	(173,310,829)	-	1,895,885,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,288,420,676	Compra	Divisas NE	Divisas NE	84,211,644	82,378,189	211,049,264	1,077,371,412	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,288,420,676	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(214,569,512)	(217,151,925)	211,049,264	1,077,371,412	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	7,322,660,894	IRS	Fija / Variable Usd, Usd	Fija / Variable Usd, Usd	158,677,143	197,546,202	-	6,048,455,455	1,274,205,439	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	132,121,670,975	IRS	Fija / Variable Mxn, Mxn	Fija / Variable Mxn, Mxn	564,026,406	1,869,629,503	580,000,000	116,709,523,117	14,832,147,859	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	6,682,528,000	IRS	Variable / Fija Usd, Usd	Variable / Fija Usd, Usd	202,029,955	138,422,419	-	3,550,093,000	3,132,435,000	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	3,765,604,240	IRS	Variable / Variable Usd, Usd	Variable / Variable Usd, Usd	(768,714)	(719,115)	-	3,125,463,576	640,140,664	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	(1,647,224,265)	XXYC	Variable / Variable Usd, Mxn	Variable / Variable Usd, Mxn	(1,211,238,043)	(1,734,328,161)	-	(1,563,783,200)	(83,441,065)	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	(684,454,513)	XXYC	Fija / Fija Usd, Mxn	Fija / Fija Usd, Mxn	(450,299,169)	(733,348,016)	-	(6,660,315)	(677,794,198)	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	710,287,793,580	IRS	Fija / Variable MXN, MXN	Fija / Variable MXN, MXN	836,161,541	6,754,357,441	197,007,000,000	384,489,038,635	128,791,754,945	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	206,682,498,750	IRS	Fija / Variable Usd, Usd	Fija / Variable Usd, Usd	(1,796,608,724)	3,525,059,343	3,855,577,236	108,538,296,927	94,288,624,587	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	4,958,172	IRS	Fija / Fija Usd, Usd	Fija / Fija Usd, Usd	2,716,894	2,692,934	-	4,189,521	768,651	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	7,930,424	IRS	Fija / Fija MXN, MXN	Fija / Fija MXN, MXN	2,539,988	2,333,143	-	7,930,424	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	204,328,676,305	IRS	Variable / Fija Usd, Usd	Variable / Fija Usd, Usd	1,899,116,024	(3,432,560,867)	1,370,512,136	109,131,757,975	93,826,406,195	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	726,001,890,996	IRS	Variable / Fija MXN, MXN	Variable / Fija MXN, MXN	(902,486,089)	(6,821,689,083)	200,298,000,000	391,993,588,802	133,710,302,195	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	3,853,813,898	IRS	Variable / Variable Usd, Usd	Variable / Variable Usd, Usd	(162,787)	(531,052)	-	519,858,913	3,333,954,985	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	47,570,000,000	IRS	Variable / Variable MXN, MXN	Variable / Variable MXN, MXN	-	(3,991,216)	26,070,000,000	21,500,000,000	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(910,087,465)	XXYC	Fija / Fija Usd, MXN	Fija / Fija Usd, MXN	(164,772,519)	(319,139,348)	-	(628,229,125)	(281,858,340)	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	1,068,010	XXYC	Fija / Fija EUR, MXN	Fija / Fija EUR, MXN	-	(556,393)	-	-	1,068,010	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(1,068,010)	XXYC	Fija / Fija MXN, EUR	Fija / Fija MXN, EUR	-	1,582,989	-	-	(1,068,010)	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	910,087,465	XXYC	Fija / Fija MXN, USD	Fija / Fija MXN, USD	166,875,081	321,117,920	-	628,229,125	281,858,340	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(202,972,500)	XXYC	Fija / Fija USD, COP	Fija / Fija USD, COP	(151,876,381)	(200,723,665)	-	(202,972,500)	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	202,972,500	XXYC	Fija / Fija COP, USD	Fija / Fija COP, USD	151,876,381	200,723,665	-	202,972,500	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	125,862,951	XXYC	Fija / Variable MXN, Usd	Fija / Variable MXN, Usd	11,811,898	254,199,470	-	70,290,000	55,572,951	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(64,493,481)	XXYC	Fija / Variable USD, MXN	Fija / Variable USD, MXN	(31,251,080)	(56,177,800)	-	(64,493,481)	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	5,889,707	XXYC	Fija / Variable EUR, USD	Fija / Variable EUR, USD	(6,796,222)	9,275,620	-	5,889,707	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(125,862,951)	XXYC	Variable / Fija Usd, MXN	Variable / Fija Usd, MXN	(12,369,531)	(254,547,021)	-	(70,290,000)	(55,572,951)	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	64,493,481	XXYC	Variable / Fija MXN, USD	Variable / Fija MXN, USD	31,566,625	56,487,786	-	64,493,481	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(5,889,707)	XXYC	Variable / Fija USD, EUR	Variable / Fija USD, EUR	6,852,167	(9,216,201)	-	(5,889,707)	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(896,433,587)	XXYC	Variable / Variable Usd, mxn	Variable / Variable Usd, mxn	(511,519,457)	(900,023,244)	(188,517,508)	(615,351,437)	(92,564,643)	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	896,105,300	XXYC	Variable / Variable mxn, usd	Variable / Variable mxn, usd	510,766,020	899,525,372	188,517,508	615,023,149	92,564,643	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
10000000000			<b>A C T I V O</b>	918,665,674,432	836,320,156,190
100200001001			<b>Efectivo y equivalentes de efectivo</b>	52,330,559,740	47,661,140,882
100400001001			<b>Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)</b>	1,760,685,783	1,382,566,946
100600001001			<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>	192,696,974,021	185,048,414,219
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	84,120,385,107	78,120,641,207
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	103,466,245,787	102,024,149,093
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	5,110,343,127	4,903,623,919
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	5,110,861,779	4,904,147,964
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-518,652	-524,045
101000001001			<b>Deudores por reporte</b>	23,676,137,639	8,008,648,532
101200001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	0	0
101400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	64,217,643,146	42,742,309,252
	101400102001		Con fines de negociación	48,665,647,450	31,588,957,978
	101400102002		Con fines de cobertura	15,551,995,696	11,153,351,274
101600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS</b>	-473,164,530	-649,897,523
	101800104001		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1</b>	495,044,745,094	491,708,488,282
	101800105001		Créditos comerciales	220,082,814,247	245,529,126,316
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	177,967,415,703	200,539,258,688
		101800107002	Entidades financieras	27,074,409,674	23,989,089,321
		101800107003	Entidades gubernamentales	15,040,988,870	21,000,778,307
	101800105002		Créditos de consumo	46,547,478,362	36,351,630,699
	101800105003		Créditos a la vivienda	228,414,452,485	209,827,731,267
		101800507023	Media y residencial	224,069,484,349	204,923,622,457
		101800507024	De interés social	3,289,629	4,125,266
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	4,341,678,507	4,899,983,544
		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>	7,549,083,517	4,810,715,846
101800205005			Créditos comerciales	2,376,201,879	234,980,227
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	2,376,201,879	234,980,227
		101800506008	Entidades financieras	0	0
		101800506009	Entidades gubernamentales	0	0
	101800205006		Créditos de consumo	1,202,094,238	923,085,664
	101800205007		Créditos a la vivienda	3,970,787,400	3,652,649,955
		101800706018	Media y residencial	3,801,099,517	3,520,967,412
		101800706019	De interés social	0	0
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	169,687,883	131,682,543
		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>	20,726,612,761	17,060,800,207
101800305008			Créditos comerciales	6,950,243,530	6,415,318,250
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	6,853,771,654	6,358,951,790
		101800806024	Entidades financieras	96,471,876	56,366,460
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	0
	101800305009		Créditos de consumo	1,183,345,890	937,104,076
	101800305010		Créditos a la vivienda	12,593,023,341	9,708,377,881
		101801006034	Media y residencial	12,072,687,068	9,274,766,177
		101801006035	De interés social	8,390,254	9,172,857
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	511,946,019	424,438,847
		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: 2024

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 2024 Y 2023

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	523,320,441,372	513,580,004,335
	131800103002		Partidas diferidas	3,866,111,220	3,093,177,922
	101800103003		<b>ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS</b>	-14,732,953,088	-13,209,211,483
	131800102001		<b>Cartera de crédito (neto)</b>	512,453,599,504	503,463,970,774
	131800102002		<b>Derechos de cobro adquiridos (neto)</b>	0	0
131800001001			<b>Total de cartera de crédito (neto)</b>	512,453,599,504	503,463,970,774
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>	49,002,308,585	26,794,472,946
132600001001			<b>Bienes adjudicados (neto)</b>	847,839,371	585,227,163
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	8,259,341	13,941,494
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	2,660,164,729	2,567,903,784
133400001001			<b>Propiedades, mobiliario y equipo (neto)</b>	5,443,411,474	5,289,110,115
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,154,775,380	2,390,703,408
103800001001			<b>INVERSIONES PERMANENTES</b>	394,197,042	267,195,901
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	6,643,494,693	6,144,258,727
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,848,788,514	4,610,189,570
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>	828,618,683,777	757,633,303,594
200200001001			<b>CAPTACIÓN TRADICIONAL</b>	558,587,798,388	541,557,007,095
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	295,083,941,011	276,128,773,850
	200200102002		Depósitos a plazo	231,676,721,766	253,190,157,504
		200200203003	Del público en general	193,751,893,587	208,686,839,264
		200200203004	Mercado de dinero	37,924,828,179	44,503,318,240
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	30,303,844,717	10,940,968,714
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	1,523,290,894	1,297,107,027
200400001001			<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>	45,168,073,272	36,804,306,619
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	17,238,117,239	30,302,604,414
	200400102003		De largo plazo	27,929,956,033	6,501,702,205
230600001001			<b>VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR</b>	33,119,896,475	11,501,196,691
200800001001			<b>ACREEDORES POR REPORTO</b>	62,038,078,726	68,320,662,323
201000001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	89,874	57,595
201200001001			<b>COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA</b>	2,281,027,039	8,384,487,076
	201200102001		Reportos	260,611,396	7,006,252,273
	201200102002		Préstamo de valores	2,020,415,643	1,378,234,803
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	64,727,509,742	39,826,843,898
	201400102001		Con fines de negociación	48,913,317,765	30,812,349,494
	201400102002		Con fines de cobertura	15,814,191,977	9,014,494,404
201600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS</b>	0	0
201800001001			<b>OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
202000001001			<b>Pasivo por arrendamiento</b>	2,383,488,432	2,542,168,069
202200001001			<b>Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal</b>	0	0
202400001001			<b>OTRAS CUENTAS POR PAGAR</b>	43,249,416,351	31,833,741,864
	202400102001		Acreeedores por liquidación de operaciones	31,088,196,829	13,065,921,770
	202400102002		Acreeedores por cuentas de margen	2,959,481,748	1,642,563,929
	202400102003		Acreeedores por colaterales recibidos en efectivo	3,067,709,573	3,216,671,256
	202400102004		Contribuciones por pagar	639,772,954	506,634,630
	202400102005		Acreeedores diversos y otras cuentas por pagar	5,494,255,247	13,401,950,279
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: 2024

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 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
203000001001			Instrumentos financieros que califican como pasivo	8,908,000,000	9,059,579,547
	203000102001		<b>OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN</b>	8,908,000,000	9,059,579,547
	203000102002		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	203000102003		Otros	0	0
203200001001			Obligaciones asociadas con el retiro de componentes de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
203400001001			Pasivo por impuestos a la utilidad	561,093,681	406,767,452
203600001001			Pasivo por beneficios a los empleados	6,304,134,123	6,325,906,261
203800001001			Créditos diferidos y cobros anticipados	1,290,077,674	1,070,579,104
400000000000			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	90,046,990,655	78,686,852,596
440200001001			Participación controladora	90,045,642,813	78,685,436,361
	400200102001		<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	13,468,335,561	13,468,335,561
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	9,420,300,433
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	1,250,665,369
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	2,716,852,485	2,716,852,485
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	80,517,274
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		<b>CAPITAL GANADO</b>	76,577,307,252	65,217,100,800
		400200203010	Reservas de capital	10,077,244,487	8,949,346,887
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	162,317,294
		400200203012	Resultados acumulados	65,922,628,820	56,116,362,815
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	54,988,696,182	44,837,386,812
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	10,933,932,638	11,278,976,003
	400200203013		Otros resultados integrales	405,475,692	-9,447,642
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-484,780,659	-101,013,858
		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	1,111,905,662	702,398,188
		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	-221,649,311	-610,831,972
		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	9,640,959	-1,478,554
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			<b>PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA</b>	1,347,842	1,416,235
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	162,573	176,419
	440400102002		Otra participación no controladora	1,185,269	1,239,816
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			<b>CUENTAS DE ORDEN</b>	4,975,045,145,388	3,488,839,397,834
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	357,425,603,632	258,234,287,345
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	484,460,155,342	486,327,951,199
	700800102001		Fideicomisos	454,971,478,156	457,216,878,220
	700800102002		Mandatos	29,488,677,186	29,111,072,979
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	862,591,264,221	761,415,354,614
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	31,986,299,398	15,342,313,090
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	2,280,954,231	8,382,709,020
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	2,157,723,337	1,601,116,854
702000001001			Otras cuentas de registro	3,234,143,145,227	1,957,535,665,712

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04

AÑO: 2024

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 2024 Y 2023

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	83,727,668,945	79,209,502,074
600400101002	Gastos por intereses	55,556,553,709	52,136,578,670
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	<b>MARGEN FINANCIERO</b>	28,171,115,236	27,072,923,404
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	5,150,969,168	2,197,139,420
330000000002	<b>MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS</b>	23,020,146,068	24,875,783,984
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	5,596,545,883	4,960,152,083
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	428,009,999	483,524,078
501400301007	Resultado por intermediación	2,484,312,587	1,865,323,696
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	923,107,402	878,466,799
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	17,343,206,084	17,320,024,164
330000000003	<b>RESULTADO DE LA OPERACIÓN</b>	14,252,895,857	14,776,178,320
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	190,904,541	562,322,358
330000000004	<b>RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD</b>	14,443,800,398	15,338,500,678
602400501012	Impuestos a la utilidad	3,509,705,187	4,059,348,256
330000000005	<b>RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS</b>	10,934,095,211	11,279,152,422
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	<b>RESULTADO NETO</b>	10,934,095,211	11,279,152,422
502800701014	Otros Resultados Integrales	414,923,334	-22,957,572
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-383,766,801	255,397,201
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	409,507,474	-149,590,732
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remediación de beneficios definidos a los empleados	389,182,661	-128,764,041
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	11,119,513	625,519
330000000007	<b>RESULTADO INTEGRAL</b>	11,360,138,058	11,256,820,369
543200601016	<b>Resultado neto atribuible a:</b>	10,934,095,211	11,279,152,422
543201602158	Participación controladora	10,933,932,638	11,278,976,003
543201602159	Participación no controladora	162,573	176,419
543400701017	<b>Resultado integral atribuible a:</b>	11,360,138,058	11,256,820,369
543401702160	Participación controladora	11,360,138,058	11,256,820,369
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: 2024

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 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
		<b>Actividades de operación</b>		
851000102001		<b>Resultado antes de impuestos a la utilidad</b>	14,443,800,398	15,338,500,678
851000102002		<b>Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:</b>	1,747,281,039	1,510,316,069
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	1,135,612,553	1,087,984,682
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	827,014,378	798,173,958
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	-23,505,981	18,359,266
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-190,904,541	-562,322,358
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	-935,370	168,120,521
	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	3,340,490,072	2,071,163,944
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	3,340,490,072	2,071,163,944
	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>	-4,792,515,076	-27,824,521,258
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	8,363,766,653	-12,713,638,911
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	-378,118,837	825,326,436
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	13,364,006,705	-51,099,667,471
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	-15,667,489,107	-4,784,155,524
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-20,810,000,098	-6,765,080,118
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	-8,989,628,730	-22,206,276,543
	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)	-22,220,662,546	-11,417,752,769
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-262,612,208	-293,233,530
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	4,079,553,231	861,915,662
	851000403014	Cambio en captación tradicional	17,030,791,293	56,234,920,423
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	-6,282,583,597	12,559,756,723
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	32,279	-3,301
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	-6,103,460,037	4,419,162,651
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	24,900,665,844	6,119,225,368
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	-656,919,406	2,664,632
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	392,652,144	266,357,595
	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	577,316,218	488,001,073
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	11,415,650,867	6,158,308,638
	851000403024	Cambio en otras provisiones	135,787,411	46,372,571
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-3,681,263,155	-6,526,724,863
851000001001		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de operación</b>	14,739,056,433	-8,904,540,567
		<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	-685,404,321	-1,017,486,933
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	1,450,000	17,241,826
	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	254,211,032	166,903,920
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-1,065,613,322	-820,480,469
	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: 2024

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 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

Impresión Final

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
	851000202016	Otros cobros por actividades de inversión	0	0
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	<b>Flujos netos de efectivo de actividades de inversión</b>	-1,495,356,611	-1,653,821,656
		<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	-739,140,116	-740,310,752
	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	-4,999,990,635	-2,849,994,662
	851000302009	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	851000302010	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo	0	0
	851000302011	Pagos asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	-2,835,150,213	-2,071,163,944
	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>	-8,574,280,964	-5,661,469,358
	851000000000	<b>Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo</b>	4,669,418,858	-16,219,831,581
	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>	47,661,140,882	63,880,972,463
	100200001001	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo</b>	52,330,559,740	47,661,140,882

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

TRIMESTRE: 04

AÑO: 2024

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

ESTADO DE CAMBIOS EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE  
 CRÉDITO

AL 31 DE DICIEMBRE DE 2024 Y 2023

INFORMACIÓN DICTAMINADA

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado								Participación en ORI de otras entidades	Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de Instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de Instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remedaciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversión	Resultado por tenencia de activos no monetarios				
<b>Saldo al inicio del periodo</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	56,116,362,815	-101,013,858	702,398,188	0	-610,831,972	0	0	-1,478,554	78,685,436,361	1,416,235	78,686,852,596
<b>Ajustes retrospectivos por cambios contables</b>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Ajustes retrospectivos por correcciones de errores</b>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Saldo ajustado</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	56,116,362,815	-101,013,858	702,398,188	0	-610,831,972	0	0	-1,478,554	78,685,436,361	1,416,235	78,686,852,596
MOVIMIENTOS DE PROPIETARIOS																
Aportaciones de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Reembolsos de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Decreto de dividendos	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
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	230,966	0	0	0	0	0	0	0	230,966	-230,966	0
<b>Total</b>	0	0	0	0	0	230,966	0	0	0	0	0	0	0	230,966	-230,966	0
MOVIMIENTOS DE RESERVAS																
Reservas de capital	0	0	0	0	1,127,897,600	-1,127,897,599	0	0	0	0	0	0	0	1	0	1
RESULTADO INTEGRAL																
Resultado neto	0	0	0	0	0	10,933,932,638	0	0	0	0	0	0	0	10,933,932,638	162,573	10,934,095,211
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	-383,766,801	409,507,474	0	389,182,661	0	0	0	414,923,334	0	414,923,334
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	-383,766,801	0	0	0	0	0	0	-383,766,801	0	-383,766,801
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	409,507,474	0	0	0	0	0	409,507,474	0	409,507,474
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	389,182,661	0	0	0	389,182,661	0	389,182,661
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	11,119,513	11,119,513	0	11,119,513
<b>Total</b>	0	0	0	0	0	10,933,932,638	-383,766,801	409,507,474	0	389,182,661	0	0	11,119,513	11,359,975,485	162,573	11,360,138,058
<b>Saldo al final del periodo</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	10,239,561,781	65,922,628,820	-484,780,659	1,111,905,662	0	-221,649,311	0	0	9,640,959	90,045,642,813	1,347,842	90,046,990,655



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 1 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

ANEXO

Scotiabank Inverlat

## INDICADORES FINANCIEROS

Scotiabank-Indicadores Financieros T4 2023T1 2023T2 2024T3 2024T4 2024

ROE

(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)14.2%13.1%11.5%  
13.9%13.7%

ROA

(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)1.4%1.3%1.1%1.3%1.3%

MIN

(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos  
productivos promedio)3.1%3.0%2.9%3.0%2.8%

Eficiencia Operativa

(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total  
promedio)2.2%2.0%2.1%2.0%2.0%

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)3.3%3.4%3.6%3.9%  
4.0%

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.)77.4%76.9%76.8%72.4%71.1%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito21.47%22.01%22.44%22.61%24.23%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales

(crédito, mercado y operacional)15.99%16.64%17.08%17.76%18.59%

Liquidez

(Activos líquidos / Pasivos líquidos)47.2%44.4%46.9%46.8%49.3%

La utilidad neta al cierre del cuarto trimestre alcanza \$3,017 millones, un incremento de \$189 millones o 7% respecto al mismo periodo del año anterior, debido a mayores ingresos en intermediación, menores quebrantos en otros ingresos/egresos de la operación y un mayor margen financiero; compensados parcialmente por mayores requerimientos de reservas crediticias.

Respecto al trimestre anterior, la utilidad neta mostró un incremento de \$70 millones o 2% por mayores ingresos en: intermediación, margen financiero y en otros ingresos/egresos de la operación por seguros, bienes adjudicados y venta de cartera de crédito; compensados parcialmente por mayores requerimientos de reservas crediticias.

La utilidad neta acumulada al cierre de diciembre de 2024 se ubicó en \$10,934 millones,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

una disminución de \$345 millones o 3% respecto al mismo periodo del año anterior, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias; compensados parcialmente por que los ingresos mostraron un crecimiento anual de 7% impulsado por el margen financiero e intermediación, así como comisiones y tarifas netas provenientes principalmente de operaciones de créditos y avalúos; así como menores impuestos. Adicionalmente, la eficiente gestión del gasto logró un índice de productividad de 47%, una mejora de 331 pb respecto al 2023.

3 meses 12 meses

Scotiabank-Información Financiera 31-dic

202330-sep

202431-dic

2024A/A

Δ% 31-dic

202331-dic

2024A/A

Δ%

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

Ingresos por intereses 21,215 21,130 20,715 -2% 79,209 83,728 6%

Gastos por intereses (14,035) (13,980) (13,433) -4% (52,136) (55,557) 7%

Margen Financiero 7,180 7,150 7,282 1% 27,073 28,171 4%

Comisiones 1,210 1,405 1,349 11% 4,477 5,169 15%

Resultado por Intermediación 312 541 720 > +100% 1,865 2,484 33%

Otros ingresos/egresos de la operación 115 225 399 > +100% 878 923 5%

Ingresos no Financieros 1,637 2,171 2,468 51% 7,220 8,576 19%

Total Ingresos 8,817 9,321 9,750 11% 34,293 36,747 7%

Gastos de Administración y Promoción (4,510) (4,348) (4,475) -1% (17,320) (17,343) 0%

PTPP 1) 4,307 4,973 5,275 22% 16,973 19,404 14%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (1,191) (1,203) (1,598) 34% (2,197) (5,151) > +100%

Resultado de la Operación 3,116 3,770 3,677 18% 14,776 14,253 -4%

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

Controladora 394 37 23 -94% 562 191 -66%

Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 3,510 3,807 3,700 5% 15,338 14,444 -6%

Impuestos a la Utilidad (682) (860) (683) 0% (4,059) (3,510) -14%

Resultado Neto 2,828 2,947 3,017 7% 11,279 10,934 -3%

Otros Resultados Integrales

Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender 662 523 (253) > -100% 255 (384) > -100%

Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo (774) (731) 361 > -100% (150) 410 > -100%

Remediación de beneficios definidos a los empleados (154) (1) 4 > -100% (129) 389 > -100%

Participación en ORI de otras entidades 1 - 9 > +100% 1 11 > +100%

Resultado Integral 2,563 2,738 3,138 22% 11,256 11,360 1%

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

## MARGEN FINANCIERO

El margen financiero fue de \$7,282 millones al cierre del cuarto trimestre de 2024, un incremento de \$102 millones o 1% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente por mayores ingresos en la cartera hipotecaria, automotriz y sin garantía.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de \$132 millones o 2%; principalmente por mayores volúmenes en la cartera hipotecaria y automotriz; así como una mejora en la mezcla de depósitos.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 / 87

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

El margen financiero acumulado al cierre de diciembre 2024 ascendió a \$28,171 millones, un incremento de \$1,098 millones o 4% respecto al 2023, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera hipotecaria, sin garantía y automotriz; compensados parcialmente por mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata.

#### INGRESOS NO FINANCIEROS

El total de ingresos no financieros fue de \$2,468 millones en el cuarto trimestre de 2024, un incremento de \$831 millones o 51% respecto al mismo periodo del año anterior, debido a mayores ingresos por intermediación y por otros ingresos / egresos de la operación (principalmente menores quebrantos, mayores ingresos en bienes adjudicados y en venta de cartera de crédito), así como por comisiones y tarifas netas. Los mayores ingresos por intermediación se debieron a una utilidad en instrumentos financieros derivados y mercado cambiario; compensada parcialmente por una pérdida en inversiones en instrumentos financieros.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron un incremento de \$297 millones o 14%, debido a mayores ingresos por intermediación y resultados en otros ingresos / egresos de la operación (principalmente seguros y adjudicación de bienes). Los mayores ingresos por intermediación se debieron a una utilidad en instrumentos financieros derivados y mercado cambiario; compensada parcialmente por una pérdida en inversiones en instrumentos financieros.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de diciembre 2024 ascendió a \$8,576 millones, un incremento de \$1,356 millones o 19% respecto al año anterior, debido principalmente a mayores ingresos en comisiones y tarifas netas por operaciones de crédito, avalúos y manejo de cuenta; así como mayores ingresos por intermediación en el mercado cambiario.

3 meses12 meses

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) 31-dic

202330-sep

202431-dic

2024A/A

Δ%31-dic

202431-dic

2024A/A

Δ%

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

Aceptaciones por Cuenta de Terceros1 1 - -100%3 2 -33%

Actividades Fiduciarias46 44 59 28%212 217 2%

Apertura de Cuenta5 5 5 0%22 19 -14%

Cartas de Crédito81 78 98 21%251 324 29%

Cheques Certificados1 1 - -100%3 2 -33%

Cheques de caja- - 1 0%1 1 0%

Compraventa de instrumentos financieros- 2 3 0%2 7 > +100%

Manejo de Cuenta91 111 104 14%339 427 26%

Operaciones de Crédito482 509 513 6%1,663 1,929 16%

Otras Comisiones y Tarifas430 469 382 -11%1,689 1,521 -10%

Servicios de Banca Electrónica47 158 157 > +100%188 618 > +100%

Transferencia de Fondos26 27 27 4%104 102 -2%

Total de Comisiones y Tarifas (netas)1,210 1,405 1,349 11%4,477 5,169 15%

3 meses12 meses

Scotiabank-

Otros Ingresos/Egresos de la operación

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31-dic

202330-sep

202431-dic

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

2024A/A  
Δ%31-dic  
202331-dic  
2024A/A  
Δ%  
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas(15) (6)--100%63-50%  
Aportaciones al IPAB(577) (591) (597) 3% (2,203) (2,373) 8%  
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo51413> +100%5739-32%  
Donativos(17) (3) (2)-88% (17) (6)-65%  
Bienes adjudicados94393> +100%63244> +100%  
Ingresos por Arrendamiento9121233%424917%  
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados56626313%206240  
17%  
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación7877258123%3,0503,012-1%  
Quebrantos(149) (45) (33)-78% (360) (342)-5%  
Recuperaciones3---100%173-82%  
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo(1)1(1)0%12--100%  
Utilidad/Pérdida por venta de cartera de crédito51339> +100%554> +100%  
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación115225399> +100%8789235%

## ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS

En el cuarto trimestre de 2024, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios ascendió a \$1,598 millones, un incremento de \$407 millones o 34% respecto al mismo periodo del año anterior. El incremento se debe principalmente a mayores requerimientos en la cartera de vivienda, automotriz, tarjeta de crédito y consumo; compensados parcialmente por menores requerimientos en la cartera comercial. Respecto al trimestre anterior, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra un incremento de \$395 millones o 33%, debido principalmente a mayores volúmenes en la cartera menudeo y a menores liberaciones de reservas adicionales; compensados parcialmente por menores requerimientos de cartera comercial. La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de diciembre 2024 ascendió a \$5,151 millones, un incremento anual de \$2,954 millones respecto al año anterior. Este incremento fue impulsado por mayores requerimientos en cartera de consumo.

3 meses12 meses

Scotiabank - Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31-dic

202330-sep

202431-dic

2024A/A

Δ%31-dic

202331-dic

2024A/A

Δ%

Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(1,191) (1,203) (1,598) 34% (2,197)  
(5,151)> +100%

## GASTOS DE ADMINISTRACIÓN Y PROMOCIÓN

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,475 millones en el cuarto trimestre de 2024, una disminución de \$35 millones respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a la amortización de sistemas en el cuarto trimestre de 2023; compensada parcialmente por IVA, depreciación y gastos de tecnología. Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, incrementaron

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

\$127 millones o 3%, debido a mayores gastos de operación principalmente por honorarios, IVA y depreciaciones; compensados parcialmente por menores gastos de PTU.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de diciembre 2024 ascendieron a \$17,343 millones, un incremento anual de \$23 millones, debido principalmente a mayores gastos por IVA, promoción y publicidad, así como en tecnología; compensados por la amortización de sistemas en 2023 y menores honorarios.

3 meses12 meses

Scotiabank -

Gastos de Administración y Promoción

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31-dic

202330-sep

202431-dic

2024A/A

Δ%31-dic

202331-dic

2024A/A

Δ%

Gastos de Personal(1,783) (2,094) (1,779) 0% (7,950) (7,738) -3%

Gastos de Operación(2,727) (2,254) (2,696) -1% (9,370) (9,605) 3%

Total de Gastos de Administración y Promoción(4,510) (4,348) (4,475) -1% (17,320) (17,343) 0%

## IMPUESTOS A LA UTILIDAD

En el cuarto trimestre de 2024, se registró un impuesto neto a cargo de \$683 millones, un incremento de \$1 millón respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una mayor utilidad en el periodo.

Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto disminuyó \$177 millones o 21%, principalmente por el efecto fiscal cambiario en las operaciones financieras derivadas.

Los impuestos netos acumulados al cierre de diciembre 2024 ascendieron a \$3,510 millones, una disminución anual de \$549 millones o 14%, principalmente por el efecto fiscal cambiario en las operaciones financieras derivadas.

3 meses12 meses

Scotiabank - Impuestos31-dic

202330-sep

202431-dic

2024A/A

Δ%31-dic

202331-dic

2024A/A

Δ%

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

Impuesto a la Utilidad Causado(657) (1,453) (370) -44% (3,701) (4,187) 13%

Impuesto a la Utilidad Diferido(25) 593 (313) > +100% (358) 677 > -100%

Total de Impuestos a la Utilidad(682) (860) (683) 0% (4,059) (3,510) -14%

## BALANCE GENERAL

Al 31 de diciembre de 2024, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$918,666 millones, un incremento de \$82,346 millones o 10% respecto al cierre de diciembre de 2023. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en deudores por liquidación de operaciones (en otros activos), instrumentos financieros derivados de negociación, deudores por reporto, y cartera de crédito total; así como en inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental).

Los activos totales incrementaron \$40,786 millones o 5% respecto al cierre del

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 / 87

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental y bancarios), deudores por liquidación de operaciones (en otros activos), deudores por reporto; así como mayores volúmenes en efectivo y equivalentes de efectivo (principalmente depósitos en otras entidades financieras).

El total del pasivo registró \$828,620 millones al 31 de diciembre de 2024, un incremento de \$70,986 millones o 9% respecto al cierre de diciembre de 2023. Este incremento se debe a mayores volúmenes en instrumentos financieros derivados, valores asignados por liquidar, y acreedores por liquidación de operaciones (en otros pasivos); así como el crecimiento de los depósitos.

El pasivo total incrementó \$37,145 millones o 5% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en otros pasivos (valores asignados por liquidar, acreedores por reporto, instrumentos financieros derivados y acreedores por liquidación de operaciones), préstamos bancarios y de otros organismos; así como el crecimiento de los depósitos.

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

202330 sep

202431 dic

2024A/A

Δ%

Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores 284,193 299,778 334,209 18%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 2496,519 507,211 502,594 1%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 17,061 20,398 20,726 21%

Partidas diferidas 3,093 3,694 3,866 25%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (13,209) (14,762) (14,733) 12%

Otros Activos 48,663 61,561 72,004 48%

Total Activo 836,320 877,880 918,666 10%

Depósitos 541,557 554,321 558,588 3%

Préstamos Bancarios y de Otros Organismos 36,804 40,269 45,168 23%

Obligaciones Subordinadas en Circulación 9,060 9,104 8,908 -2%

Otros Pasivos 170,213 187,781 215,956 27%

Total Pasivo 757,634 791,475 828,620 9%

Capital 178,686 86,405 90,046 14%

Total Pasivo y Capital 836,320 877,880 918,666 10%

## CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 1 Y 2

La cartera de préstamos de menudeo al 31 de diciembre de 2024 alcanzó \$280,135 millones, un incremento anual de \$29,380 millones o 12% y de \$5,557 millones o 2% respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado principalmente por mayores créditos a la vivienda y automotriz.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de diciembre de 2024 se ubicó en \$222,459 millones, una disminución anual de \$23,305 millones o 9% debido principalmente a menores créditos de actividad empresarial o comercial. Respecto al trimestre pasado, la disminución fue de \$10,174 millones o 4% debido principalmente a menores créditos gubernamentales.

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

202330 sep

202431 dic

2024A/A

Δ%



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 7 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	37,274	44,575	47,750	28%
Créditos a la Vivienda	213,481	230,003	232,385	9%
Total Préstamos de Menudeo	250,755	274,578	280,135	12%
Actividad Empresarial o Comercial	200,774	185,090	180,344	-10%
Entidades Financieras	23,989	24,157	27,074	13%
Entidades Gubernamentales	21,001	23,386	15,041	-28%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	245,764	232,633	222,459	-9%
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	2496,519	507,211	502,594	1%

## CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 3

Al 31 de diciembre de 2024 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$20,726 millones, un incremento anual y trimestral de \$3,665 millones o 21% y de \$328 millones o 2% respectivamente.

Por otro lado, la estimación preventiva para riesgos crediticios al 31 de diciembre de 2024 se ubicó en \$14,733 millones, un incremento anual de \$1,524 millones o 12% y un incremento trimestral de \$29 millones.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 71.1% al 31 de diciembre de 2024, una disminución respecto al año pasado y al trimestre anterior de 634pb y 129pb, respectivamente.

El índice de morosidad al 31 de diciembre de 2024 fue de 4.0%, un incremento de 64pb respecto del año anterior y de 9pb respecto al trimestre pasado.

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

202330 sep

202431 dic

2024A/A

Δ%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 17,061 20,398 20,726 21%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (13,209) (14,762) (14,733) 12%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta 3,852 5,636 5,993 56%

Índice de morosidad 3.3% 3.9% 4.0% 64 pb

## DEPÓSITOS

El total de depósitos registró \$558,588 millones al 31 de diciembre de 2024, un incremento anual de \$17,031 millones o 3%, debido a mayores volúmenes en títulos de crédito emitidos y depósitos de vista y ahorro; compensados parcialmente por un menor volumen en depósitos a plazo.

Respecto al trimestre inmediato anterior los depósitos disminuyeron \$4,267 millones o 1%, debido principalmente a mayores depósitos de vista y ahorro.

Scotiabank - Depósitos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 dic

202330 sep

202431 dic

2024A/A

Δ%

Total Depósitos Vista y Ahorro 276,129 290,768 295,084 7%

Público en General 208,686 207,471 193,752 -7%

Mercado de Dinero 44,504 25,263 37,925 -15%

Total Depósitos a Plazo 253,190 232,734 231,677 -8%

Títulos de Crédito Emitidos 10,941 29,350 30,304 > +100%

Cuenta global de captación sin movimientos 1,297 1,469 1,523 17%

Total de Depósitos 541,557 554,321 558,588 3%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 8 / 87  
**CONSOLIDADO**  
Impresión Final

**OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN**

Al 31 de diciembre de 2024, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$8,908 millones, una disminución anual de \$152 millones y trimestral de \$196 millones debido al prepago de obligaciones e intereses devengados por pagar y sustitución por obligaciones subordinadas híbridas con fecha de emisión el 14 de noviembre de 2024 y devengamiento de intereses a 182 días.

**Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros**

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2024 valor razonable)

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

Instrumentos financieros negociables 82,400 1,644 22 55 84,121

Sin restricción: - - 22 55 77

Restringidos: 82,400 1,644 - - 84,044

En operaciones de reporto 61,584 1,627 - - 63,211

Préstamos de valores 2,065 - - - 2,065

Otros 18,751 17 - - 18,768

Instrumentos financieros para cobrar o vender 76,279 25,745 - 1,442 103,466

Sin restricción: 74,452 25,745 - 1,442 101,639

Restringidos: 1,827 - - - 1,827

En operaciones de reporto 23 - - - 23

En operaciones de préstamo de valores - - - - -

Otros 1,804 - - - 1,804

Instrumentos financieros para cobrar principal e interés 5,110 - - - 5,110

Sin restricción 5,110 - - - 5,110

Total 163,789 27,389 221,497 192,697

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

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)

Emisor Títulos Tasa Plazo Importe

I\_BANSAN\_2453414,908,236,3519.95%214,900

I\_BMORGAN\_250155,000,000,00010.12%284,986

**Scotiabank-Instrumentos financieros derivados**

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2024 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 10,012 10,352 - - 1,452 1,011 305 700 36,897 36,850 - - 48,666 48,913

Cobertura - - - - - - - - 15,552 15,814 - - 15,552 15,814

**Scotiabank-Montos nocionales en operaciones derivadas**

(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de diciembre de 2024)

Con fines de: Contratos Adelantados Futuros Opciones Estructuradas Swaps Paquetes de Instrumentos Derivados

Posición Posición Posición Posición Posición Posición

Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva

Con fines de negociación

Posición USD 6,313,121

Posición EUR 144,143

Posición CHF

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 / 87

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Posición GBP-----  
 Posición CAD-----  
 Divisas CAD-----  
 Divisas USD----6262512512----  
 Divisas EUR-----  
 Divisas MXN-----4848----  
 Acciones MXN-----  
 Acciones USD----6767134-----  
 Índices MXN----1581,8963,5771,838----  
 Tasa de interés  
 Pesos-----32,63932,088719,361782,489--  
 Dólares-----72572510,29810,573--  
 Euros-----18---  
 Pesos Colombianos-----177,500---  
 Con fines de cobertura  
 Tasa de interés  
 Pesos-----132,122---  
 Dólares-----5901,150--  
 Euros -----

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)PesosDólaresUdisTotal

Actividad empresarial o comercial	122,288	55,680		-	177,968
Créditos a entidades financieras	26,390	684		-	27,074
Créditos a entidades gubernamentales	7,433	7,608			15,041
Créditos al consumo	46,548	-		-	46,548
Créditos a la vivienda	228,383	1	30		228,414
Total	431,042	63,973	30		495,045

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)PesosDólaresUdisTotal

Actividad empresarial o comercial	1,881	495		-	2,376
Créditos al consumo	1,202	-		-	1,202
Créditos a la vivienda	3,969	-	2		3,971
Total	7,052	495	2		7,549

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 30 de diciembre de 2024)PesosDólaresUdisTotal

Actividad empresarial o comercial	5,255	1,599		-	6,854
Créditos a entidades financieras	96			-	96
Créditos al consumo	1,183	-		-	1,183
Créditos a la vivienda	12,552	35	6		12,593
Total	19,086	1,634	6		20,726

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

Saldo al 30 de septiembre de 202420,398  
 Reestructuras198  
 Recuperaciones(492)  
 Castigos y quitas(1,713)  
 Traspasos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1, 2 y 32,233  
 Fluctuación Tipo Cambio102  
 Saldo al 31 de diciembre de 202420,726

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 / 87

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Saldo al 30 de septiembre de 2024 14,762  
 Más: Creación de reservas 30  
           Calificación 1,632  
 Menos: Adjudicaciones y otros 180  
           Castigos y quitas 957  
 Comercial 154  
 Hipotecario 119  
 Consumo 784  
           Eliminaciones 680  
           Desliz cambiario (126)  
 Saldo al 31 de diciembre de 2024 14,733

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

2023 30 sep

2024 31 dic

2024

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

Metropolitano 69.3% 71.5% 71.9%

Noroeste - Centro 8.7% 8.3% 8.0%

Norte 11.2% 10.4% 10.4%

    Bajío 6.3% 5.6% 5.6%

    Sur 4.5% 4.2% 4.1%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

Metropolitano 57.2% 58.0% 63.2%

Noroeste - Centro 13.1% 12.7% 12.0%

Norte 5.9% 8.4% 4.2%

    Bajío 13.5% 12.2% 12.7%

    Sur 10.3% 8.7% 7.9%

Scotiabank- Calificación de la Cartera Crediticia  
 (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)

Grado de Riesgo

Importe Cartera Crediticia Reservas Preventivas Necesarias

Cartera Comercial Consumo Cartera de Vivienda Total Reservas Preventivas

No revolventes Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes

Exceptuada calificada

Riesgo A1	449,867	900,148	504,352	1,904
Riesgo A2	56,693	477,582	333,380	1
Riesgo B1	11,512	114,597	92,227	4
Riesgo B2	7,169	149,238	49,193	1
Riesgo B3	3,521	34,041	40,124	1
Riesgo C1	4,105	168,785	62,250	1
Riesgo C2	4,836	167,132	313,513	1
Riesgo D	10,935	848,984	171,755	3,118
Riesgo E	11,089	3,532,817	349,279	7,488
Total	559,727	5,905	1,466	1,878

5,416  
 14,665

Exceso 68

Reservas Constituidas 14,733

NOTAS:

1). Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas son las

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 11 / 87  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 31 de diciembre de 2024.

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 con riesgo de crédito etapa 3 -  
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia) 58  
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3 3  
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores 7  
Total 68

**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 dueños 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 2024 mantiene el Banco en el rubro de "Inversiones en Instrumentos Financieros - Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses" son:

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)

Títulos	Importe	Vencimiento
B4	27070111,209,6862,	01101-jul-27
BV	2707016-01-	jul-27
Total	11,209,6922,	011

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024) ISRPTU

Futuros castigos de crédito	5,379	1,216
Pagos anticipados (515)	(116)	
Comisiones cobradas por anticipado	(450)	(102)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo		822
174		
Plan de pensiones	1,138	257
Provisiones y otros	713	122
Otros (443)	7	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 12 / 87  
 CONSOLIDADO  
 Impresión Final

Efecto Neto en Diferido 6,644 1,558

Al 31 de diciembre de 2024, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)

VencimientoPréstamosFinanciamientoTotal

Banca

MúltipleBanco de

MéxicoBanca de DesarrolloFondos de FomentoOtros Organismos

Pesos

Inmediato

- - - - -

Mediano 1,762

3,698 - - 5,460 -

Largo 15,881

3,829 - - 19,710 -

Total 17,643

7,527 - - 25,170 -

Tasa Promedio0.00%0.00%11.62%10.18%0.00%

Otros

Inmediato

- - - - -

Mediano 18

413 - - 11,778 -

Largo 5,105

1,007 - - 8,220 -

Total 5,123

1,420 - - 19,998 -

Tasa Promedio5.01%0.00%5.66%5.04%0.00%

Total Préstamos Interbancarios 13,455 -

22,766 8,947 - 45,168

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 2024.

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

202330 sep

202431 dic

2024

Depósitos a la Vista52.3%55.7%56.1%

Metropolitano27.4%31.1%31.6%

Noroeste - Centro7.2%7.3%6.8%

Norte7.0%7.0%6.9%

Bajío5.0%5.2%5.4%

Sur5.7%5.1%5.4%

Depósitos Ventanilla39.3%39.5%36.7%

Metropolitano18.0%13.7%16.5%

Noroeste - Centro4.1%4.8%4.5%

Norte7.5%7.8%6.9%

Bajío6.0%7.3%5.3%

Sur3.7%5.9%3.5%

Total de Captación del Público91.6%95.2%92.8%

Fondeo Profesional8.4%4.8%7.2%

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional

Tasa Promedio

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2024) PesosDólares

Depósitos a la vista (incluye ahorro) 6.26% 2.80%

Depósitos a plazo 10.08% 0.00%

Scotiabank-Resultados por Intermediación

(millones de pesos) 31 dic

2024

Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable (4,479)

Resultado por valuación de divisas 4,876

Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros  
derivados 413

Resultado por compraventa de divisas 1,780

Costos de transacción (101)

Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos  
financieros (5)

Total 2,484

EMISIÓN DE CERTIFICADOS BURSÁTILES

Al cierre de diciembre de 2024, las principales características de las emisiones de  
Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las  
siguientes:

Cuarta\*\*\*Primera\*\*Segunda\*\*Tercera\*\*Cuarta\*\*Quinta

Clave de Pizarra SCOTIAB 23 SCOTIAB 24 SCOTIAB 24-2 SCOTIAB 24V SCOTIAB 24D SCOTIAB 24-3

Monto de la Emisión \$7,125 millones \$5,189 millones \$4,811 millones \$4,325 millones "\$24  
millones usd / \$472 millones MXN \$3,970 millones

Fecha de Emisión y Colocación 18 agosto

2023 26 febrero

2024 26 febrero

2024 13 sep

2024 13 sep

2024 13 sep

2024

Plazo de Vigencia de la Emisión 927 días, aprox.

2.5 años 1,095 días, aprox.

3 años 2,548 días, aprox.

7 años 1,095 días, aprox.

3 años 1,092 días, aprox.

3 años 2,548 días, aprox.

7 años

Garantía Quirografaria Quirografaria Quirografaria Quirografaria Quirografaria Quirografaria

Tasa de interés TIIE 28+0.04 TIIE Fondeo+0.32% 9.74% TIIE Fondeo+0.32% 3.46+0.84% 9.89%

Pago de Intereses Cada 28 días durante la vigencia de la emisión Cada 28 días durante la

vigencia de la emisión Cada 182 días durante la vigencia de la emisión Cada 28 días

durante la vigencia de la emisión Cada 182 días durante la vigencia de la emisión Cada

182 días durante la vigencia de la emisión

Calificaciones otorgadas Fitch/S&P AAA (mex) / "mxAAA" AAA (mex) / "mxAAA" AAA (mex) / "mxAAA"

AAA (mex) / "mxAAA" AAA (mex) / "mxAAA" AAA (mex) / "mxAAA"

Amortización del principal Un sólo pago al vencimiento Un sólo pago al vencimiento Un sólo pago

al vencimiento Un sólo pago al vencimiento Un sólo pago al vencimiento Un sólo pago

al vencimiento

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

\*\* Programa autorizado por la CNBV en febrero de 2024.

EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo	Importe (\$)	Tasa (%)
14-nov-24	Perpetua	MX00QSC10040-8	9,908,000,000	14.02	
Total de Obligaciones Subordinadas 8,908,000,000					

## Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo	(días)	Subyacente	Monto MXN
99_SCOTIAB_1	22533	20028-feb-2225	feb-251093	MSFDVTHY Index	53,320,000		
99_SCOTIAB_5	221,238	86015-jun-2213	jun-251094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	123,886,000		
99_SCOTIAB_6	221,795	50015-jun-2213	jun-251094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	179,550,000		
99_SCOTIAB_7	22793	54016-jun-2213	jun-251093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000		
99_SCOTIAB_8	221,027	15016-jun-2213	jun-251093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000		
99_SCOTIAB_11	225,528	25017-nov-2214	nov-251093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	552,825,000		
99_SCOTIAB_12	22437	55018-nov-2214	nov-251092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	43,755,000		
99_SCOTIAB_13	22104	50023-nov-2221	nov-251094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000		
99_SCOTIAB_14	22753	80019-dic-2217	dic-251094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	75,380,000		
99_SCOTIAB_2	235,288	85027-jul-2327	ene-25550	Dólar - Peso (USDMXN)	528,885,000		
99_SCOTIAB_3	23348	60031-ago-2328	feb-25547	Dólar - Peso (USDMXN)	34,860,000		
99_SCOTIAB_5	232,466	85008-dic-2307	dic-261095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	246,685,000		
99_SCOTIAB_6	231,576	60008-dic-2307	dic-261095	S&P / BMV IPC (MEXBOL)	157,660,000		
99_SCOTIAB_7	23481	40015-dic-2314	dic-261095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	48,140,000		
83_SCOTIAB_5	241,418	30009-dic-2408	abr-25120	Dólar - Peso (USDMXN)	141,830,000		
99_SCOTIAB_6	241,234	75011-dic-2410	dic-26729	S&P 500 Futures ER Index (SPXFP)	123,475,000		
99_SCOTIAB_7	24986	90011-dic-2410	dic-271094	S&P 500 Futures ER Index (SPXFP)	98,690,000		
Total Bonos Bancarios al 31 de diciembre de 2024						2,601,460,000	

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo	(días)	Subyacente	Monto USD
99_SCOTIAB_2	24D 25,000	19-jul-2414	jul-271090	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ US Equity)	2,500,000		
99_SCOTIAB_3	24D613	20008-nov-2405	nov-271092	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ US Equity)	61,320,000		
99_SCOTIAB_4	24D34	00003-dic-2427	nov-26724	VanEck Semiconductor ETF (SMH US Equity)	3,400,000		
Total Bonos Bancarios al 31 de diciembre de 2024						67,220,000	

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

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

---

reestructuración finalizarán a más tardar el 30 de abril de 2024.

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

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

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

- 1).Créditos con "pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento",
- 2).Créditos con "pagos periódicos de principal e intereses" y,
- 3).Créditos que desde su inicio se estipule su carácter de revolventes.

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

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

En el caso que las reestructuras o renovaciones incluyan quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, el Banco podrá diferir la constitución de estimaciones preventivas para riesgos crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una estimación por la diferencia en un período que no exceda de 12 meses.

#### Aplicación del programa OTIS

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

##### a)CrediAuto

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

##### b)Hipotecario

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

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

Diferimiento de 6 meses del pago del crédito sin capitalización de intereses, el plazo

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

d) ScotiaLine

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

e) Tarjetas de crédito

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

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

A continuación, se presentan los importes que se hubieran registrado y presentado en el estado de situación financiera consolidado y en el estado consolidado de resultado integral por tipo de cartera, de no haberse aplicado el criterio contable especial, así como, el detalle de los conceptos y montos por tipo de cartera, por los cuales se haya realizado la afectación contable con motivo de la aplicación del criterio contable especial al 31 de diciembre de 2024.

31 dic 2024

Saldo con CCE OTISEfectos en Cartera y Estimación Saldo sin CCE OTIS

Cartera comercial\$	220,083		-	220,083
Créditos de consumo	46,548 (2)		46,546	
Créditos a la vivienda:	228,414		46	228,460
<b>Etapa 1\$</b>	<b>495,045</b>	<b>44</b>		<b>495,089</b>
Cartera comercial	2,376		-	2,376
Créditos de consumo	1,202		1	1,203
Créditos a la vivienda:	3,971 (1)		3,970	
<b>Etapa 2\$</b>	<b>7,549</b>		<b>-</b>	<b>7,549</b>
Cartera comercial	6,950		-	6,950
Créditos de consumo	1,183		1	1,184
Créditos a la vivienda:	12,593 (45)		12,548	
<b>Etapa 3\$</b>	<b>20,726 (44)</b>		<b>20,682</b>	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Cartera de crédito\$	523,320	-	523,320
(+/-) Partidas diferidas\$	3,866	-	
3,866			
(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios\$	(14,733)	(9)	(14,742)
Total cartera de crédito, neta\$	512,453	(9)	512,444
Total activos\$	918,666	(9)	918,657
Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados)\$	(5,151)	(9)	(5,160)
Resultado neto\$	10,934	(9)	10,925
Total capital contable\$	90,046	(9)	90,037
Total pasivo y capital contable\$	918,666	(9)	918,657

**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 2024)

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

2Resultados de ejercicios anteriores 54,989

3Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 21,579

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 90,036

Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios

7Ajustes por valuación prudencialNo 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)2,040

11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo-

12Reservas pendientes de constituir-

13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización-

14Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonableNo 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 18 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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)

718  
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 8,446  
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 7,614  
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 832

27Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones -  
28Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1 11,204  
29Capital común de nivel 1 (CET1) 78,832

Capital adicional de nivel 1: instrumentos  
30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima 8,908  
31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables 8,908

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 8,908

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios		
37		
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1 No aplica		
38		
conservadorInversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1 No aplica		
39		
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde las Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) No aplica		
40		
conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido No aplica		
41Ajustes regulatorios nacionales	-	
42Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones No aplica		
43Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1		
-		
44Capital adicional de nivel 1 (AT1)	8,908	
45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	87,740	
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas		
46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	-	
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	7	
51Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios		7
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios		
52		
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2No aplica		
53		
conservadorInversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2No 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 emitidoNo aplica		
56Ajustes regulatorios nacionales	-	
57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2		-
58Capital de nivel 2 (T2)	7	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

59Capital total (TC = T1 + T2)	87,747	
60Activos ponderados por riesgo totales		472,125
Razones de capital y suplementos		
61Capital Común de Nivel 1		
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.70%		
62Capital de Nivel 1		
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)18.58%		
63Capital Total		
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)18.59%		
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)19.80%		
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%
68Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)9.70%		
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 financierasNo aplica		
73Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financierasNo 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)		
77		
77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada		
	4,218	
78Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite) -		
79Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas-		
Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)		
80Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradualNo aplica		
81Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)No aplica		
82Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual-		
83Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)-		
84Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual-		
85Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)-		



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

ReferenciaDescripción

1Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6

de las presentes disposiciones.

2Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.

3Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto

acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo,

resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remediones por beneficios definidos

a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.

4No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos

representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté

representado por títulos representativos o acciones.

5No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este

concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.

6Suma de los conceptos 1 a 5.

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

8Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

9Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

10\*Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.

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

12\*Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como aquéllas constituidas con cargo a cuentas contables que no formen parte de las partidas de resultados o del capital contable y no sólo la diferencia positiva entre las Pérdidas Esperadas Totales menos las Reservas Admisibles Totales, en el caso de que las Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital.

13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización conforme a lo

establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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\* El monto de la inversión en cualquier acción propia que:

la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.

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

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

Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.

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

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

19\* Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento

de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

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

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

Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.

21El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.

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

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

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

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

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

A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.

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

C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.

L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

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

O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.

P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.

27No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.

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

29Renglón 6 menos el renglón 28.

30El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.

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

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

33Obligaciones subordinadas computables como Capital Básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).

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

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

36Suma de los renglones 30, 33 y 34.

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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%

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%.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

- 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 2024)

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

Activo

BG1Efectivo y equivalentes de efectivo		51,428
BG2Cuentas de Margen	1,761	
BG3Inversiones en instrumentos financieros		192,697
BG4Deudores por reporto	23,661	
BG5Préstamo de valores	-	
BG6Instrumentos financieros derivados		64,218

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros-			
(473)			
BG8Total de cartera de crédito (neto)		512,453	
BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización			
-			
BG10Otras cuentas por cobrar (neto)		48,781	
BG11Bienes adjudicados (neto)		848	
BG12Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)			2,691
BG13Inversiones permanentes	5,019		
BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta			8
BG15Impuestos a la utilidad diferidos (neto)		6,576	
BG16Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)		2,666	
Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)			
1,396			
Activos Intangibles (neto)	4,849		
Pasivo			
BG17Captación tradicional	558,729		
BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos			45,168
Valores Asignados por liquidar	33,120		
BG19Acreedores por reporto	63,245		
BG20Préstamo de valores	-		
BG21Colaterales vendidos o dados en garantía			2,281
BG22Instrumentos financieros derivados		64,727	
BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros			
-			
BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización			-
BG25Otras cuentas por pagar	42,677		
BG26Obligaciones subordinadas en circulación			-
BG27Pasivo por Impuestos a la Utilidad		532	
BG28Créditos diferidos y cobros anticipados		1,290	
Pasivos por arrendamiento	1,584		
Instrumentos Financieros que califican como pasivo			8,908
Pasivos por Beneficio a los Empleados		6,273	
Capital contable			
BG29Capital contribuido	13,468		
BG30Capital ganado	76,577		
Cuentas de orden			
BG31Avales otorgados	-		
BG32Activos y pasivos contingentes			-
BG33Compromisos crediticios	357,426		
BG34Bienes en fideicomisos o mandato		484,460	
BG35Agente financiero del gobierno federal			-
BG36Bienes en custodia o en administración		76,147	
BG37Colaterales recibidos por la entidad		31,971	
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad			
2,281			
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	2,158		
BG41Otras cuentas de registro		3,233,964	

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 2024)  
 IdentificadorConceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 / 87

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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 102,040BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$2,040  
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 718 BG 15 Impuestos y PTU diferidos (neto) \$718  
13Reservas reconocidas como capital complementario50 7 BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$7  
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-  
19Financiamiento para la adquisición de acciones propias26-H-  
20Cargos diferidos y pagos anticipados26-J7,614BG 16 Activos Intangibles \$4,075 más Gastos de Instalación \$3,539  
21Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)26-L-  
22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos26-N-  
23Inversiones en cámara de compensación26-P832BG 13 Inversiones Permanentes \$ 832

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 8,908  
BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$8,908  
30Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental133-  
31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S46-  
32Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario47-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 anteriores254,989 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$54,989

36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable3 1,112 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$1,112

37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores3 20,467 BG 30

Reservas de Capital \$10,240 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$485) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$222) más Resultado Neto \$10,934

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 GENERAL

44Reservas pendientes de constituir12-

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

46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I-

47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M-

48Derogado

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

IdentificadorDescripción

1Crédito mercantil.

2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.

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

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.

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

6Cualquier acción propia que la Institución adquiera de conformidad con lo previsto en la Ley, que no hayan sido restadas; considerando aquellos montos adquiridos a través de las inversiones en índices de valores y el monto correspondiente a las inversiones en sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18

7Inversiones en acciones de sociedades distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) de la fracción I del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas, considerando aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18.

8Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.

9Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras,

donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.

10Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones

Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.

11Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones

Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.

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

13Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

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

15Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia 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: **2024**

**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 / 87

**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 2024)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgoImporte de posiciones equivalentesRequerimiento de capital

Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	41,901	3,352
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable		
1,193	95	

Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA's		
1,873	150	

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: **2024**

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

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

PAGINA 32 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Posiciones en UDI's, UMA's o con rendimiento referido al INPC		
38	3	
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	14,754	
1,180		
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio		
2,339	187	
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	403	32
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma		-
-		
Requerimiento de capital por impacto Vega		6
1		
Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	
-		
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	
-		
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	
-		
Grupo I-B (ponderados al 2%)	60	5
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%)	799	64
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	
-		
Grupo III (ponderados al 20%)	3,628	290
Grupo III (ponderados al 25%)	9	
1		
Grupo III (ponderados al 50%)	1,448	116
Grupo III (ponderados al 60%)	28	
2		
Grupo III (ponderados al 100%)	856	68
Grupo III (ponderados al 115%)	-	
-		
Grupo III (ponderados al 120%)	-	
-		
Grupo III (ponderados al 138%)	-	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

-			
Grupo III (ponderados al 150%)	-		
-			
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-		
-			
Grupo IV (ponderados al 0%)	-		
-			
Grupo IV (ponderados al 20%)	3,668		293
Grupo V (ponderados al 10%)	-		
-			
Grupo V (ponderados al 20%)	169		14
Grupo V (ponderados al 50%)	-		
-			
Grupo V (ponderados al 115%)	-		
-			
Grupo V (ponderados al 150%)	785		63
Grupo VI (ponderados al 20%)	5,788		463
Grupo VI (ponderados al 25%)	3,993		319
Grupo VI (ponderados al 30%)	14,820		1,186
Grupo VI (ponderados al 40%)	14,049		1,124
Grupo VI (ponderados al 50%)	37,155		2,972
Grupo VI (ponderados al 70%)	40		3
Grupo VI (ponderados al 75%)	36,672		2,934
Grupo VI (ponderados al 85%)	11,071		886
Grupo VI (ponderados al 100%)	28,604		2,288
Grupo VI (ponderados al 120%)	-		
-			
Grupo VI (ponderados al 150%)	-		
-			
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-		
-			
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	-		
-			
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	152		
12			
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	22,673		1,814
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	861		
69			
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-		
-			
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	5,927		474
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-		
-			
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	130,483		10,439
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-		
-			
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	1,210		
97			
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-		
-			
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	-		
-			
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-		
-			
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-		
-			

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	
-		
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	-	
-		
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	
-		
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	
-		
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	
-		
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	
-		
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	
-		
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	
-		
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	
-		
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	
-		
Grupo VIII (ponderados al 115%)	4,811	385
Grupo VIII (ponderados al 150%)	9,038	723
Grupo IX (ponderados al 100%)	21,037	1,683
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	
-		
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	
-		
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	-	
-		
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	
-		
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	
-		
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	
-		
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	
-		
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	
-		
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	
-		
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	
-		
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	
-		
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	
-		
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas		2,122
170		
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación		
19	2	
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega		
144	12	

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleado Activos ponderados por riesgo Requerimiento de capital



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Indicador de Negocio	47,499
3,800	
CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN	
El índice de capitalización de Scotiabank Inverlat S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (Scotiabank) fue de 18.59% al cierre de diciembre 2024, 200pb superior al mínimo requerido para la categoría I del artículo 220 de las Disposiciones Generales aplicables a las Instituciones de Crédito (16.59% Índice regulatorio más suplementos de Absorción de Pérdidas Totales y de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local).	
Scotiabank-Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio ReferenciaCaracterísticasOpciones	
1EmisorScotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat	
2Identificador ISIN, CUSIP o BloombergN.A.	
3Marco legalLey de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.	
Tratamiento regulatorio	
4Nivel de capital con transitoriedadN.A.	
5Nivel de capital sin transitoriedadFundamental	
6Nivel del instrumentoInstitución de crédito sin consolidar subsidiarias	
7Tipo de InstrumentoAcción series "F" y "B"	
8Monto reconocido en el capital regulatorio13,468,335,561	
9Valor nominal del instrumentoUn Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales	
9A Moneda del instrumentoPesos mexicanos	
10Clasificación contableCapital	
11Fecha de emisión13-ene-01	
12Plazo del instrumentoPerpetuidad	
13Fecha de vencimientoSin vencimiento	
14Cláusula de pago anticipadoNo	
15Primera fecha de pago anticipadoN.A.	
15A Eventos regulatorios o fiscalesNo	
15B Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipadoN.A.	
16Fechas subsecuentes de pago anticipadoN.A.	
Rendimientos / dividendos	
17Tipo de rendimiento / dividendoFijo o Variable	
18Tasa de Interés /DividendoLa política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.	
19Cláusula de cancelación de dividendosSujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.	
20Discrecionalidad en el pago Parcialmente discrecional.	
21Cláusula de aumento de interesesNo	
22Rendimientos / dividendosNo Acumulable	
23Convertibilidad del instrumentoN.A.	
24Condiciones de convertibilidadN.A.	
25Grado de convertibilidadN.A.	
26Tasa de conversiónN.A.	
27Tipo de convertibilidad del instrumentoN.A.	
28Tipo de instrumento financiero de la convertibilidadN.A.	
29Emisor del instrumento Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.	
30Cláusula de disminución de valor (Write-Down)No	
31Condiciones para disminución de valorN.A.	
32Grado de baja de valorN.A.	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

33Temporalidad de la baja de valorN.A.

34Mecanismos de disminución de valor temporalN.A.

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

36Características de incumplimientoNO

37Descripción de características de incumplimientoNO

Scotiabank-Información relativa a las características de los títulos que forman parte del Capital Neto

ReferenciaDescripción

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

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

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

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

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

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

7Tipo 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.

8Monto 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.

9Valor nominal del título en pesos mexicanos.

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

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

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

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

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

14Especificar 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.

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

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

15BEspecificar el precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado.

16Fechas 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.

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

19Especificar 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.

20Discrecionalidad 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.

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto

(millones de pesos al 31 de diciembre de 2024)

Ref.RUBRODic-241)

T-Sep-24

T-1Jun-24

T-2Mar-24

T-3Dic-23

T-4

1Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones 25,907 16,63916,76915,79216,280

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 472,125 463,647470,684464,864471,664

3Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%) 4.88% 3.25% 3.25% 3.25% 3.25%

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 921,135 887,401894,365842,238868,289

5"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%) 2.81% 1.88% 1.88% 1.88% 1.88%

5a No aplica

6a Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución? No No No No No

6b Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución? No No No No No

6c En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos? 0% 0% 0% 0% 0%

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

#### 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 2024 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 2 de mayo de 2024 como Institución de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local a Scotiabank Inverlat, S.A., mediante oficio Núm. 141-5/1991/2024 su grado de importancia

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

sistémica y el suplemento de conservación de capital adicional, la institución fue calificada como Grado I por lo que deberá continuar con un suplemento de capital de 60 puntos base.

En base a lo anterior y continuando con la constitución del requerimiento de capacidad total de absorción de pérdidas (TLAC, que corresponde al máximo entre el 6.5% de los APSR Totales y el 3.75% de los Activos Ajustados) la institución tiene que añadir una cuarta parte desde diciembre 2022, por lo que el capital mínimo regulatorio que debe mantener Scotiabank, es de 16.59% y 14.55% al 31 de diciembre de 2024 y 2023.

## Scotiabank - Composición del Suplemento al Capital Neto

Referencia	Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes	Monto
1	Capital Fundamental	78,832
2	Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto	8,908
3	Capital Básico No Fundamental no elegible, como Suplemento al Capital Neto, emitido por la institución en tenencia de terceros	-
4	Otros ajustes	-
5	Instrumentos elegibles de Capital Básico No Fundamental para el Suplemento al Capital Neto	8,908
6	Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto	7
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	Instrumentos elegibles de Capital Complementario, de acuerdo a las reglas para el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales	7
11	Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio	87,747
12	Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio	
13	Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco y subordinados a pasivos excluidos	-
14	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	-
15	Del cual: Monto elegible de Suplemento al Capital Neto, después de aplicar los límites superiores. No aplica	
16	Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos por vehículos de financiación, antes del 1 de enero de 2022 No aplica	
17	Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar a una Institución de importancia sistémica local en resolución No aplica	
18	Suplemento al Capital Neto surgido de instrumentos de capital no regulatorio antes de ajustes	-
19	Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes	
20	Suplemento al Capital Neto antes de deducciones	87,747
21	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	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 40 / 87  
**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

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	87,747
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	472,125
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	921,135
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)	18.59%
26Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)	9.53%
27Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto	16.70%
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)	6.09%
29Del cual: Requerimiento por suplemento de conservación de capital	0.60%
30Del cual: Requerimiento por suplemento de capital contracíclico específico de banco	0.00%
31Del cual: Requerimiento por suplemento al capital neto	5.49%

## Scotiabank- Composición del Suplemento al Capital Neto

### ReferenciaDescripción

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 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



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 42 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 con el 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 en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual queda un capital social suscrito y pagado por la cantidad de \$9,153'500,000.00 (Nueve mil ciento cincuenta y tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.

Al 30 de junio de 2021, mediante asamblea extraordinaria de accionistas se aprobó como consecuencia de la fusión llevar a cabo un aumento en el capital social del Banco por la cantidad de 53,523,304 acciones correspondientes a la serie "F" con valor nominal de un peso cada una, y el remanente del capital contable de SECOSA que excede a los valores nominales de las acciones que serán emitidas, es decir, la cantidad de \$644, fue reconocido en un rubro denominado prima en emisión de acciones, y que respecto de

esta partida, los accionistas de SECOSA no tendrán derecho preferencial, ya que todos los accionistas de la Sociedad, participan de ese importe en proporción a sus respectivos porcentajes de participación.

SCOTIABANK INVERLAT / ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en equipos expertos por tipo de riesgo, lo anterior para garantizar una gestión adecuada tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

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

Riesgo de mercado

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 44 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

establecidos y aprobados para cada uno de los portafolios.

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre de diciembre de 2024 fue de \$17.34 millones y su promedio durante el cuarto trimestre de 2024 fue de \$15.90 millones mismo que corresponde a un 0.018% del capital neto (\$88,545 millones a noviembre 2024, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del cuarto trimestre de 2024 se muestran a continuación:

Nacional (millones de pesos)Cierre

Diciembre 2024Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés

Derivados2,117,2311,868,818

Mercado de Dinero 49,10052,068

Tipo de cambio

Cash3,8705,000

Derivados314,715311,895

Capitales

Cash2220

Derivados5,9206,227

VaR 1 día (millones de pesos)Cierre

Diciembre 2024Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés17.1816.40

Tipo de cambio3.373.71

Capitales--

VaR Global17.3415.90

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 2024 muestra una pérdida máxima de \$541.25 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 tercer trimestre de 2024, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se han establecido límites, los cuales son revisados al menos de manera anual y monitoreados de manera periódica a fin de que los mitigantes del riesgo estén actualizados y sean precisos. Entre los límites aplicables se encuentran aquellos relacionados a activos líquidos, brechas de liquidez, sensibilidad del margen y sensibilidad del valor económico, mismos que se encuentran alineados con el apetito de riesgo de la institución.

La estructura de límites de riesgo de liquidez y tasas de interés contempla montos nocionales, así como de plazo y concentración; de manera periódica se informa al Comité de Activos y Pasivos, Comité de Riesgos y al Consejo de Administración sobre el desempeño de dichos límites, así como de los indicadores en materia de riesgo de liquidez y tasas de interés.

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

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

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

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de diciembre 2024 así como el promedio del cuarto trimestre de 2024 se muestra a continuación:

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US\$) 75,31363,746

Liquidity Buffer

(bajo métrica CCL) 142,206134,379

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 46 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el cuarto trimestre de 2024 de 168.73% y 116.27% 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 2024 y en promedio para el cuarto trimestre de 2024 es la siguiente:

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Valor Económico (+100 pbs) (2,181) (2,192)

Sensibilidad de Margen (-100 pbs) (295) (222)

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 del cálculo de VaR.

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Instrumentos financieros para cobrar o vender 1) .94,17293,678

Derivados de Cobertura 116,188116,407

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 2024 y el promedio del cuarto trimestre del 2024 fueron \$5,534 millones y \$4,876 millones, respectivamente.

#### RIESGO DE CRÉDITO

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

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

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

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

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

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

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

Metodología para determinar las estimaciones preventivas para riesgos crediticios El Banco cuenta con un sistema de clasificación de riesgos crediticios aprobado a nivel

institucional para cartera Comercial y modelos de score y/o métricas de seguimiento de desempeño para la cartera de Menudeo. También se cuenta con procesos y sistemas que permiten clasificar la cartera por nivel de riesgo y realizar el proceso de cálculo de reservas de todas las carteras de crédito, conforme a los modelos regulatorios establecidos por CNBV en la CUB.

Se utilizan las Agencias Calificadoras aprobadas por CNBV conforme se describe en Anexo 1-B de la CUB.

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 tercer trimestre corresponde a \$11 millones; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida. Mecanismos de control de los sistemas de calificación, incluido un análisis de su independencia, responsabilidad y evaluación. El Banco cuenta con diversos aplicativos para el control de los sistemas de calificación y el registro adecuado y completo de las características y requisitos de cada garantía, que se encuentra definido en el catálogo institucional de garantías, así como procesos de solicitud y autorización de crédito.

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

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

Al cierre del cuarto trimestre de 2024, el Banco mantiene \$2 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

#### INFORMACIÓN METODOLÓGICA

La medición y el monitoreo del riesgo de crédito se basa en un modelo de pérdida



esperada y pérdida no esperada, cuyo cálculo es realizado en una herramienta especializada interna, robusta y de uso institucional.

- La pérdida esperada representa el monto que el Banco espera perder durante los próximos doce meses por concepto de incumplimientos dadas las características de sus carteras. Es igual al resultado de multiplicar la exposición al incumplimiento (EI), la probabilidad de incumplimiento (PI) y la severidad de la pérdida (SP) de las exposiciones crediticias.

- La pérdida no esperada, es una medida de dispersión alrededor de la pérdida esperada. Representa el capital económico necesario para mantener solvente a la Institución en caso de un evento adverso de gran magnitud que impacte las carteras crediticias. Adicionalmente, se realizan pruebas bajo condiciones extremas para determinar su impacto sobre la pérdida esperada y no esperada del portafolio.

Métricas Riesgo de Crédito1).

(Cifras al 31 de diciembre 2024) Pérdida

Esperada Pérdida no Esperada

Hipotecas 0.28% 2.91%

Consumo 3.70% 15.59%

Cartera Comercial 0.56% 4.24%

Total 0.76% 4.71%

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 Riesgo1).

(Cifras a millones al 31 de diciembre 2024) EI2). PISP

Hipotecas 232,385 1.98% 16.66%

Consumo 66,952 4.90% 72.24%

Cartera Comercial 277,755 1.40% 43.50%

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 el proceso de constitución de garantías; previo a su aceptación, se valora la capacidad de absorción de riesgo y 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 2024.

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 2024 y en promedio durante el cuarto trimestre de 2024, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.03% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.38% y 0.33% respectivamente.

#### RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES DE DERIVADOS

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

#### METODOLOGÍA PARA ESTABLECIMIENTO DE LÍMITES DE CRÉDITO PARA CONTRAPARTES Y ASIGNACIÓN DE CAPITAL

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

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

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

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

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

#### RIESGO OPERACIONAL

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

#### METODOLOGÍA GENERAL

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

#### POLÍTICAS PARA LA GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL

Tienen como propósito establecer los principios y el marco de gestión, para

---

identificar, medir, monitorear, limitar, controlar, divulgar y gestionar los riesgos operacionales inherentes a sus actividades diarias, además de promover una cultura de administración de riesgos en todo el Banco.

#### EVALUACIÓN DE RIESGO OPERACIONAL

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

#### MANUAL PARA LA RECOLECCIÓN Y CLASIFICACIÓN DE DATOS DE RIESGO OPERACIONAL

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

#### NIVELES DE TOLERANCIA DE RIESGO OPERACIONAL

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

#### INDICADORES CLAVE DE RIESGO (KRI)

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

#### RIESGO LEGAL

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

#### CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO OPERACIONAL

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

#### VALOR PROMEDIO DE LA EXPOSICIÓN

Durante el periodo de octubre - diciembre 2024, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$67.4 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de diciembre 2024 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$55.6 millones y corresponden 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 el Marco de Gestión del Riesgo Tecnológico y de Ciberseguridad que define las funciones, responsabilidades y obligaciones de las partes interesadas, así como, la supervisión de los organismos y las herramientas, prácticas y entregables requeridos 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 52 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 2024 - diciembre 2024 (T4 2024)

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

Calculo Individual T4 2024	Calculo Consolidado T4 2024
(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)
Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)
Importe ponderado (promedio)	Importe ponderado (promedio)
<b>ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES</b>	
1Total de Activos Líquidos Computables No aplica	135,578 No aplica
<b>SALIDAS DE EFECTIVO</b>	
2Financiamiento minorista no garantizado	169,179
3Financiamiento estable	99,365
4Financiamiento menos estable	69,814
5Financiamiento mayorista no garantizado	256,091
6Depósitos operacionales	153,768
7Depósitos no operacionales	98,574
8Deuda no garantizada	3,749
9Financiamiento mayorista garantizado	No aplica
10Requerimientos adicionales:	292,311
11Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	9,490
12Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda----	
13Líneas de crédito y liquidez	282,821
14Otras obligaciones de financiamiento contractuales	636
15Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,857
16TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO No aplica	131,246 No aplica
<b>ENTRADAS DE EFECTIVO</b>	
17Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	11,866
18Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	45,350
19Otras entradas de efectivo	19,081
20TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	76,297
Importe ajustado	
21TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES No aplica	135,578 No aplica
22TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO No aplica	80,000 No aplica
23COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ [1] No aplica	168.73 No aplica

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 2024, 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 \$73,333 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$28,661 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 53 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

calificación de la institución en 3 niveles por \$1,904 millones y \$5,534 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$15,662 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$19,394 millones y por operaciones de call money de \$13,141 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$19,886 millones

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$142,601 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$105,850 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$26,019 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 \$7,323 millones y \$3,409 millones en títulos de nivel 2.

c) Los cambios de los principales componentes dentro del trimestre que se reporte; Promedio del tercer trimestre 2024: 167% - promedio del cuarto trimestre 2024: 169% El coeficiente de cobertura de liquidez incrementó 200 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$5,672 millones y los depósitos en bancos crecieron en MXN \$4,472 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un incremento de \$7,225 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco decreció en \$9,581 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en \$18,239 millones.

d) La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables ; Evolución de Activos Líquidos T4-2024

	Octubre	Noviembre	Diciembre
Efectivo	5%	6%	5%
Reservas en el Banco Central	21%	20%	18%
Nivel 1	71%	72%	74%
Nivel 2 <sup>a</sup>	3%	2%	3%
Nivel 2B0	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento

CAPTACION TRADICIONAL

	Octubre	Noviembre	Diciembre
Depósitos de exigibilidad inmediata	46%	47%	49%

Depósitos a plazo

	Octubre	Noviembre	Diciembre
Del público en general	36%	34%	32%

	Octubre	Noviembre	Diciembre
Mercado de dinero	6%	6%	6%

	Octubre	Noviembre	Diciembre
Títulos de crédito emitidos	5%	5%	5%

	Octubre	Noviembre	Diciembre
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%

PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS

	Octubre	Noviembre	Diciembre
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%

	Octubre	Noviembre	Diciembre
De corto plazo	2%	3%	3%

	Octubre	Noviembre	Diciembre
De largo plazo	5%	5%	5%

	Octubre	Noviembre	Diciembre
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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 54 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

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

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

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

Exposición Potencial Futura (diciembre 2024)

(Cifras en millones de pesos)

Con contrato de compensación 5,062

Sin contrato de compensación 9,218

Posibles llamadas de margen (diciembre 2024)

Colateral en Tránsito 47

Downgrade (diciembre 2024)

Baja calificación 3 niveles 5,534

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de diciembre 2024 es la siguiente:

Scotiabank-Exposición en Derivados

(cifras en millones de pesos) Posición Cierre

Factor de Riesgo

Tasas de interés 2,117,231

Tipo de cambio 314,715

Capitales 5,920

Total 2,437,866

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 2024, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de 7.1% al cierre de diciembre del 2024 y en promedio durante cuarto trimestre del 2024 fue de 6.1%.

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

Concentración de Depósitos Límite MM

Concepto

Concentración de Depósitos (MXN) 9,500

Concentración de Depósitos (USD) 175

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

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

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

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

b) La exposición al riesgo liquidez y las necesidades de financiamiento a nivel de la



Institución, teniendo en cuenta las limitaciones legales, regulatorias y operacionales a la transferibilidad de liquidez.

Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con las siguientes exposiciones a finales de diciembre 2024.

Descripción Promedio

T4 2024Diciembre 2024

Cash GAP 30 d - Grupo - estresado (MXN MM) 30,15927,316

Cash GAP 90 d - Grupo - estresado (MXN MM) 55,97946,047

Horizonte de Supervivencia - Banco (días) 4041

Horizonte de Supervivencia - Banco - estresado (días) 3838

Horizonte de Supervivencia - Grupo (días) 4041

Horizonte de Supervivencia - Grupo - estresado (días) 3838

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 2024 y el promedio del cuarto trimestre de 2024 son:

Scotiabank Posición

(Cierre) Posición (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 75,31363,746

Liquidity Buffer

(bajo métrica CCL) 142,206134,379

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

II. Información cualitativa

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

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

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

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

Dentro del Grupo Financiero existe una unidad encargada de la gestión de la liquidez, el área Tesorería Grupo, cuya responsabilidad es cubrir los excedentes y faltantes de

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

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

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

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

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

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

- Cálculo de CCL (Coeficiente de Cobertura de Liquidez)
- Cálculo de CFEN (Coeficiente de Financiamiento Estable Neto)
- Cómputo de Activos Líquidos
- Cálculo de LDR (Loan to Deposit Ratio)
- Monitoreo de la concentración de fondeo profesional
- Monitoreo de Brechas de Liquidez
- Monitoreo de Concentración de Depósitos
- Monitoreo de Depósitos con Bancos
- Monitoreo del Portafolio de Inversión
- Monitoreo de créditos cedidos como garantía de fondeo
- Pruebas de Estrés de Liquidez
- Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez
- Reportes periódicos al Comité de Activos y Pasivos de la Institución
- Reportes periódicos al Comité de Riesgos
- Reportes al Consejo de Administración
- Políticas y Manuales alusivos a la Administración del Riesgo de Liquidez
- Plan de Contingencia para Riesgos de Solvencia y Liquidez

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

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

para tal efecto.

- Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.

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

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

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

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

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

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

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

e)Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

- Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
- Apegarse a los sistemas de alertas tempranos, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.
- Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.
- Plantear acciones que aseguren que el riesgo de liquidez global del Grupo este dentro de los límites de tolerancia aprobados por el Consejo de Administración.
- Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.
- Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital de manera oportuna.
- En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de éstas:  
(i) operaciones de crédito simple garantizado con depósitos de regulación monetaria o depósitos en dólares que el Grupo Financiero mantenga en el Banco de México, o (ii) reportos sobre títulos elegibles. Dicho financiamiento está sujeto al procedimiento que señala la circular 10/2015 de Banxico.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 / 87

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

•Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el cuarto trimestre de 2024, 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 2024, 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 2024

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

(Cifras en millones de pesos)Cifras IndividualesCifras Consolidadas

Importe sin ponderar por plazo residualImporte ponderadoImporte sin ponderar por plazo residualImporte ponderado

Sin vencimiento< 6 mesesDe 6 meses a < 1 año>1 añoSin vencimiento< 6 mesesDe 6 meses a < 1 año>1 año

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE

1Capital:95,990.650.000.000.0095,990.6595,990.650.000.0095,990.65

2Capital fundamental y capital básico no fundamental.95,990.650.000.000.0095,990.6595,990.650.000.0095,990.65

3Otros instrumentos de capital.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00

4Depósitos minoristas:0.00210,855.241,108.3831.48195,382.470.00210,855.241,108.3831.48195,382.47

5Depósitos estables.0.0091,171.60503.0619.7287,110.650.0091,171.60503.0619.7287,110.65

6Depósitos menos estables.0.00119,683.64605.3111.76108,271.820.00119,683.64605.3111.76108,271.82

7Financiamiento mayorista:0.00361,147.0029,153.8556,050.88193,200.640.00361,147.0029,153.8556,050.88193,200.64

8Depósitos operacionales.0.0044,335.430.000.0022,167.710.0044,335.430.000.0022,167.71

9Otro financiamiento mayorista.0.00316,811.5829,153.8556,050.88171,032.930.00316,811.5829,153.8556,050.88171,032.93

10Pasivos interdependientes0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00

11Otros pasivos: 0.0050,053.77701.253,368.033,718.660.0050,053.77701.253,368.033,718.66

12Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00

13Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores. 0.0050,053.77701.253,368.033,718.660.0050,053.77701.253,368.033,718.66

14Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible95,990.65622,056.0130,963.4859,450.39488,292.4295,990.65622,056.0130,963.4859,450.39488,292.42

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO

15Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica8,356.14No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica8,356.14

16Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00

17Préstamos al corriente y valores:0.00126,945.8838,924.99299,930.21356,461.820.00126,945.8838,924.99299,930.21356,461.82

18Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.0.0012,933.110.000.001,293.310.0012,933.110.000.001,293.31

19Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.0.0014,250.079,526.603,579.8910,480.700.0014,250.079,526.603,579.8910,480.70

20Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:0.0076,898.5326,272.39134,609.96159,553.190.0076,898.53

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 / 87

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

26,272.39134,609.96159,553.19  
21Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00  
22Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:0.004,169.974,410.68252,899.16  
173,098.090.004,169.974,410.68252,899.16173,098.09  
23Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.0.001,194.191,284.6893,620.3762,092.670.00  
1,194.191,284.6893,620.3762,092.67  
24Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).0.0019,888.390.002,461.5712,036.530.0019,888.390.00  
2,461.5712,036.53  
25Activos interdependientes.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00  
26Otros Activos:0.0078,035.701,081.778,824.5840,479.030.0078,035.701,081.778,824.58  
40,479.03  
27Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.  
0.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.000.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.00  
28Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centralesNo Aplica  
2,541.960.000.002,160.66No Aplica2,541.960.000.002,160.66  
29Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No  
Aplica0.000.000.00916.20No Aplica0.000.000.00916.20  
30Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicialNo Aplica0.000.000.00842.14No Aplica  
0.000.000.00842.14  
31Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 75,493.74  
1,081.778,824.5836,560.030.0075,493.741,081.778,824.5836,560.03  
32Operaciones fuera de balance.No Aplica293,099.940.000.0014,655.00No Aplica293,099.94  
0.000.0014,655.00  
33Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo  
Aplica419,951.99No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica419,951.99  
34Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica  
116.27No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica116.27

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

Durante diciembre 2024, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:

•Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$192,711 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$129,265 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$94,410 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$29,319 millones y \$36,134 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$3,076 millones.

•Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$352,249 millones y por operaciones mercado de dinero de \$23,236 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$18,387 millones, deducciones de capital por \$11,548 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$1,781 millones.

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

Promedio del tercer trimestre del 2024: 115.48% - Promedio del cuarto trimestre del 2024: 116.27%

El coeficiente de financiamiento neto aumentó 79pb respecto al tercer trimestre del 2024, esto debido principalmente a:

a.El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional disminuyó en MXN 9,578 millones. El fondeo profesional aumentó en MXN 13,723 millones.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 61 / 87  
**CONSOLIDADO**  
Impresión Final

b.El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas aumentaron \$37,942 millones.

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

Monto Computable (MXN MM)	Octubre	Noviembre	Diciembre
Financiamiento Estable Disponible	486,957	487,791	490,130
Financiamiento Estable Requerido	417,594	421,193	421,069
Coeficiente de Fondeo Estable Neto	116.61%	115.81%	116.40%

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 2024 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$21.66 millones de pesos, con una minusvalía de \$0.22 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe	Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	1,000,000		2.47		1.94
				0.53			
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	105,000		3.29		
				3.14		0.15	
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	15,012		0.05		0.05
				-			
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	150,000		3.51		3.84
				(0.33)			
Scotiabank	Pública	1_ORBIA_*	150,000		2.25		2.33
				(0.08)			
Scotiabank	Pública	1_GCARSO_A1	34,000		3.92		
				4.06		(0.14)	
Scotiabank	Pública	1_LIVEPOL_C-1	10,000		0.99		
				1.00		(0.01)	
Scotiabank	Pública	1_BIMBO_A	30,152		1.67		
				1.66		0.01	
Scotiabank	Pública	1I_EWZ_*	7,500		3.51		3.86
				(0.35)			
<b>Total</b>			<b>1,501,664</b>	<b>21.66</b>	<b>21.88</b>	<b>(0.22)</b>	

Al cierre del cuarto trimestre del año 2024, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$0.60 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	100,000	0.04		-
				0.04		
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	50,000			- (0.01) (0.01)
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	20,000	0.02		
				-	0.02	
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	45,000	0.04		

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

-	0.04					
ScotiabankPública1B_NAFTRAC_ISHRS		75,000		0.01	(0.02)	(0.01)
ScotiabankPública1_CEMEX_CPO		130,000		0.03		
-	0.03					
ScotiabankPública1I_EWZ_*		1,000		0.01		
-	0.01					
ScotiabankPública1_AMX_B		763,891		0.10	(0.05)	
0.05						
ScotiabankPública1_NEMAK_A		3,703		-		
-	-					
ScotiabankPública1_CUERVO_*		53,619		-	(0.12)	(0.12)
ScotiabankPública1_WALMEX_*		74,857		0.01	(0.13)	(0.12)
ScotiabankPública1B_NAFTRAC_ISHRS		124,646		0.01	(0.11)	(0.10)
ScotiabankPública1_ALPEK_A		30,000		-		
-	-					
ScotiabankPública1I_IB1MXX_N		950		0.09		
-	0.09					
ScotiabankPública1_CEMEX_CPO		120,000		0.09		
-	0.09					
ScotiabankPública1_ORBIA_*		11,190		0.01		
-	0.01					
ScotiabankPública1_AMX_B		102,098		0.02		
-	0.02					
ScotiabankPública1_NEMAK_A		500,000		0.26		
-	0.26					
ScotiabankPública1_CUERVO_*		601		-		
-	-					
ScotiabankPública1_WALMEX_*		55,000		0.15		
-	0.15					
ScotiabankPública1B_NAFTRAC_ISHRS		139				-
-	-					
ScotiabankPública1_ALPEK_A		60,000		0.02		
-	0.02					
ScotiabankPública1I_EWZ_*		100		-		
-	-					
ScotiabankPública1_KIMBER_A		238,546		0.22	(0.17)	
0.05						
ScotiabankPública1_ELEKTRA_*		1,100		0.08		
-	0.08					
ScotiabankPública1_ARA_*		15,353		-		
-	-					
Total	2,576,793		1.21	(0.61)		0.60

La posición accionaria de títulos por cobrar o vender asciende \$0 millones de pesos, con una plusvalía de \$0 millones de pesos.

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

Scotiabank Sin cotización EMPRESAS FRISCO, S.A. DE C.V. 1,222---

Scotiabank Sin cotización BLADDEX COM8,095---

Total 9,317---

Al 31 de diciembre, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de \$32.26 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$23.72 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$8.54 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización Total Larga Total Corta Valor Absoluto de la posición

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Coefficiente de Riesgo de mercadoRequerimiento de capital  
Por Riesgo General de Mercado106.720.00106.7222.23%23.72  
Por riesgo específico  
Canasta de acciones, 106.720.00106.728.00%8.54  
Índices accionarios0.000.000.004.00%0.00  
Requerimiento por riesgos específico0.000.000.004.00%0.00  
Total Requerimiento de capital32.26

Anexo 1-0 Bis Revelación de Información relativa a la Razón de Apalancamiento

TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

ReferenciaRubrosep-24dic-24

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)803,884 830,701

2(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) (11,111) (11,204)

3Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)792,773819,497

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)3,7175,196

5Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados6,4187,100

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) (3,543) (3,341)

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)

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

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

11Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10) 6,5928,955

Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores

12Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas14,05223,661

13(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) (14,052) (23,400)

14Exposición Riesgo de Contraparte por SFT920

15Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros--

16Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)9281

Otras exposiciones fuera de balance

17Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)327,896357,426

18(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) (239,868) (265,024)

19Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)88,02892,402

Capital y exposiciones totales

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

20Capital de Nivel 178,77087,740  
21Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)887,401921,135  
Coeficiente de apalancamiento  
22Coeficiente de apalancamiento de Basilea III8.88%9.53%

## TABLA II.1

COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

ReferenciaDESCRIPCIONsep-24dic-24

1Activos totales 877,814918,579  
2Ajuste 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(842) (831)  
3Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento  
4Ajuste por instrumentos financieros derivados(53,286) (55,263)  
5Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores(14,043) (23,380)  
6Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden88,02892,402  
7Otros ajustes(10,268) (10,372)  
8Exposición del coeficiente de apalancamiento887,401921,135

## TABLA III.1

CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

ReferenciaDESCRIPCIONsep-24dic-24

1Activos totales877,814918,579  
2Operaciones en instrumentos financieros derivados(59,878) (64,218)  
3Operaciones en reporto y préstamos de valores(14,052) (23,661)  
4Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento  
5Exposiciones dentro del Balance803,884830,701

## TABLA IV.1

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

CONCEPTO/PERIODOsep-24dic-24Variación

Capital Básico 1)78,77087,740 8,970  
Activos Ajustados2)887,401921,135 33,734  
Razón de Apalancamiento 3)8.88%9.53%65 pb

1).Reportado en la fila 20  
2).Reportado en la fila 21 y  
3).Reportado en la fila 22, de la Tabla I.1

Cifras previas a la réplica de Banxico

Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la Razón de Apalancamiento por el periodo de septiembre a diciembre de 2024.

El indicador se ubicó en 9.53%, 65pb mayor respecto al trimestre anterior, debido al incremento del capital nivel 1 de \$8,970 millones(+101pb) por el resultado neto del periodo (+34pb) y sustitución de deuda subordinada (+61pb); disminuyendo parcialmente por el incremento de los activos ajustados por \$33,734 millones (-36 pb); principalmente por el incremento de las exposiciones dentro del balance.

## TABLA I.2

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

ReferenciaExplicación

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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:

a)Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución.

b)La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.

c)El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.

d)El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente.

e)El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.

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)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 66 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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 clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.

16Suma de las líneas 12 a 15

17Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.

18Montos 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.

19Suma de las líneas 17 y 18

20Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

21Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19

22Razón 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

#### ReferenciaExplicación

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2Monto 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.

3No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

4Monto 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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 67 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

.El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo

5Monto 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.

6Importe registrado en la fila 19 de la Tabla I.1. El monto se debe registrar con signo positivo.

7Monto 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.

8Suma 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

#### ReferenciaDescripción

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados presentadas en el activo de los últimos estados financieros.  
El monto se debe registrar con signo negativo.

3El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores presentadas en el activo de los últimos estados financieros.  
El monto se debe registrar con signo negativo.

4No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

5Suma de las líneas 1 a 4, la cual debe coincidir con la línea 1 de la Tabla I.1

## AGENCIAS CALIFICADORAS

Scotiabank-Calificaciones Escala NacionalLargo plazoCorto plazoPerspectiva

Fitch RatingsAAA (mex) F1+ (mex) Estable

Standard & Poor'ssmxAAAmxA-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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 68 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

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

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

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

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

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 21 de marzo del 2014, se aprobó modificación a la política para el pago de dividendos, a efecto de que se

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 69 / 87  
**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

decreten y paguen dividendos en un rango del 0%-30% respecto de las utilidades generadas durante el trimestre anterior.

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de octubre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de \$2,400'000,000.00 (Dos mil cuatrocientos millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.254768944692 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientas veinte millones trescientas mil cuatrocientos treinta y tres) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de "Utilidad de Ejercicios Anteriores".

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de diciembre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de \$2,000'000,000.00 (Dos mil millones de pesos 00/100) M.N., a razón de \$0.212307453910 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientos veinte millones trescientos mil cuatrocientos treinta y tres) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de "Resultado de Ejercicios Anteriores".

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

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

#### FUENTES INTERNAS Y EXTERNAS DE LIQUIDEZ

Al 31 de diciembre de 2024, 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\$130,193 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$51,428 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 2024, 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 a las políticas establecidas.

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al riesgo de tasas de interés y al riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura", en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las operaciones de cobertura.

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

Núm. Tipo de Cobertura Posición Cubierta Tipo de posición cubierta Condición de Mercado



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 / 87

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Derivado

1. Flujos de Efectivo Pagará 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)

Núm. Tipo de Cobertura Posición Cubierta Tipo de posición cubierta Condición de Mercado Derivado

8. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional)
9. Flujo de Efectivo Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

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

Subyacente Futuros Opciones Swaps

MRMRMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

- 1) Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (Currency Swaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (Forward Starting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los

modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.

2).(MR) Mercados reconocidos

3).(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

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

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

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

- 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:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 74 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

- 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 2024 y en promedio para el cuarto trimestre de 2024 es de:

Scotiabank-

Brechas de liquidez acumuladas

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 75,31363,746

Liquidity Buffer 142,206134,379

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

## INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration - Grupo Financiero Scotiabank (México).

El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación

implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los

aplicativos desarrollados en casa matriz (K2/Peak & Wall Street).

### INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

Producto Subyacente Moneda Modelo de Valuación Factor de Valuación Fuente de Precios

Cross Currency Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

FX Rate VALMER

Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

Interest Rate Cap/Floor (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest Rate Curve

VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

OTC Binary Interest rate Option (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest

Rate Curve VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

IRS Futures TIE Fondeo MXN Price Price VALMER

Listed Interest Rate Swap (CME) TIE Fondeo MXN Swap Interest Rate Curve VALMER

OTC European Index Call Spread Option OTC European Index Call Spread Option MXN, CAD, USD,

EUR, JPY Call Spread Option Curve VALMER

Price K2

Surface Trader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Basket Option Equity Index, Common Stock MXN, CAD, USD,

EUR, JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-Factor Curve VALMER

Price K2

Surface Trader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Equity Option Common Stock, Equity Index, ETF and Bond Index with Target

Volatility (Vol Under 15%) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY Equity Option Curve VALMER

Price K2

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC Index Binary Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETFMXN,CAD,USD,  
EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

ProductoSubyacenteMonedaMódulo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios  
OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVVALMER

Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVVALMER

Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVVALMER

Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVVALMER

Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVVALMER

FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,

MXN,PEN,AUD,EUR,

JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVVALMER

OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER

FX Rate

Surface

Price

Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,

BRL,CLP,COP,PEN,

AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

**INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO**

ProductoSubyacenteMonedaMódulo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios

Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,

EUR,JPY PricePriceVALMER

**POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO**

Se informa a esa H. Comisión que en el Manual de Políticas de Crédito Cartera Comercial, en su "Manual de Productos y Programas Especiales de Crédito Cartera Comercial, Apartado III Mercado Financiero, 1.1 Operaciones del Banco en el Mercado Financiero" se norman las operaciones del Banco en el Mercado Financiero estableciendo: TIPOS DE OPERACIÓN QUE SON OFRECIDOS EN FUNCIÓN AL TIPO DE ACREDITADO

a) Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

- Necesidades de tesorería del Banco
- Relación de corresponsalía
- Límites recíprocos

b) Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

- Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:

- Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO

1) Tesorería: Call Money

2) Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

3) Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

4) Cambios: FOREX

5) Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

6) Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

7) Metales

SUJETOS DE CRÉDITO

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

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

REGLAS PARTICULARES

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

IDONEIDAD DEL CLIENTE

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

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

POLÍTICAS DE VAR

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

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

**B) DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN****MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:****CÁLCULO DE SENSIBILIDADES**

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

**PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)**

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

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

**BONOS DE TASA FLOTANTE**

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

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

**BONOS CUPÓN CERO**

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

**RIESGO DE CRÉDITO**

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

**SENSIBILIDAD DEL PASIVO**

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

**DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS****SWAPS DE TASA DE INTERÉS**

Para efectos de determinar la sensibilidad a cambios en la curva de rendimiento de los Swaps de TIIE, se efectúa un cambio de 1 punto base en cada uno de los puntos

relevantes de la curva de rendimientos, además de un cambio de 1 y cien puntos base de forma paralela, valuando el portafolio con las diferentes curvas y calculando cual es el cambio en el valor del portafolio con cada uno de esos cambios.

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

#### FUTUROS DE TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

#### FUTUROS DE BONO M

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

#### FUTUROS DE CETE

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

#### EFFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:

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

Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios mensuales históricos, es decir una ventana de observación de cinco años con base en un análisis de regresión.

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

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

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

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

Significancia de la regresión:  $F > 5$ .

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de diciembre 2024 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el cuarto trimestre de 2024 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

#### COBERTURA DE FLUJOS DE EFECTIVO:

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

El componente que forma parte de "Otro Resultado Integral" asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre: la ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.

#### COBERTURA DE VALOR RAZONABLE:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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, 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 o 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 cubiertas desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.

Al cierre de diciembre de 2024 y promedio del cuarto trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank-

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Liquidity Buffer 142,206134,379

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:

Parámetro Descripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

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

Scotiabank

(millones de pesos)NormalEscenario

PosibleEscenario

ProbableEscenario

Estrés

Gap 30d Gap Acum75,31369,77869,77769,775

Cambios en el Gap respecto al escenario normal (5,535) (5,536) (5,538)

## 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: 2024

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 81 / 87  
CONSOLIDADO  
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 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

Cifras expresadas en pesos

A)ANÁLISIS DE SENSIBILIDADES DEL PORTAFOLIO DE OPERACIONES DERIVADAS DE TASA.

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a diciembre 31, 2024

	0-3 Months	3-12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total	Today
Swaps	10,743.00	557,493.00	(331,005.00)	158,457.00	159,117.00	(11,971.00)	542,834.00	
CCS	4.00	(88.00)	(115.00)	198.00	528.00	107.00	634.00	
Caps&Floors	763.00	(3,944.00)	(2,445.00)	1,130.00	(16.00)	(1.00)	(4,513.00)	
Binary Caps&Floors	-----							
F TIIIE Futures	-----							
Total	11,510.00	553,461.00	(333,565.00)	159,785.00	159,629.00	(11,865.00)	538,955.00	

## ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD

### SUPUESTOS DE CÁLCULO.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIIE, Bonos M, Cap&Floor el método para calcular 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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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 82 / 87  
 CONSOLIDADO  
 Impresión Final

Los impactos en los estados de resultados son:

- a) Bajo el escenario probable una pérdida de (37.08) Millones de pesos.
- b) Con escenario poco probable un P&L de (74.16) Millones de pesos.
- c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (158.46) Millones de pesos.

Los escenarios de stress están basados en el movimiento al alza que pudieran tener las tasas de interés, en el escenario probable de 50 pb, en el escenario poco probable de 100 pb y en el escenario muy poco probable 200pb. Los escenarios se muestran a continuación.

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 0.54211.8150.00 (26.95) 100.00 (53.90) 200.00 (107.79)

Volatilidad al 1% Caps & Floors -1.630.10 (0.00) 0.40 -1.00-

a FX % Forwards 4.85101.330.10 (10.13) 0.20 (20.27) 0.50 (50.66)

a FX % Opciones Divisa --0.100.000.20-0.50-

Total (37.08) (74.16) (158.46)

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 2024 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones Delta Vega Gamma

Options AAPL.OQ---

Options AMZN.OQ---

Options BNPUI5.INDX---

Options EEM.P---

Options ENHFO5.INDX---

Options ENHGE5.INDX---

Options FXI.P---

Options GOOG.OQ---

Options ICLN.OQ---

Options IDBTV1.INDX---

Options META.OQ---

Options MEXIPC.INDX---

Options MSFDV1.INDX---

Options QQQ.OQ---

Options SHELL.AS---

Options SOXX.OQ---

Options SPX.INDX---

Options SPXFP.INDX---

Options SPXSR5.INDX---

Options VLO.N---

TOTAL---

Análisis de Stress

Los escenarios de stress a la baja; probable (10%), poco probable (30%) y muy poco

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 83 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

probable (50%) son los siguientes:

Escenarios a la baja(0.1) (0.3) (0.5)

Options AAPL.OQ---  
Options AMZN.OQ---  
Options BNPUI5.INDX---  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX---  
Options META.OQ---  
Options MEXIPC.INDX---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SHELL.AS---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPX.INDX---  
Options SPXFP.INDX---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
TOTAL---

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

Escenarios al alza0.050.150.2

Options AAPL.OQ---  
Options AMZN.OQ---  
Options BNPUI5.INDX---  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX---  
Options META.OQ---  
Options MEXIPC.INDX---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SHELL.AS---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPX.INDX---  
Options SPXFP.INDX---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
Total---

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:

EscenarioMonto  
Probable-  
Poco Probable-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 84 / 87

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Muy poco Probable-

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 2024 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte Colateral Recibido MXN Colateral Enviado MXN Colateral Recibido USD Colateral  
Enviado USD

CLIENTE 1--12,745,000 (23,770,000)  
CLIENTE 21,060,000,000 (1,269,000,000) --  
CLIENTE 3--200,000 (11,635,000)  
CLIENTE 4--22,900,000-  
CLIENTE 542,300,170 (376,822,600) 24,650,000 (60,125,000)  
CLIENTE 6--13,730,000 (24,260,000)  
CLIENTE 7--268,550,000 (143,130,000)  
CLIENTE 8--189,100,000 (173,300,000)  
CLIENTE 9--8,610,000 (420,000)  
CLIENTE 10--- (100,000)  
CLIENTE 11--50,760,000 (22,140,000)  
CLIENTE 1293,000,000 (127,500,000) --  
CLIENTE 13348,600,000 (327,400,000) --  
CLIENTE 14136,500,000 (181,700,000) 184,620,000 (158,050,000)  
CLIENTE 1566,213,453 (2,871,151,000) --  
CLIENTE 1616,300,000 (22,300,000) --  
CLIENTE 17--1,850,000 (140,000)  
CLIENTE 18--1,870,000 (1,260,000)  
CLIENTE 19--220,000 (3,640,000)  
CLIENTE 20--15,150,000 (22,100,000)  
CLIENTE 212,700,000 (35,800,000) --  
TOTAL 1,765,613,623 (5,211,673,600) 794,955,000 (644,070,000)

REVELACIÓN DE CUALQUIER INCUMPLIMIENTO QUE SE HAYA PRESENTADO A LOS CONTRATOS  
RESPECTIVOS

DESCRIBIR Y NUMERAR LOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS QUE HAYAN VENCIDO DURANTE EL  
TRIMESTRE

Cifras expresadas en pesos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 85 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

**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 87 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

RESUMEN DE 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: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 28 de febrero de 2025, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Javier Antonio Serebrisky (Director General Adjunto de Finanzas), Fernando Rodríguez Antuña (Director General Adjunto de Auditoría Grupo) y Julián Felipe Vásquez Wilches (Director Corporativo Contabilidad General y Reportes Regulatorios) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

De conformidad con la Ley General de Sociedades Mercantiles (LGSM), los estatutos del Banco y las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito (las Disposiciones), emitidas por la Comisión Bancaria, los accionistas y la Comisión Bancaria tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2024 adjuntos, se someterán a la aprobación de los Accionistas.

Bases de presentación

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 Bancaria, 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 "Marco Conceptual de las Normas de Información Financiera", 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 Bancaria, aplicar una normatividad o criterios de contabilidad específicos sobre el reconocimiento, valuación, presentación y revelación aplicables a rubros específicos de los estados financieros consolidados y los aplicables a su elaboración.

Los Criterios de Contabilidad señalan que a falta de criterio contable específico de la Comisión Bancaria 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-1 en la sección 90 "Supletoriedad", y sólo en caso de que las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) a que se refiere la NIF A-1 no den solución al reconocimiento contable, se podrá optar por una norma supletoria que pertenezca a cualquier otro esquema normativo, siempre que cumpla con todos los requisitos señalados en la citada NIF y el mismo criterio contable, debiéndose aplicar la supletoriedad en el siguiente orden: los principios de contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP por sus siglas en inglés) y cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando cumpla con los requisitos del criterio A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad" de la Comisión Bancaria.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

## Uso de juicios y estimaciones

En la preparación de los estados financieros consolidados la Administración ha realizado juicios, estimaciones y suposiciones acerca del futuro, que afectan la aplicación de las políticas contables del Banco, los importes registrados de activos y pasivos y la revelación de activos y pasivos contingentes a la fecha de los estados financieros consolidados, así como los importes registrados de ingresos y gastos durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

## Juicios

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

Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros: definición del modelo de negocio: Instrumento Financiero para Cobrar Principal e Interés (IFCPI), Instrumento Financiero para Cobrar o Vender (IFCV), o Instrumento Financiero Negociable (IFN).

Nota 9 - Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: determinación sobre si los instrumentos financieros son de negociación o son designados con fines de cobertura.

Nota 10 - Cartera de crédito: definición del modelo de negocio, ya sea para cobrar principal e interés (IFCPI), o para cobrar o vender (IFCV).

Nota 14 - Arrendamientos: determinación de si un acuerdo contiene un arrendamiento.

Nota 16 - Inversiones en asociadas y otras inversiones permanentes: determinación si el Banco tiene influencia significativa (inversiones en asociadas) y determinación de si el Banco tiene control de facto sobre una participada.

(Continúa)

## 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 siguientes notas:

-Nota 3(j) - Valuación de instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo.

-Nota 4 - Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.

-Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros.

-Nota 10 y 11 - Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios y de recuperabilidad de cuentas por cobrar: supuestos e insumos utilizados en su determinación.

-Nota 20 - Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables, y la materialización de los impuestos diferidos; y

-Nota 23 - Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 3 / 99  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

claves.

Bases de medición

Los estados financieros consolidados se han preparado sobre la base del costo histórico, excepto en el caso de los siguientes rubros de los estados financieros, que se miden sobre una base alternativa, en cada fecha de reporte:

RubroBase de medición

Instrumentos financieros derivadosValor razonable  
Instrumentos financieros no derivados a valor razonable con cambios en el estado de resultados integralValor razonable  
Títulos de deuda y de capital a valor razonable con cambios en los Otros Resultados Integrales (ORI)Valor razonable

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 le son aplicables los modelos de valuación internos.

(Continúa)

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. La administración del Banco 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, la administración evalúa la evidencia obtenida de los terceros para respaldar la conclusión de que esas valuaciones satisfacen los requerimientos de las NIF, incluyendo el nivel 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 4 / 99  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

de entrada (observabilidad de los insumos) usados en las técnicas de valuación, como sigue:

Nivel 1: precios cotizados (no-ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos, que corresponde al nivel más alto.

Nivel 2: datos de entrada diferentes de los precios cotizados incluidos en el Nivel 1, que sean observables para el activo o pasivo, ya sea directa (es decir, precios) o indirectamente (es decir, provenientes de los precios).

Nivel 3: datos o insumos para medir el activo o pasivo que no se basan en datos de mercado observables (datos de entrada no observables), que corresponde a el nivel más bajo.

Los instrumentos financieros que son valuados mediante el uso de un modelo de valuación interno del 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:

Valores inscritos en el registro nacional de valores o autorizados, inscritos o regulados en mercados reconocidos por la Comisión Bancaria.

Instrumentos financieros derivados que cotizan en bolsas de derivados nacionales o que pertenecen a mercados reconocidos por el Banco Central.

Activos subyacentes y demás instrumentos financieros que forman parte de las operaciones estructuradas o paquetes de derivados, cuando se trata de valores o instrumentos financieros previstos en las fracciones I y II referidas anteriormente.

(Continúa)

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 los años terminados al 31 de diciembre de 2024 y 2023, 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 ambos años.

Al 31 de diciembre de 2024 y 2023, 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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 99  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

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 4 - Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.

Nota 7 - Inversión en instrumentos financieros; e

Nota 9 - Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura.

Moneda funcional y de informe

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

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

Presentación del resultado integral

En cumplimiento con el criterio contable D-2 "Estado de resultado integral" establecido por la Comisión Bancaria, 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".

(Continúa)

Reconocimiento de activos y pasivos financieros en su fecha de concertación

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

Resumen de las principales políticas contables

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en la preparación de los estados financieros consolidados que se adjuntan.

Reconocimiento de los efectos de la inflación

Los estados financieros consolidados que se acompañan fueron preparados de conformidad con los Criterios de Contabilidad, los cuales debido a que el 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 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:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 6 / 99  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

## Inflación

31 de diciembre de 2024 Del año Acumulada

2024 8.34% 9.50% 17.34%

2023 7.98% 16.38% 20.83%

2022 7.64% 6.87% 5.58% 19.50%

## 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 2024 y 2023, los que se prepararon de acuerdo con los Criterios de Contabilidad establecidos por la Comisión Bancaria.

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2024 y 2023, se detallan a continuación:

## Subsidiaria Participación Ubicación Actividad

Inmobiliaria 99.99% Ciudad de México Administración de activo fijo

Scotia Servicios 99.99% Ciudad de México Apoya la administración del negocio adquirente de tarjeta de crédito

Scotia Derivados 99.99% Ciudad de México Operador de contratos de futuros y opciones en México

## Operaciones en moneda extranjera

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración o liquidación. 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 período en que se originan dentro del rubro "Resultado por intermediación", según sea el caso.

## Compensación de activos financieros y pasivos financieros

Un activo y pasivo financiero serán objeto de compensación de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado su importe neto, sólo cuando el 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.

## Efectivo y equivalentes de efectivo

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

El efectivo se reconoce a su valor nominal. Se consideran efectivo, la moneda de curso legal y moneda extranjera en caja, los depósitos en el Banco Central y los depósitos en entidades financieras del país y el extranjero, ya sea en cuentas de cheques, giros bancarios, telegráficos o postales y remesas en tránsito.

Los equivalentes de efectivo se reconocen inicialmente a su valor razonable. Éstos incluyen valores a corto plazo, de alta liquidez, fácilmente convertibles en efectivo que están sujetos a riesgos poco importantes en su valor (donde estos últimos son aquellos cuyo plazo de vencimiento se prevé dentro de un máximo de 48 horas a partir de su adquisición), entre otros, los préstamos interbancarios con vencimientos iguales o menores a tres días hábiles (operaciones de "Call Money"), las compras de divisas que no se consideren instrumentos financieros derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable, y otros equivalentes de efectivo tales como correspondientes, documentos de cobro inmediato, e inversiones disponibles a la vista.

Las divisas adquiridas que se pacta liquidar en una fecha posterior a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como efectivo y equivalentes de efectivo restringidos (divisas a recibir); en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de efectivo y equivalentes de efectivo (divisas a entregar). Los derechos originados por las ventas de divisas se registran en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y las obligaciones derivadas de las compras de divisas se registran en el rubro de "Acreedores por liquidación de operaciones".

El monto de los sobregiros en cuentas de cheques, el saldo compensado, de divisas a recibir y divisas a entregar, o de algún concepto que integra el efectivo y equivalentes de efectivo, cuando muestran saldos negativos, se presenta en el rubro de "Otras cuentas por pagar".

(Continúa)

Las operaciones de préstamos interbancarios pactadas a un plazo menor o igual a 3 días hábiles, así como los depósitos en el Banco Central sobre las cuales no pueda disponer el Banco, se reconocen como equivalentes de efectivo restringidos.

Los intereses ganados y las utilidades o pérdidas por valuación se incluyen en los resultados del ejercicio conforme se devengan como parte de los ingresos o gastos por intereses. Los resultados por valuación y compraventa de divisas se reconocen en el resultado por intermediación.

Cuentas de margen

Las cuentas de margen están asociadas a transacciones con instrumentos financieros derivados celebrados en mercados o bolsas reconocidos, y corresponden al margen inicial, aportaciones y retiros posteriores efectuados en la vigencia de los contratos correspondientes. En las cuales se depositan activos financieros altamente líquidos destinados a procurar el cumplimiento de las obligaciones correspondientes a dichos instrumentos, a fin de mitigar el riesgo de incumplimiento. El monto de los depósitos corresponde al margen inicial y a las aportaciones o retiros posteriores que efectúen el 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.

Inversiones en instrumentos financieros

i.Reconocimiento y medición inicial

Las inversiones en instrumentos financieros comprenden instrumentos de capital, obligaciones, bonos, certificados y demás títulos de crédito y documentos que se emiten en serie o en masa, cotizados y no cotizados, que el Banco mantiene como posición propia. Se miden y reconocen inicialmente a su valor razonable más, en el caso de activos o pasivos financieros no medidos a valor razonable con cambios en éste, llevados a través de resultado integral, los costos de transacción directamente atribuibles a su adquisición o emisión, cuando en lo subsecuente se midan a su costo amortizado.

ii.Clasificación y medición posterior

En el reconocimiento inicial, las inversiones en instrumentos financieros se clasifican en las siguientes categorías, conforme al modelo de negocio y las características de los flujos contractuales de los mismos, como se muestra en la siguiente hoja.

(Continúa)

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).

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 9 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 deberá informar de este hecho por escrito a la Comisión Bancaria 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.

Un instrumento financiero se mide al costo amortizado si se cumplen las dos condiciones que se mencionan en la hoja siguiente y no está clasificado como medido a su valor razonable con cambios a través de resultados.

(Continúa)

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 específicas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe del principal pendiente (Sólo Pago del Principal e Intereses, o SPPI por sus siglas).

Una inversión en un instrumento de deuda se mide a valor razonable con cambios en ORI si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a valor razonable con cambios en resultados:

—el activo financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo se logra tanto obteniendo los flujos de efectivo contractuales como vendiendo los activos financieros; y

las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas específicas, a flujos de efectivo que están representados por SPPI únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe del principal pendiente.

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 -

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

El Banco determina su modelo de negocio para la administración de sus inversiones en instrumentos financieros y para clasificarlos adecuadamente. El modelo de negocio se basa en la forma en que los instrumentos financieros se administran para generar flujos de efectivo para el negocio y no en una intención particular de tenencia del instrumento. Se requiere de juicio para determinar el modelo de negocio, ya que este no se basa en un solo factor o actividad, por lo que se considera toda la evidencia disponible al momento de realizar la evaluación. De forma enunciativa mas no limitativa, la evidencia relevante a evaluar es la siguiente:

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 este se informa a la Administración del Banco;

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.  
(Continúa)

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 solo pagos del principal y los intereses (SPPI).

Para propósitos de esta evaluación, el monto del "principal" se define como el valor razonable del instrumento financiero en el momento del reconocimiento inicial. El "interés" se define como la contraprestación por el valor del dinero en el tiempo y por el riesgo crediticio asociado con el importe principal pendiente, durante un período de tiempo concreto y por otros riesgos y costos básicos de los préstamos (por ejemplo, el riesgo de liquidez y los costos administrativos), así como un margen de utilidad.

Al evaluar si los flujos de efectivo contractuales son solo pagos del principal e intereses SPPI, el 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:

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 11 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 incluir compensaciones adicionales razonables para el término 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 término anticipado) se trata de forma consistente con este criterio si el valor razonable de la característica de pago anticipado es insignificante en el reconocimiento inicial.

(Continúa)

Instrumentos financieros: Medición posterior y ganancias y pérdidas -

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

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

Los dividendos de los instrumentos de capital 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".

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 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 12 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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, 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".

### iii. Bajas

El Banco da de baja un instrumento financiero cuando expiran los derechos contractuales sobre los flujos de efectivo del instrumento financiero, o cuando transfiere los derechos a recibir los flujos de efectivo contractuales en una transacción en la que se transfieren sustancialmente todos los riesgos y beneficios de la propiedad del instrumento financiero, o en la cual el Banco no transfiere ni retiene sustancialmente todos los riesgos y beneficios relacionados con la propiedad y no retiene el control sobre los instrumentos financieros.

(Continúa)

El Banco participa en transacciones en las que transfiere los instrumentos reconocidos en su estado de situación financiera consolidado, pero retiene todos o sustancialmente todos los riesgos y beneficios de los instrumentos financieros transferidos. En estos casos, los instrumentos financieros transferidos no son dados de baja (ver incisos (h) Operaciones en reporto y (i) Préstamo de valores 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, 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 período en que ocurren dichos cambios, contra la utilidad o pérdida neta del período, como una reversión de PCE previamente reconocida.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 13 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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".

(Continúa)

Operaciones de reporto

Las operaciones de reporto que no cumplen con los términos establecidos en la NIF C-14 "Transferencia y baja de activos financieros", se les da el tratamiento de financiamiento con colateral atendiendo a la sustancia económica de dichas transacciones e independientemente si se trata de operaciones de reporto "orientadas a efectivo" u "orientadas a valores". En las transacciones "orientadas a efectivo" la intención como reportada es obtener un financiamiento en efectivo y la intención de la reportadora es el invertir su exceso de efectivo, y en la transacción "orientada a valores" la reportadora tiene como objetivo acceder a ciertos valores en específico y la intención de la reportada es la de aumentar los rendimientos de sus inversiones en valores.

Actuando como reportada

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el 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 ("Colateral otorgado") se reclasifican en el estado de situación financiera consolidado, presentándolos como restringidos, y se siguen valuando de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda al activo.

Actuando como reportadora

En la fecha de contratación de la operación de reporto, se reconoce la salida de efectivo y equivalentes de efectivo, o bien una cuenta liquidadora acreedora, registrando una cuenta por cobrar al precio pactado que se presenta en el rubro de "Deudores por reporto", la cual representa el derecho a recuperar el efectivo entregado. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por cobrar se valúa a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Ingresos por intereses". Los activos financieros recibidos como colateral, se registran en cuentas de orden y se valúan a valor razonable.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 a la reportada (inicialmente al precio pactado), la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. El diferencial que llegara a resultar entre el precio recibido y el valor de la cuenta por pagar se reconoce en los resultados del ejercicio, en adición, se lleva en cuentas de orden el control de dicho colateral vendido o dado en garantía siguiendo para su valuación el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

Asimismo, en el caso en que la reportadora se convierta a su vez en reportada por la concertación de otra operación de reporto con el mismo colateral recibido en garantía de la operación inicial, el interés por reporto pactado en la segunda operación se deberá reconocer en los resultados del ejercicio conforme se devengue, de acuerdo al método de interés efectivo, afectando la cuenta por pagar valuada a costo amortizado mencionada anteriormente.

(Continúa)

Las cuentas de orden reconocidas por colaterales recibidos o colaterales recibidos que a su vez hayan sido vendidos o dados en garantía por la reportadora, se cancelan cuando la operación de reporto llega a su vencimiento o exista incumplimiento por parte de la reportada.

Estimación de perdidas crediticias esperadas -

La estimación para pérdidas crediticias esperadas se determina conforme a lo establecido en la NIF C-16 "Deterioro de instrumentos financieros", lo cual implica que se determina inicialmente una etapa de riesgo a cada posición, y posteriormente calcular la estimación de pérdidas crediticia esperada asociada a cada etapa.

El Banco ha desarrollado el procedimiento para determinar las pérdidas crediticias esperadas para los instrumentos financieros, con el objeto de determinar el deterioro de los deudores por reporto para su posterior reconocimiento contable.

Préstamo de valores

Es aquella operación en la que se conviene la transferencia de valores, del prestamista al prestatario, con la obligación de devolver tales valores u otros substancialmente similares en una fecha determinada o a solicitud, recibiendo como contraprestación un interés. En esta operación se solicita un colateral o garantía por parte del prestamista al prestatario.

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.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Ingresos por intereses".

Actuando como prestatario-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 15 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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".

En la fecha en que el Banco venda el valor objeto de la operación, deberá reconocer la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir dicho valor al prestamista (medida inicialmente al precio pactado) que se valorará a valor razonable.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Gastos por intereses" y en el estado de situación financiera consolidado dentro del rubro de "Acreedores diversos y otras cuentas por pagar".

(Continúa)

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.

Para la determinación del valor razonable, se consideran los datos e insumos provistos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 16 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

por un proveedor de precios autorizado por la Comisión Bancaria, siempre y cuando no sean IFD que coticen en bolsas nacionales o que no sean intercambiados en mercados reconocidos por el Banco Central.

Operaciones con fines de negociación-

Contratos adelantados ("forwards"):

El contrato adelantado o "forward" se opera en forma privada (fuera de los mercados organizados de futuros o de opciones). El saldo de dichos IFD representa la diferencia entre el valor razonable del contrato y el precio "forward" estipulado del mismo. Si la diferencia es positiva es plusvalía y se presenta en el activo; si es negativa es minusvalía y se presenta en el pasivo.

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.

(Continúa)

reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

Futuros:

El contrato a futuro opera con términos estandarizados (condiciones generales de contratación), tiene mercado secundario y requiere el establecimiento obligatorio de colaterales en cuentas de aportaciones o de margen de liquidación diaria.

Swaps:

Es un IFD mediante el cual se establece la obligación bilateral de intercambiar flujos de efectivo en fechas futuras preestablecidas, sobre un valor nominal o de referencia durante un período determinado.

Su saldo representa la diferencia entre el valor razonable de la parte activa y de la parte pasiva.

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 consolidado, incluyendo si se espera que los cambios en los flujos

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

de efectivo de la partida cubierta y el instrumento de cobertura se compensen entre sí.

Los derivados con fines de cobertura, que cumplen con todas las condiciones, se valúan a valor razonable y el efecto se reconoce dependiendo del tipo de cobertura, de acuerdo con lo que se muestra a continuación:

Coberturas de valor razonable. Cubren la exposición a los cambios en el valor razonable de un activo o pasivo reconocido o de un compromiso en firme no reconocido, o un componente de alguna de las partidas anteriores, o una exposición agregada. La posición primaria cubierta y el instrumento derivado de cobertura se valúan a su valor razonable, registrándose el efecto neto en los resultados del período dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

En caso de que la partida cubierta sea un IFCV, el efecto de la ganancia o pérdida de cobertura del riesgo cubierto de la partida cubierta se reconoce en los resultados del ejercicio. El resultado por valuación del IFD que forme parte de una relación de cobertura se presenta en el mismo rubro del estado de resultado integral consolidado en donde se presenta el resultado por la valuación de la partida cubierta atribuible al riesgo cubierto.

(Continúa)

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 ORI. La parte inefectiva se registra en resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Una relación de cobertura debe discontinuarse prospectivamente cuando deja de cumplir con los criterios para reconocer una relación de cobertura, esto incluye cuando el instrumento de cobertura se vende, expira, se rescinde o se ejerce, así como después de que se ha considerado o llevado a cabo cualquier reequilibrio en la relación de cobertura y la relación de cobertura resulta ser no efectiva o no cumple con el objetivo de la administración de riesgo del 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 9 inciso (e) Derivados implícitos y nota 18 Captación tradicional inciso (b) Títulos de crédito emitidos, por el principal de los bonos bancarios).

El valor razonable del componente derivado se registra dentro de los rubros de "Instrumentos financieros derivados" y "Resultado por intermediación". Los intereses

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 18 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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.

Ajuste de valoración por riesgo crédito contraparte y riesgo de crédito propio

El Credit Valuation Adjustment (CVA) es un ajuste a la valuación de los instrumentos financieros derivados Over the Counter (OTC) por el riesgo asociado a la exposición crediticia asumida con cada contraparte.

Actualmente el 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.

(Continúa)

La determinación de la exposición se basa en insumos de mercado consistentes con los utilizados en los procesos de valuación de instrumentos y los parámetros de pérdida (severidad de la pérdida y probabilidad de incumplimiento) se revisan periódicamente y se someten a validaciones y pruebas de estrés (en su caso, para las contrapartes que tienen asociados Credit Default Swaps (CDS) a mercado, estos son utilizados para la obtención de la probabilidad de pérdida).

Los Modelos de Riesgo Contraparte correspondientes a las metodologías implementadas para obtener las exposiciones de crédito para el portafolio de derivados.

El Debit Valuation Adjustment (DVA) es un ajuste de valoración similar al CVA, pero, en este caso, surge por el riesgo de crédito propio del Banco asumido por sus contrapartes en derivados financieros OTC.

Todos los valores razonables de los instrumentos financieros se calculan diariamente.

Compensación de cuentas liquidadoras

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reportos, préstamos de valores y 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.

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,

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 19 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y se tenga la intención de liquidar la cantidad neta, provengan de la misma naturaleza de la operación, se celebren con la misma contraparte y se liquiden en la misma fecha de vencimiento o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

## Cartera de crédito

La cartera de crédito se compone de financiamientos otorgados a clientes por el 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 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.

(Continúa)

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 revolventes, 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, vivienda y consumo, conforme a lo descrito a continuación:

Créditos comerciales:

los otorgados a personas morales o personas físicas con actividad empresarial y

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 20 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

destinados a su giro comercial o financiero;  
créditos otorgados a entidades financieras distintos de los préstamos interbancarios con un plazo menor a 3 días hábiles;  
créditos por operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito;  
créditos otorgados a fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos y los esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados" en los que exista una afectación patrimonial que permita evaluar individualmente el riesgo asociado al esquema;  
los créditos concedidos al Gobierno Federal, entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados y los créditos a empresas productivas del estado, y aquellos con garantía expresa de la Federación registrados ante la SHCP y el Banco Central, así como los garantizados expresamente por las entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados, asentados en el Registro Público Único a que hace referencia la Ley de Disciplina Financiera de las entidades federativas y los municipios.

Créditos a la vivienda. Se clasifican como créditos a la vivienda los créditos directos otorgados a personas físicas y destinados a la adquisición o construcción de la vivienda sin propósito de especulación comercial, que cuentan con garantía hipotecaria sobre la vivienda del acreditado. Asimismo, se consideran créditos a la vivienda, los destinados a la construcción, remodelación o mejoramiento de la vivienda que están respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado, o bien cuentan con una garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo o por un fideicomiso público constituido por el Gobierno Federal para el fomento económico (remodelación o mejoramiento). Adicionalmente, se incluyen los créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades y aquellos créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado.

(Continúa)

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 21 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

(Continúa)

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 3s.

Modelo de negocio de la cartera de crédito

La determinación del modelo de negocio para la cartera de crédito se basa en el

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

historial de cómo el Banco la administra. El Banco considera lo siguiente:

La forma en cómo se determina e informa el desempeño de la cartera de crédito. Los riesgos que afectan el desempeño del modelo de negocio y de la cartera de crédito y cómo son administrados esos riesgos. Los lineamientos sobre los que se basa la remuneración de la dirección de crédito, si con base en maximizar el valor de la cartera de crédito o en cobrar sus flujos contractuales.

El Banco considera también la frecuencia, el valor y la oportunidad de las ventas de cartera de crédito en periodos 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 su modelo 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 en la hoja siguiente.

(Continúa)

Reestructuración. Es una renegociación de la que se deriva cualquier modificación a las condiciones originales del crédito, entre las cuales se encuentran:

cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;  
cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, Veces Salario Mínimo (VSM), Unidad de Medida y Actualización (UMA) o Unidades de Inversión (UDI));  
concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito, excepto por los que forman parte de los programas de apoyo para la Atención de Emergencias por Amenazas Naturales "OTIS";  
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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 23 / 99  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

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 lo que da de baja el crédito original.

(Continúa)

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 periodos consecutivos inmediatos anteriores.

Para la cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, cuando presentan atrasos de hasta un mes o atrasos de hasta tres meses para cartera que cuenta con prórroga; en el caso de cartera de crédito ROA cuando presenta de tres a seis meses de atraso, siempre que cada uno de los pagos realizados durante dicho período representa al menos el 5% de la amortización pactada.

En el caso de cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos menores o iguales a 30 días naturales o un mes calendario.

## Etapa 2

Incluye créditos que han mostrado un incremento significativo de riesgo desde su reconocimiento inicial y hasta la fecha de los estados financieros consolidados conforme a los modelos de cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios (ver nota 3p).

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el 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 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.

(Continúa)

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 eventos, los cuales tienen un impacto significativo sobre los flujos de efectivo futuros de dichos créditos. En específico, se consideran los créditos en esta etapa los que se muestran a continuación:

Aquéllos por los que el 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.

Tratándose de créditos de consumo no revolventes y créditos a la vivienda, que han sido pagados parcialmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

Créditos distintos a los mencionados en el numeral anterior, cuyas amortizaciones no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de "Efectivo y equivalentes de efectivo", al momento en que no han sido cobrados.

Créditos adquiridos al INFONAVIT, conforme a la modalidad de pago REA o ROA, y créditos destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda, cuando sus amortizaciones o pagos, respectivamente, no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presentan 90 días naturales o más de vencidos.

(Continúa)

El traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 de los créditos que la entidad haya adquirido al INFONAVIT conforme a la modalidad de pago ROA, contarán con el plazo establecido en el numeral 5 del párrafo anterior más un plazo adicional de 90 días, es decir, no podrán exceder de 180 días naturales vencidos para el traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 contados a partir de la fecha en la que ocurra alguno de los siguientes eventos:

tratándose de créditos de nueva originación, a partir de la fecha en que se efectúe el reconocimiento inicial del crédito en los registros contables del INFONAVIT o FOVISSSTE;

el acreditado de inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o

el Banco haya recibido el pago parcial de la amortización correspondiente. La excepción contenida en el presente inciso será aplicable siempre y cuando cada uno de los pagos realizados, representen al menos, el 5% de la amortización pactada.

Las excepciones mencionadas anteriormente no se consideran excluyentes entre sí. Estos cambios son aplicables a partir del 31 de diciembre de 2024.

Al 31 de diciembre de 2023, el traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 de los créditos a que se refiere el numeral 5 del párrafo anterior se sujeta al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

los recursos del crédito son dispuestos para el fin con que fueron otorgados;

el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o

el 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:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 26 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Periodicidad de pago  
contractualEquivalencia  
30 días90 días

Quincenal2 quincenasMás de 6 quincenas  
Catorcenal2 catorcenasMás de 6 catorcenas  
Decenal3 decenasMás de 9 decenas  
Semanal4 semanasMás de 13 semanas

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el 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 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. (Continúa)  
Cartera de crédito comercial, si presenta atrasos mayores o iguales a 90 días naturales o 3 meses calendario.

En el caso de adquisiciones de cartera de crédito, para la determinación de los días naturales de vencimiento, se consideran los incumplimientos que se hayan presentado desde su originación.

Los créditos que estando en Etapa 3 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago son reclasificados a Etapa 1, excepto los créditos reestructurados y/o renovados.

Efecto de renegociaciones en el nivel de riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito Etapa 2 o Etapa 3 que se reestructuren o se renueven no se reclasifican a una etapa con menor riesgo de crédito por efecto de su reestructura o renovación, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, que se reestructuren durante su plazo o se renueven en cualquier momento, son traspasados a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, y permanecen en dicha etapa hasta que existe evidencia de pago sostenido.

Las líneas de crédito dispuestas, que se han reestructurado o renovado en cualquier momento, se traspasan a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, excepto cuando se cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del acreditado y se ha cumplido lo siguiente:

se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y  
se ha cubierto la totalidad de los pagos a que esté obligado en términos del contrato a la fecha de la reestructuración o renovación.

Tratándose de disposiciones de crédito hechas al amparo de una línea de crédito, cuando se reestructuran o renuevan en forma independiente de dicha línea, son evaluadas de conformidad con las reglas para reestructuraciones y renovaciones aplicables antes

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 27 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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:

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

(Continúa)

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 con lo siguiente:

se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración;

se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto, y

se ha cubierto el 60% del monto original del crédito.

Si no se cumplen todas las condiciones descritas en los dos párrafos anteriores, según corresponda, el crédito se traspasa a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito desde el momento en que se reestructura o renueva y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Se considera cumplido el requisito de los incisos a) de los dos párrafos anteriores, cuando habiéndose cubierto el interés devengado a la última fecha de corte, el plazo transcurrido entre dicha fecha y la reestructura o renovación no excede el menor entre la mitad del período de pago en curso y 90 días.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 o Etapa 2 que se reestructuren o renueven en más de una ocasión, son traspasados a cartera con riesgo de crédito en Etapa 3, excepto cuando el 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 28 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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.

(Continúa)

Ampliación de la línea de crédito: sólo en el caso de créditos de consumo otorgados mediante líneas de crédito revolventes.

Pago sostenido del crédito.

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado cubre el monto total exigible de principal e intereses sin retraso, conforme a lo siguiente:

Cuando se trata de amortizaciones menores o iguales a 60 días, se cubre un mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito. Para créditos con periodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 29 / 99  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

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:

El acreditado ha cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,

Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo.

Los créditos que se reestructuran o renuevan en más de una ocasión, que se ha pactado con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, acreditarán pago sostenido del crédito cuando:

El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura o renovación;

(Continúa)

Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al nuevo esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo, y

La entidad cuenta con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor. En el caso de créditos comerciales, tales elementos están debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados, distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido. Tal es el caso de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a los periodos requeridos conforme al primer párrafo de esta subsección.

Los créditos que por efecto de una reestructura o renovación son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, en todos los casos permanecen un mínimo de tres meses en dicha etapa hasta acreditar pago sostenido. Se deberá de acreditar el pago sostenido en cada etapa de riesgo de crédito y en consecuencia ser traspasados a la etapa inmediata siguiente con menor riesgo de crédito. Lo anterior con excepción de los créditos con pago de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, en los que se aplica lo descrito previamente para estos casos.

En todo caso, para que el 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 Bancaria la 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:

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 30 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

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

Reconocimiento de ingresos, costos y gastos

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:

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.

(Continúa)

Determinar el interés efectivo. Es el resultado de restar a los flujos de efectivo futuros estimados a recibir, el monto neto financiado determinado como se describe en el numeral 1 del segundo párrafo de esta nota.

Determinar la tasa de interés efectiva. Representa la relación entre el interés efectivo y el monto neto financiado.

Cuando conforme a los términos del contrato, la tasa de interés se modifica periódicamente, la tasa de interés efectiva calculada al inicio del período, es la que se utiliza durante toda la vida del crédito, es decir, no se determina nuevamente para cada período.

Existe la presunción de que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito pueden ser confiablemente estimados, lo que sucede en la mayoría de las circunstancias; sin embargo, en aquellos casos en los que no sea posible estimar confiablemente los flujos de efectivo futuros o la vida estimada del o de los créditos, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales documentando las circunstancias y hechos que llevaron a dicha conclusión, previa autorización del Comité de Crédito.

Las comisiones y costos de transacción se amortizan contra los resultados del ejercicio por el período correspondiente al plazo de la línea de crédito asociada. Si la línea de crédito se cancela, el saldo pendiente por amortizar se reconoce totalmente en resultados.

Las comisiones reconocidas con posterioridad al otorgamiento de crédito que se generan como parte del mantenimiento de dichos créditos, así como las que se cobran con motivo de créditos no colocados, se reconocen contra los resultados del ejercicio conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito se reconocen inicialmente como un crédito diferido y se amortizan en un período de 12 meses contra los resultados del ejercicio, en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

Programa de lealtad de tarjetas de crédito

---

El Banco aplica Programa de lealtad de tarjetas de crédito con base en la NIF D-1 Ingresos por contratos con clientes, el cual incorpora el reconocimiento de ingresos derivados de programas de lealtad con clientes. De acuerdo con la NIF D-1, un cliente puede adquirir bienes o servicios adicionales de forma gratuita o con un descuento, incluyendo premios o puntos al cliente, esa opción da lugar a una obligación a cumplir siempre que la opción proporcione un derecho significativo al cliente que no recibiría sin la opción a que los clientes tienen derecho. El Banco registra un pasivo por la obligación de ofrecer una recompensa cuando el cliente canjea sus puntos. Los pasivos por puntos de lealtad son objeto de reevaluación periódica para reflejar el coste previsto de su canje. Cuando el cliente tiene la opción de canjear los puntos por créditos en su estado de cuenta, el coste del programa de lealtad se presenta neto de las comisiones de la tarjeta y en ese momento se reconoce el ingreso. Cuando los puntos sólo pueden canjearse por bienes o servicios, los ingresos por cuotas de intercambio asignados a las recompensas de fidelidad se reconocen cuando se canjean las recompensas.

(Continúa)

Criterios contables especiales derivado de las inundaciones y daños ocasionados por el Huracán OTIS

Mediante los oficios P-307/2023 de fecha 27 de octubre de 2023, P-318/2023 de fecha 10 de noviembre de 2023 y P-080/2024 de fecha 4 de abril de 2024, la Comisión Bancaria emitió con carácter temporal, los criterios contables especiales (CCE) para las instituciones de crédito respecto de la cartera crediticia de consumo, vivienda y comercial, para los clientes que hayan sido afectados en las zonas indicadas por la autoridad competente en la Declaratoria de Emergencia, o bien, a las señaladas en la Declaratoria de Desastre Natural, y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 o Etapa 2 al 24 de octubre de 2023. El plazo para realizar los trámites de renovación o reestructuración finalizaron el 31 de octubre de 2024.

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

Créditos a la vivienda con garantía hipotecaria.

Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).

Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial (PYME).

Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.

Microcréditos individuales o grupales.

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

Créditos con "pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento",

Créditos con "pagos periódicos de principal e intereses" y,

Créditos que desde su inicio se estipule su carácter de revolventes,

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

Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 32 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Etapa 1 al 24 de octubre de 2023, y que no cuenten con días de atraso, no presentaron clave de observación alguna en las SIC.

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

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

En caso de incluir quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, el Banco podrá diferir la constitución de estimaciones preventivas para riesgos crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una estimación por la diferencia en un período que no exceda de 12 meses.  
(Continúa)

Partidas diferidas

Se integra por el monto neto entre costos de transacción y comisiones por otorgamiento de crédito, así como los efectos de las renegociaciones.

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 ("PE"), que se determina multiplicando la Probabilidad de Incumplimiento ("PI") por el producto de la Severidad de la Pérdida en caso de Incumplimiento ("SP") y la Exposición al Incumplimiento ("EI").

Tratándose de líneas de crédito comprometidas no dispuestas, el 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:

El deudor se encuentra en situación de mora durante 90 días naturales o más respecto a cualquier obligación crediticia frente al Banco, o bien dicha obligación crediticia cumple con los supuestos para ser clasificada con riesgo de crédito Etapa 3, descritos anteriormente (ver nota 31).

Se considera probable que el deudor no abone la totalidad de sus obligaciones crediticias frente al 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 determinada conforme a la metodología estándar contenida en las

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 33 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Disposiciones.

En su caso, el Banco determina o reconoce las estimaciones adicionales, las cuales se constituyen para cubrir riesgos que no se encuentran previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia, y sobre las que previo a su constitución, el Banco informa a la Comisión Bancaria sobre lo siguiente:

origen de las estimaciones;  
metodología para su determinación;  
monto de estimaciones por constituir, y  
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.

(Continúa)

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 Bancaria, 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:

Entidades federativas y municipios.

Proyectos con fuente de pago propia.

Fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, no incluidos en la fracción anterior, así como esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados".

Entidades financieras.

Personas morales no incluidas en las fracciones anteriores y físicas con actividad empresarial que, a su vez, se divide en los siguientes subgrupos:

Con ingresos netos o ventas netas anuales menores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Con ingresos netos o ventas netas anuales iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Para el cálculo de la PI de los créditos comerciales se realiza de acuerdo con las Disposiciones, conforme a cada uno de los grupos descritos anteriormente, que consiste en evaluar factores cuantitativos y cualitativos del acreditado y asignarles un puntaje crediticio, el cual es totalizado y utilizado para calcular la PI.

Para el cálculo de la SP, si los créditos carecen de cobertura de garantías reales, personales o derivados de crédito, se determina conforme a los meses transcurridos de atraso, dependiendo del grupo al que pertenecen, y considerando si son o no créditos subordinados o sindicados en los que el 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 de la SP

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 34 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

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.

(Continúa)

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 Bancaria, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

El cálculo se realiza utilizando las cifras correspondientes al último día de cada mes constituyendo la calificación de reserva en crédito por crédito.

Asimismo, se consideran principalmente, factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) atraso, vi) información proveniente de las sociedades de información crediticia, vii) ROA, viii) REA y ix) prórroga.

En caso de que los créditos cuenten con seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito.

El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la PI por la SP y la EI o las diferentes reglas en las Disposiciones.

Cartera de consumo

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito de consumo se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión Bancaria, 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 35 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

Banco, (v) antigüedad del acreditado con otras 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.

(Continúa)

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 para riesgos crediticios

Consumo

Grado de riesgoNo revolventeTarjeta de crédito y otros créditos revolventesHipotecario y de vivienda Comercial

DeADeADeADeA

A-1-2.0%-3.0%-0.50%-0.90%

A-22.01%3.0%3.01%5.0%0.501%0.75%0.911.5%

B-13.01%4.0%5.01%6.5%0.7511.0%1.512.0%

B-24.01%5.0%6.51%8.0%1.0011.5%2.012.5%

B-35.01%6.0%8.01%10.0%1.5012.0%2.515.0%

C-16.01%8.0%10.01%15.0%2.0015.0%5.0110.0%

C-28.01%15.0%15.01%35.0%5.00110.0%10.0115.5%

D15.01%35.0%35.01%75.0%10.00140.0%15.5145.0%

E35.01% 100%75.01%100%40.001100%45.01100%

Castigos, eliminaciones y recuperaciones de cartera de crédito

El 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.

El Banco podrá optar por eliminar de su activo aquellos créditos con riesgo de crédito etapa 3 que se encuentren provisionados al 100% aun cuando no cumplan con las condiciones para ser castigados. Para tales efectos, el Banco deberá cancelar el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios.

Cualquier recuperación derivada de créditos previamente castigados o eliminados 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 3(s).

(Continúa)

Los costos y gastos incurridos por la recuperación de cartera de crédito deberán

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 36 / 99  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

reconocerse como un gasto dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto".

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 para riesgos crediticios sobre las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera, es aplicable a los montos perdonados derivado de incrementos en el riesgo crédito, en caso contrario deberán disminuirse de los ingresos que le dieron origen.

Otras cuentas por cobrar, neto

Las cuentas por cobrar reconocidas en este rubro no tienen interés ya sea explícito o implícito: por lo tanto, incluyen:

cuentas por cobrar de corto plazo; y  
otras cuentas por cobrar de corto plazo

No deberán incluirse las cuentas por cobrar derivadas de las operaciones a que se refieren:

los criterios B-3 "Reportos", B-4 "Préstamos de Valores" y B-6 "Cartera de Crédito" emitidos por la Comisión Bancaria;  
las correspondientes a los derechos de cobro definidos en el criterio "B-6"; y  
las cuentas por cobrar en el rubro de otras cuentas por cobrar provenientes de operaciones de arrendamiento operativo.

Las otras cuentas por cobrar se integran de las cuentas por cobrar liquidadoras por operaciones de venta de divisas, inversiones en valores, reportos, préstamo de valores, derivados y por emisión de títulos, así como de los deudores de cuentas de margen, deudores por colaterales otorgados en efectivo por operaciones con valores, crédito y derivados realizadas en mercados OTC. Asimismo, incluye los deudores diversos por premios, comisiones y derechos por cobrar sobre operaciones vigentes no crediticias, partidas asociadas a operaciones crediticias, saldos a favor de impuestos acreditables, préstamos y otros adeudos del personal, amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas y otros deudores.

Las cuentas por cobrar se deben valorar en su reconocimiento inicial al precio de la transacción (la contraprestación a la que el Banco considera tener derecho de cobro a cambio de transferir el control sobre los bienes o servicios a un cliente) en el momento de considerarse devengada la operación que le dio origen, lo cual ocurre cuando, se transfiera el control sobre los bienes o servicios acordados con el cliente a cambio de una contraprestación, en acuerdo con los términos del contrato celebrado.

(Continúa)

Las cuentas por cobrar deben incluir los impuestos y derechos trasladables al cliente y cualquier otro cobro al cliente por cuenta de terceros. El Banco debe reconocer un pasivo por el monto de cobro por cuenta de terceros incluidos en las cuentas por cobrar.

Las cuentas por cobrar denominadas en moneda extranjera se deben reconocer inicialmente

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 37 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

en la moneda funcional, utilizando el tipo de cambio histórico; que es aquél con el cual el Banco pudo haber realizado las cuentas por cobrar a la fecha de la transacción.

Las cuentas por cobrar deben valuarse en su reconocimiento posterior al precio de la transacción pendiente de cobro.

Estimación para pérdidas crediticias esperadas

La estimación de pérdidas crediticias esperadas se debe reconocer desde su inicio en las cuentas por cobrar, afectando resultados del ejercicio dentro del rubro "Otros ingresos de la operación, neto".

En su reconocimiento posterior, se deben reconocer los cambios requeridos en la estimación para pérdidas crediticias esperadas por las modificaciones en las expectativas de las pérdidas crediticias esperadas que surjan en cada período en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Otros ingresos de la operación, neto".

La estimación para pérdida crediticias esperadas se debe determinar a través del juicio profesional del Banco, considerando la evaluación de las pérdidas esperadas por el deterioro de las cuentas por cobrar, utilizando factores como la experiencia histórica de las pérdidas crediticias, condiciones actuales y pronósticos razonables y sustentables de los diferentes eventos futuros cuantificables que pudieran afectar el flujo de efectivo futuro por recuperar de las cuentas por cobrar.

La estimación para incobrabilidad para cuentas por cobrar comerciales se reconoce desde el momento en que se devenga el ingreso, con base en las pérdidas crediticias esperadas.

Desde el reconocimiento inicial, deberá considerarse el valor del dinero en el tiempo, por lo que, si el efecto del valor presente de la cuenta por cobrar es importante en atención a su plazo, deberá ajustarse con base en dicho valor presente.

Por lo anterior la Administración del Banco ha desarrollado el procedimiento para el cálculo de pérdida crediticia esperada para constituir dicha estimación basado en la siguiente ecuación:

$$PE = \sum_{i=1}^n EI_{ij} * TP_j$$

(Continúa)

En donde:

PE: Pérdida esperada;

EI<sub>ij</sub>: Exposición al incumplimiento de la operación i en el grupo de atraso j;

TP<sub>j</sub>: Tasa de pérdida del grupo de atraso j;

j: j-ésimo grupo de atraso;

n: El número de operaciones.

La tasa de pérdida se calcula con ayuda del análisis de la proporción de saldo que se ha pagado en cada bucket de atraso, de esta manera, se analiza la concentración del saldo por bucket de atraso y con ello, definir el umbral de deterioro y la asignación del 100% de pérdida.

El Banco puede determinar la pérdida esperada de manera individual para deudores que

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 38 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

tienen características particulares, en caso de que sea impráctico, éstos se califican agrupándolos por características homogéneas o comunes.

En este sentido, el Banco ha desarrollado una metodología en donde se determinó impráctico realizar una evaluación individual de las cuentas por cobrar, por lo cual se derivaron de modelos estadísticos desarrollados con datos históricos de las cuentas por cobrar en donde se calificaron y agruparon por características comunes y homogéneas en términos de riesgo en donde basados en elementos clave para la medición de la pérdida esperada crediticia se determinaron las siguientes variables: Tasa de Pérdida ("TP") y Exposición al Incumplimiento ("EI").

Para estimar los parámetros y aplicarlos de forma colectiva, los activos que integran las cuentas por cobrar fueron agrupados de acuerdo con los días de atraso que poseen al momento de la estimación del deterioro, asignándoles un grupo de morosidad para lo cual se identificó en el caso particular del Banco, dicho período es de 120 días, conforme al proceso de cobro.

Cuando el Banco considere nula la probabilidad de cobro de una cuenta por cobrar, debe dar de baja el valor neto en libros de la cuenta por cobrar, aplicando la cuenta por cobrar a la estimación para pérdidas crediticias esperadas. Si la estimación fuera insuficiente, debe ajustarse de inmediato afectando los resultados del ejercicio en el rubro "Otros ingresos de la operación, neto".

Las cuentas por cobrar, en su caso, se presentan deducidas de la estimación para pérdidas crediticias esperadas dentro del estado de situación financiera consolidado en el rubro "Otras cuentas por cobrar (neto)".

Otras consideraciones de la estimación de pérdidas crediticias esperadas para otras cuentas por cobrar:

Los sobregiros de cuentas de cheques de clientes que no cuentan con líneas de crédito de sobregiro, se clasifican, al momento de su reconocimiento, como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

(Continúa)

El Banco no constituye estimación de pérdidas crediticias esperadas por:

Saldos a favor de impuestos,  
Impuesto al Valor Agregado (IVA) acreditable y  
Cobros a clientes por cuenta de terceros.

No es objeto de este inciso las cuentas por cobrar con riesgo operacional, que su eliminación se reconoce en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto".

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 39 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 período 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 revisa periódicamente por pérdidas por deterioro, si corresponde, y se ajusta por ciertas nuevas valuaciones del pasivo por arrendamiento como cambios en el monto de la renta por ajuste de inflación.

(Continúa)

El pasivo por arrendamiento se mide inicialmente al valor presente de los pagos de arrendamiento pendientes de pago 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 40 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

por la terminación anticipada de un arrendamiento a menos que el Banco esté razonablemente seguro de no terminar antes de tiempo.

El pasivo por arrendamiento se valúa al costo amortizado utilizando el método de interés efectivo. Se vuelve a valuar bajo las siguientes condiciones:

hay un cambio en los pagos de arrendamiento futuros que surgen de un cambio en un índice o tasa;  
hay un cambio en la estimación del 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  
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, neto", y los pasivos por arrendamiento en el rubro "Pasivo por arrendamiento", ambos en el estado de situación financiera consolidado.

Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

El 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 el período en el que dichos gastos por arrendamiento se devengan a lo largo del plazo del arrendamiento.

(Continúa)

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:

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

al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación o el valor razonable del activo recibido, cuando la intención de la entidad es utilizar el activo adjudicado para sus actividades.

En la fecha de registro del bien adjudicado o recibido mediante dación en pago, el valor del activo que dio origen a la adjudicación, así como su respectiva estimación preventiva para riesgos crediticios que se tuviera constituida, se dan de baja del estado de situación financiera consolidado por el total del activo neto de la

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 41 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

estimación, deducido de los pagos parciales en especie en caso de cartera de crédito, o de los cobros o recuperaciones cuando se trata de derechos de cobro.

La diferencia entre el valor del activo que dio origen a la adjudicación, neto de estimaciones, y el valor del bien adjudicado determinado conforme a lo descrito en el segundo párrafo de esta nota, se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto".

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 de la operación, neto".

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 de la operación, neto". La determinación de las reservas por tenencia de bienes muebles o inmuebles, adjudicados o recibidos en dación en pago por el transcurso del tiempo, se determina, conforme a lo que se muestra en la hoja siguiente.

(Continúa)

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 de la operación, neto".

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.

Propiedades, mobiliario y equipo, neto

Las propiedades, mobiliario y equipo son registrados a su costo de adquisición. Los saldos que provienen de adquisiciones realizadas hasta el 31 de diciembre 2007 se actualizaron mediante factores derivados del valor de la UDI de su fecha de adquisición

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 42 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

hasta esa fecha, que fue cuando se suspendió el reconocimiento de la inflación en la información financiera de acuerdo a las NIF. Los componentes adquiridos en moneda extranjera se registran al tipo de cambio histórico, es decir, a aquellos vigentes en la fecha de adquisición del bien.

La depreciación se calcula usando el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del Banco de los activos correspondientes.

El monto a depreciar de 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.

(Continúa)

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.

Las mejoras y adaptaciones a locales arrendados se amortizan durante el plazo del arrendamiento. El plazo de arrendamiento debe considerar los periodos cubiertos por una opción para extender el arrendamiento si hay certeza razonable de que vaya a ejercer esa opción.

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 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 y las cuales están sujetas a pruebas de deterioro.

Las inversiones permanentes se incrementan o disminuyen en su caso por la participación en el resultado neto de otras entidades, dividendos, efectos de deterioro y sus reversiones.

Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios

Los activos de larga duración se clasifican como mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios si cumplen todos los requisitos que se muestran a continuación:

El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta. 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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 43 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.

Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que la entidad celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del período de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control de la entidad y existen evidencias suficientes de que la entidad se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.

Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.

No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

(Continúa)

Los activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios que cumplan con los requisitos anteriores se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

Deterioro de activos de larga duración

El Banco evalúa periódicamente el valor neto en libros de los activos de larga duración para determinar la existencia de indicios de que dicho valor excede su valor de recuperación. El valor de recuperación representa el monto de los ingresos netos potenciales que se espera razonablemente obtener como consecuencia de la utilización o realización de dichos activos.

Si se determina que el valor neto en libros excede el valor de recuperación, el Banco registra las estimaciones necesarias. Cuando se tiene la intención de vender los activos, éstos se presentan en los estados financieros consolidados a su valor neto en libros o de realización, el menor. Los activos y pasivos de un grupo clasificados como mantenidos para la venta se presentan por separado en el estado de situación financiera consolidado.

Pagos anticipados y otros activos, neto

Los pagos anticipados representan aquellas erogaciones efectuadas por el Banco en donde no han sido transferidos los beneficios y riesgos inherentes a los bienes que está por adquirir o a los servicios que está por recibir. Los pagos anticipados se reconocen como un activo por el monto pagado, siempre que sea probable que los beneficios económicos futuros que estén asociados con tales pagos fluyan hacia el Banco.

Una vez recibidos los bienes y/o servicios, relativos a los pagos anticipados, estos se reconocen como un activo o como un gasto en el estado consolidado de resultado integral, según sea la naturaleza respectiva.

Los pagos anticipados y otros activos incluyen erogaciones realizadas principalmente por gastos de licencias y anticipo de PTU.

Impuestos a la utilidad y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU)

Los impuestos a la utilidad y la PTU causados en el año, se determinan conforme a las disposiciones fiscales y legales vigentes.

Los impuestos a la utilidad diferidos y la PTU diferida se registran de acuerdo con el

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 44 / 99  
**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de estos. 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 consolidados 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 impuestos a la utilidad y PTU diferidos se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas fiscales sobre los impuestos a la utilidad y PTU diferidos se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por PTU diferida se reconoce en el rubro de "Pagos anticipados y otros activos, neto", en tanto que la PTU causada se reconoce en el rubro de "Pasivo por beneficios a los empleados" en el estado de situación financiera consolidado.

(Continúa)

El activo por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se evalúan periódicamente creando, en su caso, una reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los ORI. La PTU causada y diferida se incorporará dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción" en el estado consolidado de resultado integral.

## Activos intangibles

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del 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.

## 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:

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 45 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y el Banco constituye simultáneamente a dicha clasificación una pérdida crediticia esperada por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

Depósitos a plazo. Incluyen, entre otros, a los certificados de depósito retirables en días preestablecidos, aceptaciones bancarias y pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento captados del público en general y a través de operaciones en el mercado de dinero, estos últimos referidos a depósitos a plazo realizados con otros intermediarios financieros, así como con tesorerías de empresas y de entidades gubernamentales.

Títulos de crédito. Se integran de, entre otros, los bonos bancarios y los certificados bursátiles.

Cuenta global de captación sin movimientos. Incluye el principal y los intereses de los instrumentos de captación que no tengan fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven en forma automática, así como las transferencias o las inversiones vencidas y no reclamadas.

(Continúa)

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 (IFP)" y evaluar si la tasa determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso. Sólo en caso de que la tasa de interés de mercado sea sustancialmente distinta a la tasa efectiva, debe utilizarse la tasa de mercado como la tasa de interés efectiva en la valuación del instrumento, reconociendo en la utilidad o pérdida neta los efectos que se produzcan en el valor del IFP por el cambio de tasa de interés.

Los intereses de captación tradicional se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos de emisión, así como el descuento o premio en la colocación se reconocen como parte del pasivo que le dio origen, según se trate, el cual es amortizado en resultados conforme se devengue como gastos o ingresos por intereses, según corresponda, tomando en consideración el plazo del título que le dio origen en proporción al vencimiento de los títulos.

Obligaciones subordinadas en circulación

Las obligaciones subordinadas se reconocen contablemente como un instrumento financiero con un componente de pasivo (principal) y un componente de capital contable (intereses o rendimientos) de acuerdo con las definiciones establecidas en la NIF C-12

"Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital" y atendiendo a la sustancia de la operación.

En lo que se refiere a los intereses o rendimientos de las obligaciones, en caso de

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 46 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

cumplirse las condiciones contractuales, estos son pagados a total discreción del Banco y se reconocen en el capital contable dentro del rubro de los "Resultados acumulados".

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.

Hasta el 14 de noviembre de 2024, fecha de la amortización de las obligaciones subordinadas, los intereses se reconocieron conforme al método de interés efectivo, en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses", considerando que dichos intereses reunían las características de un pasivo.

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".

(Continúa)

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.

Acreeedores diversos y otras cuentas por pagar

Los acreedores diversos y otras cuentas por pagar incluyen las 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.

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.

(Continúa)

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 (y) 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 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 reconocen 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 23).

Planes de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 48 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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.

(Continúa)

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 remediciones (antes ganancias y pérdidas actuariales), resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable.

Reconocimiento de ingresos

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan.

Los intereses devengados sobre cartera en Etapa 3 se reconocen en resultados hasta que se cobran.

Los intereses y comisiones cobradas por anticipado se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a resultados conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial de un crédito se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses durante la vida del crédito. Las comisiones por anualidad y renovación de productos de cartera comercial, consumo y vivienda se difieren, según corresponda, asimismo, los costos o gastos vinculados con el otorgamiento de créditos,

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 49 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

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 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.

(Continúa)

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.

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.

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 de los saldos diarios de sus operaciones pasivas del mes de que se trate.

Cuentas de orden

En las cuentas de orden se registran activos o compromisos que no forman parte del estado de situación financiera consolidado del 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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 50 / 99  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

Bienes en fideicomiso o mandato:

El Banco registra en cuentas de orden las operaciones de Bienes o Fideicomisos acorde a lo que se muestra a continuación:

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.

(Continúa)

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 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 51 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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".

(Continúa)

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, siguiendo para su valuación los lineamientos relativos a las operaciones de custodia establecidos en el Criterio Contable B-9, "Custodia y Administración de Bienes, emitido por la Comisión Bancaria".

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, siguiendo para su valuación los lineamientos relativos a las operaciones de custodia establecidos en el Criterio Contable B-9, "Custodia y Administración de Bienes", emitido por la Comisión Bancaria.

Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito en Etapa 3:

Se registran los intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3.

Otras cuentas de registro:

Se registran principalmente por garantías recibidas por el Banco, entre otros.

Contingencias

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados.

Los ingresos o activos contingentes se deben reconocer en los estados financieros consolidados cuando la incorporación de beneficios económicos se convierta en probable, esto es, hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

Cuando se determine que los activos y pasivos contingentes no se tiene certeza razonable de la incorporación de beneficios económicos o de la existencia de una obligación presente, respectivamente, estos no se deben reconocer en los estados financieros consolidados, debido a que su existencia es posible mas no probable. En este caso, se busca revelar estimaciones de los posibles efectos financieros en las notas a los estados financieros consolidados.

Mientras los activos y pasivos mantengan el carácter de contingentes, su control se debe llevar en cuentas de orden.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 52 / 99

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(Continúa)

Pronunciamientos normativos emitidos recientemente

Mejoras a las NIF 2025 y 2024

En diciembre de 2024 y 2023, el CINIF emitió los documentos llamados "Mejoras a las NIF 2025" y "Mejoras a las NIF 2024", respectivamente, que contienen modificaciones puntuales a algunas NIF ya existentes. Las principales mejoras que generan cambios contables son las siguientes:

NIF A-1 Marco Conceptual de las Normas de Información Financiera - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada a partir de 2024 si se adoptan anticipadamente las revelaciones de las NIF particulares aplicables al tipo de entidad que corresponda. Incluye la definición de entidades de interés público y requiere que se revele si la entidad se considera una entidad de interés público o una entidad que no es de interés público. Divide los requerimientos de revelación de las NIF en: i) revelaciones aplicables a todas las entidades en general (entidades de interés público y entidades que no lo son), y ii) revelaciones adicionales obligatorias solo para las entidades de interés público. En adición esta Mejora realiza precisiones a los requerimientos de revelación de políticas contables importantes para enfatizar que incluyan información específica de la entidad y el cómo ha aplicado los requerimientos de las NIF a sus propias circunstancias. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF B-2 Estado de flujos de efectivo- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada en 2024. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1. Esta mejora adiciona requerimientos de revelación sobre los acuerdos de financiamiento a proveedores.

NIF B-3 Estado de resultado integral y NIF C-3 Cuentas por cobrar- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada en 2024. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1. Esta mejora modifica los requerimientos de estas NIF respecto a la presentación de los descuentos, las bonificaciones y las devoluciones en un rubro por separado dentro del estado de resultado integral, para eliminar cualquier inconsistencia con lo previsto por la NIF D-1 Ingresos por contratos con clientes.

NIF B-14 Utilidad por acción- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada en 2024. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1. Modifica el alcance de la NIF para que esta sea aplicable solo a entidades que tienen instrumentos de capital listados o por listar, en una bolsa de valores. El Banco adoptó anticipadamente esta mejora a la NIF y no tuvo efectos en sus revelaciones.

NIF B-15 Conversión de monedas extranjeras- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada en 2024. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1. Establece la normativa aplicable a la intercambiabilidad de la moneda.

NIF C-6 Propiedades planta y equipo- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada en 2024. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1. Esta mejora elimina





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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 55 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Variable	108,376,855.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/09/202222/09/202710.4944
Tasa Variable	4,222,474.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/09/202222/09/202710.4944
Tasa Variable	84,449,497.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	17/10/202215/10/202710.695
Tasa Variable	123,620,571.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	10/11/202211/10/202710.686
Tasa Variable	15,466,617.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/11/202223/10/20264.78874
Tasa Variable	47,762,717.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija
Tasa Fija	4,634,141.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija
Tasa Fija	15,982,615.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija
Tasa Fija	43,731,357.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	20/12/202218/12/202610.675
Tasa Variable	6,021,350.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	24/01/202323/01/202510.444
Tasa Variable	10,002,901.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	14/02/202313/02/202510.444
Tasa Variable	14,004,061.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	16/02/202314/02/202510.444
Tasa Variable	10,002,901.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/04/202331/03/20285.20701
Tasa Variable	73,704,674.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/05/202314/05/202710.6875
Tasa Variable	728,443.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	01/06/202331/05/20284.87701
Tasa Variable	13,173,506.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	02/06/202325/05/20274.84874
Tasa Variable	57,758,934.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	09/06/202330/03/20284.90466
Tasa Variable	120,689,156.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/06/202320/06/202510.4244
Tasa Variable	14,036,485.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	06/07/202306/07/202810.1 Tasa Fija
Tasa Fija	3,547,637.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	17/07/202322/06/20274.63874
Tasa Variable	34,591,722.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/07/202316/06/202810.494
Tasa Variable	99,677,576.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	26/07/202329/06/202810.494
Tasa Variable	125,750,931.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	01/08/202301/07/202710.705
Tasa Variable	3,327,292.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	25/08/202325/08/20284.98771
Tasa Variable	96,833,437.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	28/07/202315/01/202510.5875
Tasa Variable	56,389.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	31/08/202331/08/20284.65701
Tasa Variable	10,721,274.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	25/09/202315/09/202710.6875
Tasa Variable	1,237,809.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/09/202329/09/202710.4929

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 56 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Tasa Variable 6,879,007.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/10/202329/09/202810.74 Tasa	
Fija 25,086,335.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/10/202302/10/202810.83 Tasa	
Fija 6,815,291.24	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/10/202327/08/202710.344	
Tasa Variable 28,931,017.12	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/10/202305/10/202610.6863	
Tasa Variable 9,238,656.56	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/10/202319/10/202810.685	
Tasa Variable 61,569,986.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/10/202319/10/202810.685	
Tasa Variable 6,148,633.14	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/10/202317/02/202710.525	
Tasa Variable 32,553,240.91	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/11/202331/10/202810.514	
Tasa Variable 22,239,822.15	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/11/202319/10/202810.665	
Tasa Variable 81,688,395.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/12/202330/11/20275.38701	
Tasa Variable 14,034,248.11	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/12/202327/12/20289.73 Tasa	
Fija 257,490,357.16	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/01/202417/01/202510.344	
Tasa Variable 4,781,373.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/02/202420/01/202510.344	
Tasa Variable 4,579,456.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/02/202421/01/202510.344	
Tasa Variable 2,991,408.28	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/02/202413/02/202610.6375	
Tasa Variable 1,758,273.61	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/02/202423/02/20299.9 Tasa	
Fija 93,598,823.88	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/02/202421/02/202510.344	
Tasa Variable 4,941,489.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/02/202421/02/202510.344	
Tasa Variable 5,075,495.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/03/202423/01/202510.344	
Tasa Variable 4,586,769.49	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/03/202411/03/20295.42 Tasa	
Fija 119,366,323.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/03/202406/03/20255.3574	
Tasa Variable 23,664,180.06	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/03/202407/03/20255.29252	
Tasa Variable 27,658,635.90	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/03/202411/03/202610.394	
Tasa Variable 10,002,887.22	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/03/202419/03/202710.69 Tasa	
Fija 10,528,061.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/03/202427/02/202510.344	
Tasa Variable 4,204,453.73	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/04/202427/03/20254.96666	
Tasa Variable 37,615,149.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/04/202431/03/202610.394	
Tasa Variable 9,002,598.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/04/202416/01/202510.344	



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 57 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Variable 5,350,224.91	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/04/202401/04/202610.394	
Tasa Variable 9,002,598.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/04/202402/04/202610.394	
Tasa Variable 10,002,887.22	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/04/202401/04/202610.394	
Tasa Variable 10,002,887.22	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/04/202406/04/202610.394	
Tasa Variable 10,002,887.22	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/04/202407/04/202610.394	
Tasa Variable 14,004,042.11	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/04/202408/04/202610.394	
Tasa Variable 11,003,175.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/04/202420/01/20255.2274	
Tasa Variable 4,220,245.31	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/05/202429/01/20275.7275	
Tasa Variable 42,802,392.28	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/05/202429/04/202910.5129	
Tasa Variable 162,026,394.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/05/202405/05/202810.7063	
Tasa Variable 8,081,672.42	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/05/202422/01/202510.344	
Tasa Variable 10,213,084.40	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/05/202431/01/202510.344	
Tasa Variable 4,136,022.37	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/04/202420/04/20295.06026	
Tasa Variable 202,209,292.36	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/05/202430/04/203110.5129	
Tasa Variable 100,058,405.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202430/05/202910.42 Tasa Fija 35,353,787.38	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/06/202424/03/202810.4644	
Tasa Variable 6,287,632.02	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/06/202425/10/20289.23 Tasa Fija 96,235,220.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/06/202412/06/202810.6833	
Tasa Variable 12,614,780.97	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/06/202414/06/202910.7075	
Tasa Variable 4,234,321.22	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/06/202431/01/202510.344	
Tasa Variable 421,679.79	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202409/06/202510.5425	
Tasa Variable 10,067,354.86	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202410/06/202510.5388	
Tasa Variable 10,064,403.78	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202411/06/202510.536	
Tasa Variable 10,061,460.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/07/202411/06/20295.22195	
Tasa Variable 131,613,918.43	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/07/202430/06/20319.11 Tasa Fija 52,634,605.73	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/07/202430/04/203110.5129	
Tasa Variable 100,058,405.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/07/202411/07/20294.93 Tasa Fija 16,893,922.99	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/07/202429/06/202910.514	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 58 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Variable 20,005,841.11			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	25/07/2024	21/04/2025	11.42 Tasa Fija 12,274,079.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	30/07/2024	30/07/2029	10.5129
Tasa Variable 55,032,122.75			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	31/07/2024	26/02/2025	10.337
Tasa Variable 41,070,636.17			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	01/08/2024	27/01/2025	10.3422
Tasa Variable 2,002,872.83			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	02/08/2024	12/06/2028	10.6633
Tasa Variable 5,086,919.71			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	02/08/2024	29/01/2025	10.3429
Tasa Variable 9,005,171.45			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	05/08/2024	31/01/2025	10.344
Tasa Variable 9,002,586.00			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	06/08/2024	22/01/2025	10.3244
Tasa Variable 8,020,648.80			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	07/08/2024	17/01/2025	10.525
Tasa Variable 3,532,372.44			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	08/08/2024	08/08/2029	10.7125
Tasa Variable 10,336,932.74			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	08/08/2024	08/08/2029	10.7125
Tasa Variable 11,088,709.64			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	08/08/2024	08/08/2029	10.7125
Tasa Variable 14,283,761.61			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/08/2024	14/06/2029	10.6875
Tasa Variable 1,666,868.19			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/08/2024	23/01/2025	10.344
Tasa Variable 2,507,739.57			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	20/08/2024	14/02/2025	10.5375
Tasa Variable 4,018,733.33			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/08/2024	15/08/2028	10.6875
Tasa Variable 6,447,145.85			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/08/2024	31/07/2025	10.7476
Tasa Variable 50,925,487.78			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/08/2024	21/02/2025	10.3244
Tasa Variable 10,567,280.82			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/08/2024	21/02/2025	10.3244
Tasa Variable 4,538,423.00			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	28/08/2024	24/02/2025	10.3344
Tasa Variable 49,212,759.79			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	28/08/2024	24/02/2025	10.3344
Tasa Variable 5,662,975.41			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	28/08/2024	19/02/2025	10.515
Tasa Variable 1,003,797.08			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/08/2024	20/02/2025	10.525
Tasa Variable 1,003,508.33			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/08/2024	25/02/2025	10.337
Tasa Variable 54,844,325.13			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/08/2024	29/08/2029	10.514
Tasa Variable 1,585,259.85			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	30/08/2024	21/02/2025	10.3244
Tasa Variable 1,002,581.10			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	03/09/2024	28/02/2025	10.3429
Tasa Variable 44,275,426.30			
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	03/09/2024	29/08/2025	10.344

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 59 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/09/202403/03/202510.57 Tasa Variable 26,725,640.14	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/09/202403/03/202510.57 Tasa Variable 1,512,772.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/09/202414/06/202910.6875 Tasa Variable 2,368,318.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/09/202405/03/202510.5563 Tasa Variable 2,015,834.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/09/202408/08/202910.6925 Tasa Variable 9,397,092.30	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/09/202406/03/202510.55 Tasa Variable 2,015,238.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/09/202407/03/202510.5425 Tasa Variable 5,033,677.43	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/09/202407/03/202510.5425 Tasa Variable 2,013,470.97	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/09/202410/03/202510.5388 Tasa Variable 2,012,880.76	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202411/03/202510.536 Tasa Variable 2,012,292.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202407/03/202510.344 Tasa Variable 40,011,493.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202411/03/202510.536 Tasa Variable 3,521,511.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/09/202412/03/202510.5333 Tasa Variable 6,033,355.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/09/202421/02/202510.3244 Tasa Variable 5,012,905.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/09/202414/01/202510.5375 Tasa Variable 3,014,050.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202414/03/202510.5375 Tasa Variable 14,065,566.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202415/01/202510.5375 Tasa Variable 4,521,075.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202428/02/202510.344 Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202403/03/202510.344 Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202404/03/202510.344 Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202416/01/202510.5375 Tasa Variable 1,004,683.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202405/03/202510.344 Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202406/03/202510.344 Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202407/03/202510.344 Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202410/03/202510.344 Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202411/03/202510.344 Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202412/03/202510.344 Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202413/03/202510.344	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 60 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Variable 5,001,436.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202414/03/202510.344
Tasa Variable 5,001,436.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202416/01/202510.5375
Tasa Variable 5,525,758.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202418/03/202510.5188
Tasa Variable 2,008,181.29	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202431/07/202510.7476
Tasa Variable 25,462,743.89	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202417/01/202510.525
Tasa Variable 6,528,505.21	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202431/08/202910.514
Tasa Variable 132,633,963.26	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/09/202421/03/202510.3244
Tasa Variable 14,861,521.29	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/09/202421/01/202510.3244
Tasa Variable 6,516,777.15	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202422/01/202510.3244
Tasa Variable 6,516,777.15	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202421/03/202510.3244
Tasa Variable 501,290.55	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202407/03/202510.5425
Tasa Variable 503,367.74	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202425/09/202910.507
Tasa Variable 92,347,146.83	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202410/03/202510.5388
Tasa Variable 503,220.19	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202424/03/202510.3344
Tasa Variable 501,148.27	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202423/01/202510.3244
Tasa Variable 6,516,777.15	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202423/06/202510.51 Tasa Fija 20,052,550.00
Tasa Variable 500,861.42	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202425/03/202510.337
Tasa Variable 5,001,436.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202426/03/202510.344
Tasa Variable 5,001,436.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202424/01/202510.3344
Tasa Variable 6,013,779.20	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202411/03/202510.536
Tasa Variable 503,073.00	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202428/09/202910.5129
Tasa Variable 31,320,782.25	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202412/03/202510.5333
Tasa Variable 502,779.62	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202425/03/202510.337
Tasa Variable 500,861.42	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202428/03/202510.344
Tasa Variable 5,001,436.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202427/01/202510.3422
Tasa Variable 7,510,773.13	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202428/03/202510.344
Tasa Variable 100,028,733.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202428/03/202510.344
Tasa Variable 100,028,733.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202428/03/202510.344

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 61 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Variable	100,028,733.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	02/10/202413/03/202510.5333
Tasa Variable	502,779.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	02/10/202427/03/202510.3422
Tasa Variable	500,718.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	02/10/202431/03/20255.28878
Tasa Variable	48,037,726.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	03/10/202428/03/202510.3429
Tasa Variable	500,287.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	03/10/202414/03/202510.5375
Tasa Variable	502,341.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	03/10/202430/01/202510.3429
Tasa Variable	2,001,149.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	03/10/202401/04/202510.344
Tasa Variable	9,002,586.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	04/10/202431/03/202510.344
Tasa Variable	500,143.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	04/10/202418/03/202510.5188
Tasa Variable	502,045.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	04/10/202431/01/202510.344
Tasa Variable	3,000,862.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	04/10/202402/04/202510.344
Tasa Variable	10,002,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	04/10/202429/08/202510.344
Tasa Variable	5,001,436.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	04/10/202420/01/202510.344
Tasa Variable	2,500,718.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	04/10/202422/01/202510.344
Tasa Variable	2,500,718.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	04/10/202423/01/202510.344
Tasa Variable	2,500,718.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	04/10/202421/01/202510.344
Tasa Variable	2,500,718.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	07/10/202401/04/202510.575
Tasa Variable	504,406.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	07/10/202419/03/202510.515
Tasa Variable	501,898.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	07/10/202404/04/202510.5663
Tasa Variable	25,064,228.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	07/10/202404/02/202510.5663
Tasa Variable	3,444,745.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	07/10/202403/04/202510.344
Tasa Variable	10,002,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	07/10/202406/03/202510.55 Tasa
Variable	17,633,340.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	07/10/202403/01/202510.5425
Tasa Variable	20,134,709.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	07/10/202404/04/202510.344
Tasa Variable	10,002,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	08/10/202402/04/202510.575
Tasa Variable	504,406.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	08/10/202420/03/202510.525
Tasa Variable	501,754.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	08/10/202404/04/202510.344
Tasa Variable	4,481,755.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	08/10/202406/01/202510.344

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 62 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Variable 2,500,718.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/10/202424/01/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/10/202427/01/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/10/202428/01/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/10/202430/01/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/10/202406/03/202510.55 Tasa Variable 8,816,670.14	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/10/202403/04/202510.344	
Tasa Variable 10,002,873.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/10/202403/04/202510.57 Tasa Variable 504,257.36	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/10/202407/04/202510.5425	
Tasa Variable 503,367.74	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/10/202407/04/202510.344	
Tasa Variable 10,002,873.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/10/202407/04/202510.344	
Tasa Variable 4,001,149.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/10/202407/04/202510.55 Tasa Variable 8,816,670.14	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/10/202407/01/202510.5425	
Tasa Variable 20,134,709.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/10/202429/08/202510.344	
Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/10/202407/03/202510.5425	
Tasa Variable 7,047,148.40	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/10/202407/03/202510.5425	
Tasa Variable 35,235,742.01	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202404/04/202510.5663	
Tasa Variable 504,109.12	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202408/04/202510.5425	
Tasa Variable 503,367.74	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202429/08/202510.344	
Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202405/02/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202407/02/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202429/01/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202431/01/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202403/04/202510.57 Tasa Variable 20,170,294.44	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/10/202408/04/202510.344	
Tasa Variable 15,004,310.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/10/202409/04/202510.5425	
Tasa Variable 503,367.74	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/10/202409/01/202510.536	
Tasa Variable 20,122,920.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/10/202404/02/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/10/202406/02/202510.344	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 63 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Variable	2,500,718.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	14/10/202410/01/202510.5388
Tasa Variable	452,898.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	15/10/202413/01/202510.5333
Tasa Variable	402,223.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	15/10/202413/01/202510.5375
Tasa Variable	20,093,666.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	15/10/202411/04/202510.344
Tasa Variable	5,001,436.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	15/10/202407/03/202510.5375
Tasa Variable	7,032,783.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	16/10/202411/02/202510.344
Tasa Variable	2,500,718.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	16/10/202413/02/202510.344
Tasa Variable	2,500,718.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	17/10/202415/01/202510.344
Tasa Variable	2,500,718.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	17/10/202415/01/202510.525
Tasa Variable	20,087,708.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	18/10/202430/04/203110.5129
Tasa Variable	100,058,405.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	18/10/202415/01/202510.5375
Tasa Variable	452,107.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	18/10/202414/02/202510.344
Tasa Variable	4,001,149.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	18/10/202418/10/20295.47521
Tasa Variable	14,326,715.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	18/10/202414/02/202510.5375
Tasa Variable	1,004,683.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	18/10/202414/03/202510.344
Tasa Variable	3,612,943.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	18/10/202416/04/202510.344
Tasa Variable	4,001,149.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	18/10/202416/04/202510.344
Tasa Variable	3,000,862.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/10/202417/01/202510.525
Tasa Variable	2,762,059.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/10/202417/01/202510.525
Tasa Variable	10,043,854.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/10/202417/01/202510.3244
Tasa Variable	20,051,622.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/10/202403/10/202510.57 Tasa
Variable	3,025,544.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/10/202417/09/202510.525
Tasa Variable	6,026,312.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/10/202418/09/202510.5188
Tasa Variable	6,024,543.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/10/202407/03/202510.3244
Tasa Variable	7,018,067.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/10/202421/01/202510.344
Tasa Variable	2,500,718.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/10/202421/01/202510.3244
Tasa Variable	20,051,622.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/10/202421/01/202510.344
Tasa Variable	2,000,574.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/10/202420/02/202510.344

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 64 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Variable 10,002,873.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/10/202422/01/202510.344	
Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/10/202415/01/202510.5375	
Tasa Variable 502,341.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/10/202422/04/202510.3244	
Tasa Variable 4,010,324.40	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/10/202423/01/202510.337	
Tasa Variable 20,034,456.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/10/202423/04/202510.3244	
Tasa Variable 5,012,905.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/10/202425/04/202510.337	
Tasa Variable 10,017,228.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/10/202424/01/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/10/202428/03/202510.344	
Tasa Variable 20,005,746.68	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/10/202426/10/202910.507	
Tasa Variable 9,683,595.95	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/10/202423/04/202510.3244	
Tasa Variable 11,028,392.10	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202424/04/202510.3344	
Tasa Variable 5,011,482.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202415/01/202510.5375	
Tasa Variable 452,107.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202424/04/202510.3344	
Tasa Variable 15,034,448.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202425/04/202510.344	
Tasa Variable 1,100,316.07	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202416/04/202510.5375	
Tasa Variable 6,368,670.57	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202416/04/202510.5375	
Tasa Variable 6,368,670.57	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202425/04/202510.3429	
Tasa Variable 46,428,177.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/10/202425/04/202510.337	
Tasa Variable 5,008,614.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/10/202407/03/202510.3429	
Tasa Variable 7,004,022.24	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/10/202425/04/202510.337	
Tasa Variable 15,025,842.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/10/202427/02/202510.3422	
Tasa Variable 1,001,436.42	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/10/202427/02/202510.3422	
Tasa Variable 1,001,436.42	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/10/202427/02/202510.3422	
Tasa Variable 1,001,436.42	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202428/04/202510.3429	
Tasa Variable 5,002,873.03	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202429/01/202510.344	
Tasa Variable 20,005,746.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202429/01/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202428/01/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202424/04/202510.3422	

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 65 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Tasa Variable 1,833,117.10	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/10/202428/04/202510.3429	
Tasa Variable 15,008,619.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/11/202429/04/202510.3429	
Tasa Variable 5,002,873.03	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/11/202429/07/202510.78	Tasa
Fija 10,182,661.11	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/11/202430/04/202510.344	
Tasa Variable 95,627,469.07	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/11/202430/04/202510.3429	
Tasa Variable 15,008,619.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/11/202414/06/202910.6875	
Tasa Variable 1,467,360.01	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/11/202402/05/202510.575	
Tasa Variable 1,513,218.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/11/202415/01/202510.5375	
Tasa Variable 301,405.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/11/202402/05/20255.21265	
Tasa Variable 18,876,251.49	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/11/202402/05/20255.21429	
Tasa Variable 4,211,061.64	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/11/202402/05/202510.575	
Tasa Variable 15,132,187.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/11/202402/05/202510.55	Tasa
Variable 34,259,061.11	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/11/202402/05/202510.575	
Tasa Variable 7,061,687.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/11/202404/02/202510.55	Tasa
Variable 20,152,388.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/11/202405/05/202510.5563	
Tasa Variable 9,071,255.03	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/11/202422/01/202510.5425	
Tasa Variable 20,134,709.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/11/202428/04/202510.3429	
Tasa Variable 5,316,612.52	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/11/202407/05/20255.17252	
Tasa Variable 5,237,977.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/11/202402/01/20255.08265	
Tasa Variable 16,290,961.62	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/11/202406/02/202510.55	Tasa
Variable 2,015,238.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/11/202406/02/202510.55	Tasa
Variable 4,030,477.78	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/11/202406/02/202510.55	Tasa
Variable 4,705,582.81	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/11/202405/05/202510.5563	
Tasa Variable 1,511,875.84	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/11/202402/05/202510.575	
Tasa Variable 10,088,125.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/11/202407/02/202510.5425	
Tasa Variable 503,367.74	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/11/202407/03/202510.5333	
Tasa Variable 7,038,914.69	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/11/202402/05/202510.575	
Tasa Variable 7,485,816.49	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/11/202402/05/202510.575	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 66 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Variable	7,485,816.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/11/202402/05/202510.575
Tasa Variable	7,485,816.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	13/11/202410/01/202510.344
Tasa Variable	10,002,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	13/11/202411/04/202510.344
Tasa Variable	5,001,436.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	14/11/202402/05/202510.575
Tasa Variable	10,088,125.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	14/11/202403/01/20255.12265
Tasa Variable	20,972,046.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	14/11/202409/05/202510.5425
Tasa Variable	7,627,301.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	14/11/202409/05/202510.5425
Tasa Variable	7,627,301.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	15/11/202413/02/202510.5333
Tasa Variable	10,055,592.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	15/11/202414/04/202510.344
Tasa Variable	5,001,436.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	15/11/202415/11/202810.6875
Tasa Variable	491,908.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	15/11/202413/02/202510.5333
Tasa Variable	3,519,457.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	15/11/202413/02/202510.5333
Tasa Variable	3,519,457.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/11/202402/05/202510.575
Tasa Variable	10,088,125.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/11/202415/01/202510.5375
Tasa Variable	602,810.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/11/202415/01/202510.5375
Tasa Variable	401,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/11/202414/02/202510.5375
Tasa Variable	2,813,113.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/11/202414/02/202510.5375
Tasa Variable	3,717,328.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	20/11/202419/05/202510.515
Tasa Variable	1,003,797.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	20/11/202420/03/202510.344
Tasa Variable	9,502,729.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	20/11/202420/03/202510.344
Tasa Variable	11,003,160.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	20/11/202418/02/202510.5188
Tasa Variable	2,008,181.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	20/11/202416/04/202510.344
Tasa Variable	5,001,436.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202402/05/202510.575
Tasa Variable	10,088,125.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202420/05/202510.525
Tasa Variable	1,003,508.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202419/02/202510.515
Tasa Variable	2,007,594.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	21/11/202406/02/202510.3244
Tasa Variable	20,051,622.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/11/202415/01/202510.5375
Tasa Variable	401,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/11/202420/02/202510.525

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 67 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Variable	20,070,166.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/11/202421/05/202510.3244
Tasa Variable	1,002,581.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/11/202421/05/20254.89603
Tasa Variable	7,317,961.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/11/202420/06/202510.525
Tasa Variable	50,175,416.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/11/202420/02/202510.525
Tasa Variable	2,007,016.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	22/11/202407/03/202510.3244
Tasa Variable	6,015,486.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	25/11/202422/05/202510.3244
Tasa Variable	1,002,581.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	25/11/202402/05/202510.575
Tasa Variable	10,088,125.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	25/11/202421/02/202510.3244
Tasa Variable	2,005,162.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	25/11/202424/01/202510.344
Tasa Variable	14,004,022.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	26/11/202415/01/202510.5375
Tasa Variable	401,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	26/11/202423/05/202510.3244
Tasa Variable	1,002,581.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	26/11/202423/05/202510.3244
Tasa Variable	2,005,162.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	26/11/202424/02/202510.3344
Tasa Variable	2,004,593.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	26/11/202414/06/202910.6875
Tasa Variable	1,711,466.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/11/202426/05/202510.337
Tasa Variable	1,001,722.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/11/202402/05/202510.575
Tasa Variable	10,088,125.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/11/202426/05/202510.337
Tasa Variable	2,003,445.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/11/202425/02/202510.337
Tasa Variable	2,003,445.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	28/11/202427/05/202510.3422
Tasa Variable	500,718.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	28/11/202427/05/202510.3422
Tasa Variable	2,002,872.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	28/11/202426/06/202510.337
Tasa Variable	50,086,141.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	28/11/202426/02/202510.337
Tasa Variable	2,003,445.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	28/11/202402/05/202510.575
Tasa Variable	13,114,562.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/11/202428/05/202510.3429
Tasa Variable	2,001,149.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/11/202415/01/202510.5375
Tasa Variable	401,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/11/202407/03/202510.3429
Tasa Variable	6,003,447.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/11/202427/02/202510.3422
Tasa Variable	1,452,082.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	29/11/202402/05/202510.575

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 68 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Tasa Variable 10,088,125.00	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202402/05/202510.575
Tasa Variable 13,114,562.50	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202427/02/202510.3422
Tasa Variable 2,703,878.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202427/02/202510.3422
Tasa Variable 2,703,878.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202427/02/202510.3422
Tasa Variable 2,703,878.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202427/02/202510.3422
Tasa Variable 2,703,878.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202427/02/202510.3422
Tasa Variable 2,001,149.21	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/12/202430/05/202510.3429
Tasa Variable 10,088,125.00	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/12/202402/05/202510.575
Tasa Variable 5,002,873.03	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/12/202428/02/202510.3429
Tasa Variable 3,502,011.12	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/12/202428/02/202510.3429
Tasa Variable 10,085,147.22	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/12/202402/05/202510.57 Tasa Variable
Tasa Variable 5,001,436.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/12/202403/03/202510.344
Tasa Variable 5,001,436.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/12/202429/01/202510.344
Tasa Fija 31,052,318.64	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/12/202430/11/20299.84 Tasa Fija
Tasa Fija 16,556,727.04	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/12/202430/06/20319.76 Tasa Fija
Tasa Variable 5,001,436.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/12/202430/01/202510.344
Tasa Variable 401,873.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/12/202415/01/202510.5375
Tasa Variable 1,323,797.31	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/12/202414/06/202910.6875
Tasa Variable 7,902,269.93	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/12/202431/01/202510.344
Tasa Variable 41,011,780.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/12/202404/04/202510.344
Tasa Variable 452,107.50	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/12/202415/01/202510.5375
Tasa Variable 10,442,890.71	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/12/202430/01/20254.96701
Tasa Variable 1,000,287.32	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/12/202404/06/202510.344
Tasa Variable 3,000,861.99	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/12/202404/06/202510.344
Tasa Variable 10,442,867.53	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/12/202431/01/20254.88701
Tasa Variable 100,028,733.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/12/202414/03/202510.344
Tasa Variable 11,675,051.14	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/12/202404/02/20254.65701
Tasa Variable 1,550,510.11	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/12/202414/06/202910.6875
	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/12/202406/06/202510.536

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 69 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Variable 15,092,190.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/12/202405/02/20254.68701	
Tasa Variable 10,442,809.48	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/12/202411/03/202510.344	
Tasa Variable 2,500,718.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/12/202411/03/202510.344	
Tasa Variable 1,400,402.27	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/12/202413/03/202510.344	
Tasa Variable 1,400,402.27	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/12/202406/02/20254.46701	
Tasa Variable 10,442,745.58	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/12/202411/06/202510.525	
Tasa Variable 20,087,708.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/12/202415/01/202510.5375	
Tasa Variable 452,107.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/12/202411/06/202510.344	
Tasa Variable 20,005,746.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/12/202407/02/20254.79701	
Tasa Variable 10,442,841.43	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/12/202415/05/202510.344	
Tasa Variable 30,008,620.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/12/202412/03/202510.344	
Tasa Variable 1,400,402.27	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/12/202415/01/202510.525	
Tasa Variable 401,754.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/12/202410/02/20254.73701	
Tasa Variable 8,354,259.07	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/12/202414/03/202510.525	
Tasa Variable 4,017,541.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/12/202418/03/202510.344	
Tasa Variable 1,400,402.27	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/12/202411/02/20254.73701	
Tasa Variable 10,442,823.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/12/202416/04/202510.344	
Tasa Variable 20,005,746.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/12/202411/12/202510.344	
Tasa Variable 46,167,107.69	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202419/03/202510.344	
Tasa Variable 1,400,402.27	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202412/02/20254.67701	
Tasa Variable 11,675,057.62	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202417/06/202510.337	
Tasa Variable 20,075,348.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202416/01/202510.344	
Tasa Variable 20,005,746.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202419/12/20299.6 Tasa	
Fija 100,346,666.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202413/02/20254.67701	
Tasa Variable 10,442,806.55	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202415/01/202510.525	
Tasa Variable 401,403.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202416/04/202510.344	
Tasa Variable 5,001,436.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202418/06/202510.525	
Tasa Variable 20,070,166.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202418/06/202510.344	

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 70 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

Tasa Variable	20,005,746.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/12/202413/03/202510.344
Tasa Variable	100,028,733.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/12/202414/02/20254.66701
Tasa Variable	12,113,652.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/12/202420/06/202510.3244
Tasa Variable	49,126,473.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/12/202421/03/202510.344
Tasa Variable	7,502,155.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	24/12/202415/01/202510.3344
Tasa Variable	400,918.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	24/12/202418/02/20254.67701
Tasa Variable	11,487,087.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	24/12/202420/06/202510.3344
Tasa Variable	20,045,930.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	24/12/202424/12/202910.2344
Tasa Variable	5,890,877.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	26/12/202419/02/20254.66701
Tasa Variable	20,885,607.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	26/12/202420/06/202510.3422
Tasa Variable	20,028,728.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202427/03/202510.344
Tasa Variable	5,001,436.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202420/02/20254.66701
Tasa Variable	20,885,607.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202415/01/202510.3422
Tasa Variable	400,574.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202425/06/202510.344
Tasa Variable	15,004,310.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202425/06/202510.344
Tasa Variable	10,002,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202424/06/202510.3422
Tasa Variable	20,028,728.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202422/12/202510.3422
Tasa Variable	50,071,820.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202425/04/202510.344
Tasa Variable	4,901,407.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202425/06/202510.344
Tasa Variable	10,002,873.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/12/202424/06/202510.3429
Tasa Variable	20,011,492.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	30/12/202427/06/202510.3429
Tasa Variable	60,034,476.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	30/12/202421/02/20254.66701
Tasa Variable	20,885,607.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	30/12/202415/01/202510.3429
Tasa Variable	450,258.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	30/12/202426/09/20254.81466
Tasa Variable	588,879.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	30/12/202427/06/202510.3429
Tasa Variable	20,011,492.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	30/12/202424/12/202510.344
Tasa Variable	46,167,107.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	30/12/202429/04/202510.344
Tasa Variable	4,101,178.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	16/01/202016/01/202510.5375

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 71 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

---

Tasa Variable 1,190,735.85	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/03/202010/01/20254.79907	
Tasa Variable 4,119,973.35	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/03/202026/03/20256.76	Tasa
Fija 345,933.19	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/04/202004/04/202510.55	Tasa
Variable 1,007,619.43	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202027/03/20255.8	Tasa
Fija 646,655.10	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202027/03/20255.8	Tasa
Fija 1,877,908.53	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202027/03/20255.8	Tasa
Fija 1,518,224.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202007/05/202510.5425	
Tasa Variable 629,209.70	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/05/202027/03/20255.66	Tasa
Fija 2,029,610.60	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202020/06/202510.3244	
Tasa Variable 1,002,580.92	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202026/06/202510.337	
Tasa Variable 2,003,445.53	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/07/202027/03/202510.3422	
Tasa Variable 2,954,237.29	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/07/202027/03/202510.3429	
Tasa Variable 3,001,723.78	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/07/202027/03/202510.3422	
Tasa Variable 3,004,309.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/07/202027/03/202510.3422	
Tasa Variable 3,004,309.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/07/202021/07/20255.83	Tasa
Fija 40,180.81	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/07/202021/07/20255.83	Tasa
Fija 311,041.90	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/08/202025/08/202510.337	
Tasa Variable 3,816,086.91	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202019/09/202510.3244	
Tasa Variable 1,503,871.84	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202019/09/202510.3244	
Tasa Variable 1,503,871.84	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/10/202030/10/202510.3429	
Tasa Variable 40,499,448.36	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/11/202004/11/202510.5663	
Tasa Variable 34,115,198.09	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/02/202130/01/202610.575	
Tasa Variable 4,707,791.82	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/03/202107/02/202810.5425	
Tasa Variable 124,808,515.28	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/03/202107/02/202810.5425	
Tasa Variable 47,707,650.81	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/03/202110/03/202510.5388	
Tasa Variable 2,744,984.30	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/03/202131/03/202610.344	
Tasa Variable 2,625,754.29	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/04/202101/04/202610.5563	
Tasa Variable 37,628,909.86	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/04/202131/03/20266.12	Tasa

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 72 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Fija 909,312.46  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/04/202131/03/20266.12 Tasa  
 Fija 7,449,250.83  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/04/202115/04/202510.5375  
 Tasa Variable 188,378.10  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/04/202123/04/202610.3244  
 Tasa Variable 4,710,794.27  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202128/04/202610.3429  
 Tasa Variable 717,442.34  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202115/04/202510.5375  
 Tasa Variable 460,479.96  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/05/202120/05/202610.525  
 Tasa Variable 85,298,208.43  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/05/202130/04/20266.28 Tasa  
 Fija 4,905,617.45  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/05/202128/02/202510.8692  
 Tasa Variable 1,039,036.61  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202130/04/20266.28 Tasa  
 Fija 4,619,853.43  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202126/05/20266.14 Tasa  
 Fija 64,220,653.49  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202126/05/20266.14 Tasa  
 Fija 70,500,403.32  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202126/05/20266.14 Tasa  
 Fija 79,414,517.58  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/06/202115/05/202510.5375  
 Tasa Variable 209,308.95  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/06/202110/06/202510.5388  
 Tasa Variable 910,913.94  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/07/202109/07/20267.04 Tasa  
 Fija 1,551,374.54  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/07/202129/06/202610.3429  
 Tasa Variable 47,627,351.22  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/07/202131/12/202510.344  
 Tasa Variable 144,132,402.15  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/07/202131/12/202510.344  
 Tasa Variable 48,583,955.78  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/07/202129/07/202610.3429  
 Tasa Variable 5,703,275.27  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202123/04/202610.3244  
 Tasa Variable 681,755.07  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/09/202114/09/20266.57 Tasa  
 Fija 4,894,491.92  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/09/202115/07/202610.5375  
 Tasa Variable 200,638,275.71  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/09/202109/09/202610.5425  
 Tasa Variable 139,297,609.91  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/10/202114/09/20267.17 Tasa  
 Fija 2,584,453.32  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202129/10/20267.39 Tasa  
 Fija 20,004,105.57  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202129/10/20267.39 Tasa  
 Fija 20,004,105.57  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/11/202129/07/202610.3429  
 Tasa Variable 6,003,447.74  
 FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202120/12/20287.4 Tasa



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 73 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Fija 8,592,571.38

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202120/12/20287.4 Tasa  
Fija 23,089,958.05

FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANO31/05/202201/01/20258.23  
2,287,831.40

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/07/202403/01/202512.9395	Tasa Variable	2,268,440.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/07/202406/01/202512.9395	Tasa Variable	9,802.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/07/202406/01/202512.9395	Tasa Variable	962,238.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202406/01/202512.943	Tasa Variable	5,818.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202406/01/202512.9035	Tasa Variable	8,661.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202402/01/202512.9035	Tasa Variable	883,529.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/07/202408/01/202512.8348	Tasa Variable	1,231,430.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/07/202403/01/202512.8297	Tasa Variable	629,573.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/07/202410/01/202512.8297	Tasa Variable	1,470,200.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/07/202413/01/202512.8345	Tasa Variable	67,396.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202409/01/202512.8643	Tasa Variable	6,257,837.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202413/01/202512.8643	Tasa Variable	33,686.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202413/01/202512.9148	Tasa Variable	242,988.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202417/01/202512.9169	Tasa Variable	2,845,845.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/07/202420/01/202512.9192	Tasa Variable	55,719.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/07/202416/01/202512.9215	Tasa Variable	6,139,796.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/07/202420/01/202512.9215	Tasa Variable	92,437.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/07/202420/01/202512.8921	Tasa Variable	14,804.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202427/01/202512.9144	Tasa Variable	52,778.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202427/01/202512.9144	Tasa Variable	22,333.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202423/01/202512.8761	Tasa Variable	4,366,475.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202423/01/202512.8761	Tasa Variable	4,644,580.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202413/01/202512.8761	Tasa Variable	154,008.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202427/01/202512.7146	Tasa Variable	399,863.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/08/202431/01/202512.6917	Tasa Variable	174,085.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202431/01/202512.7424	Tasa Variable	3,373.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202404/02/202512.7424	Tasa Variable	2,729,021.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202431/01/202512.7424	Tasa Variable	15,815.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202404/02/202512.7424	Tasa Variable	200,870.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/08/202430/01/202512.7004	Tasa Variable	8,241,432.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/08/202430/01/202512.7004	Tasa Variable	2,327,623.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/08/202431/01/202512.6123	Tasa Variable	68,654.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/08/202406/01/202512.6123	Tasa Variable	9,446.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/08/202406/01/202512.6123	Tasa Variable	9,792.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/08/202406/01/202512.6123	Tasa Variable	7,661.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/08/202406/01/202512.5914	Tasa Variable	40,323.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/08/202407/02/202512.5851	Tasa Variable	965,051.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/08/202406/02/202512.5925	Tasa Variable	2,993,845.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/08/202406/02/202512.5925	Tasa Variable	5,666,337.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/08/202406/01/202512.5925	Tasa Variable	11,177.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202410/02/202512.6024	Tasa Variable	310,643.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202406/01/202512.6024	Tasa Variable	5,761.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202406/01/202512.5679	Tasa Variable	122,454.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202414/02/202512.5917	Tasa Variable	613,642.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202406/01/202512.5917	Tasa Variable	1,280,614.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202406/01/202512.5917	Tasa Variable	19,202.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202406/02/202512.5715	Tasa Variable	162,807.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202413/02/202512.5715	Tasa Variable	54,693.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202406/01/202512.5715	Tasa Variable	2,189.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202413/02/202512.5422	Tasa Variable	550,162.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202413/02/202512.5422	Tasa Variable	11,537,647.80

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 74 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202404/02/202512.5422	Tasa Variable	2,773.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202406/01/202512.5422	Tasa Variable	368,887.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202413/02/202512.5422	Tasa Variable	240,660.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202406/01/202512.5422	Tasa Variable	76,224.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/08/202406/01/202512.5079	Tasa Variable	86,137.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/08/202410/02/202512.5079	Tasa Variable	1,268,620.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/08/202411/02/202512.5603	Tasa Variable	396,439.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/08/202420/02/202512.5603	Tasa Variable	6,963,533.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/08/202420/02/202512.5603	Tasa Variable	416,282.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/09/202424/02/202512.0624	Tasa Variable	258,115.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/09/202424/02/202512.0194	Tasa Variable	1,169,783.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/09/202414/02/202512.0397	Tasa Variable	397,945.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/09/202403/03/202512.0032	Tasa Variable	348,531.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/09/202424/02/202512.0032	Tasa Variable	32,894.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/09/202402/01/202512.0625	Tasa Variable	287,307.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/09/202406/01/202512.0032	Tasa Variable	52,928.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/09/202427/02/202511.9674	Tasa Variable	8,809,338.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/09/202406/01/202511.9674	Tasa Variable	12,431.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/09/202406/01/202511.9674	Tasa Variable	56,159.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/09/202406/01/202512.0129	Tasa Variable	19,127.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/09/202406/01/202512.0129	Tasa Variable	452,765.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/09/202406/01/202512.0129	Tasa Variable	6,157.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/09/202403/03/202511.9105	Tasa Variable	235,459.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/09/202406/01/202511.9901	Tasa Variable	176,431.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/09/202406/01/202511.9901	Tasa Variable	129,916.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/09/202406/01/202511.9901	Tasa Variable	89,031.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/09/202407/03/202511.8986	Tasa Variable	1,559,682.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/09/202403/01/202511.9868	Tasa Variable	15,712.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/09/202403/03/202511.8986	Tasa Variable	755,614.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/09/202403/01/202511.9868	Tasa Variable	406,586.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/09/202406/01/202511.9868	Tasa Variable	627,779.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/09/202406/01/202511.9868	Tasa Variable	374,297.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/09/202403/03/202511.8986	Tasa Variable	3,464.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/09/202406/01/202511.9955	Tasa Variable	211,869.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/09/202411/03/202511.9026	Tasa Variable	55,489.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/09/202404/02/202511.9026	Tasa Variable	609,570.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/09/202408/01/202511.9955	Tasa Variable	92,393.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202407/01/202511.9906	Tasa Variable	132,865.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	3,181,327.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	161,269.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	72,529.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	16,117.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	610,483.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	173,122.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202411/03/202511.897	Tasa Variable	290.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202404/02/202511.897	Tasa Variable	2,595,495.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202404/02/202511.897	Tasa Variable	6,154.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202409/01/202511.9906	Tasa Variable	21,686.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	806,359.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202411/03/202511.897	Tasa Variable	20,353.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/09/202406/03/202511.897	Tasa Variable	7,018,308.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202407/01/202511.9745	Tasa Variable	615,802.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	174,108.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	357,695.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	670,579.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202404/02/202511.8759	Tasa Variable	43,319.36

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 75 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	244,576.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	72,474.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	50,405.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	3,821.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202414/03/202511.8759	Tasa Variable	551,009.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/09/202411/03/202511.8759	Tasa Variable	34,175.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/09/202406/01/202511.9343	Tasa Variable	99,558.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/09/202410/03/202511.8132	Tasa Variable	306,562.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/09/202406/01/20255.88149	Tasa Variable	130,721.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/09/202406/01/202511.9343	Tasa Variable	72,405.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/09/202406/01/202511.9343	Tasa Variable	141,602.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/09/202406/01/202511.9343	Tasa Variable	73,299.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/09/202406/02/202511.8132	Tasa Variable	33,574.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202410/01/202511.9175	Tasa Variable	663,206.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175	Tasa Variable	192,526.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175	Tasa Variable	1,402,584.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202414/03/202511.7859	Tasa Variable	826,048.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202418/03/202511.7859	Tasa Variable	41,171.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175	Tasa Variable	31,374.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175	Tasa Variable	138,947.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202418/03/202511.7859	Tasa Variable	53,677.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202404/02/202511.7859	Tasa Variable	9,692.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175	Tasa Variable	138,175.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202418/03/202511.7859	Tasa Variable	17,421.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202404/02/202511.7859	Tasa Variable	1,290,809.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/09/202404/02/202511.7859	Tasa Variable	112,635.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	348,069.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202413/01/202511.8917	Tasa Variable	524,144.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	41,668.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	42,334.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202404/02/202511.7533	Tasa Variable	45,158.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202413/01/202511.8917	Tasa Variable	2,309,103.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	31,824.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202413/01/202511.8917	Tasa Variable	2,837.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	612,854.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	322,038.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	65,453.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202404/02/202511.7533	Tasa Variable	933,524.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	66,840.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	173,771.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	115,305.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202413/01/202511.8698	Tasa Variable	92,470.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	3,869.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	255,746.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	107,007.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	381,557.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202412/03/202511.7195	Tasa Variable	356,972.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/02/202511.7195	Tasa Variable	119,541.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202410/01/202511.7766	Tasa Variable	13,192.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202406/01/202511.7766	Tasa Variable	1,013,148.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202406/01/202511.7766	Tasa Variable	544,920.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202406/01/202511.7766	Tasa Variable	21,447.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202418/03/202511.6386	Tasa Variable	713.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202413/01/202511.7766	Tasa Variable	172,484.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202406/01/202511.7766	Tasa Variable	666,205.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202413/01/20255.73369	Tasa Variable	13,943.09

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 76 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	22,176.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	48,012.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	473,021.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202418/03/202511.607	Tasa Variable	6,573.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202405/03/202511.607	Tasa Variable	315,216.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/02/202511.607	Tasa Variable	43,354.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202413/01/202511.7509	Tasa Variable	51.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	738,071.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	1,606.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202421/03/202511.607	Tasa Variable	2,429,664.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202413/03/202511.607	Tasa Variable	444,847.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202413/03/202511.607	Tasa Variable	6,619,127.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/02/202511.607	Tasa Variable	2,249,077.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	2,627.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	2,027.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	1,323.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/02/202511.607	Tasa Variable	18,302.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/03/202511.607	Tasa Variable	549,646.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202406/01/202511.7179	Tasa Variable	68,562.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202406/01/202511.7179	Tasa Variable	241,227.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202406/01/202511.7179	Tasa Variable	57,210.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202404/02/202511.5576	Tasa Variable	49,749.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202425/03/202511.5576	Tasa Variable	18,353.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	10,535.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	1,530,548.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	80,330.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202420/03/202511.5739	Tasa Variable	6,228,642.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202417/01/202511.7292	Tasa Variable	99,765.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202420/01/202511.7292	Tasa Variable	772,852.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	149,109.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	152,178.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202404/02/202511.5739	Tasa Variable	195,347.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202420/01/202511.7292	Tasa Variable	1,621,253.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	42,555.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202404/02/202511.5739	Tasa Variable	54,663.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202420/01/202511.7831	Tasa Variable	34,316.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831	Tasa Variable	59,391.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202420/01/202511.7831	Tasa Variable	793,858.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831	Tasa Variable	781,057.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202417/01/202511.7831	Tasa Variable	639,179.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831	Tasa Variable	131,670.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831	Tasa Variable	10,945.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202428/03/202511.6369	Tasa Variable	2,747,170.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202425/03/202511.6369	Tasa Variable	7,899.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831	Tasa Variable	80,375.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831	Tasa Variable	79,832.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202406/01/202512.2352	Tasa Variable	214,657.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202425/03/202512.0907	Tasa Variable	11,346.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202420/01/202512.2352	Tasa Variable	158,061.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202406/01/202512.2352	Tasa Variable	255,411.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202420/01/202512.2352	Tasa Variable	32,004.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202406/01/202512.2352	Tasa Variable	471,374.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202420/01/202512.2352	Tasa Variable	37,796.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202409/01/202512.2352	Tasa Variable	3,092,783.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202406/01/202512.2352	Tasa Variable	569,017.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/10/202406/01/202512.2352	Tasa Variable	129,279.74

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 77 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/10/202420/01/20255.68402	Tasa Variable	142,137.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/10/202420/01/202512.243	Tasa Variable	62,914.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/10/202406/01/202512.243	Tasa Variable	28,563.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/10/202431/03/202512.1013	Tasa Variable	2,680,277.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/10/202406/01/202512.243	Tasa Variable	83,879.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/10/202406/01/202512.243	Tasa Variable	539,324.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/10/202406/01/202512.243	Tasa Variable	674,174.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/10/202406/01/202512.243	Tasa Variable	651,291.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/10/202404/02/202512.1013	Tasa Variable	3,992.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202420/01/20255.68262	Tasa Variable	271,331.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202406/01/202511.7364	Tasa Variable	593,089.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202401/04/202511.598	Tasa Variable	3,508.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202404/02/202511.598	Tasa Variable	43,280.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202427/01/202511.7364	Tasa Variable	756,588.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202406/01/202511.7364	Tasa Variable	58,702.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202406/01/202511.7364	Tasa Variable	620,541.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202427/03/202511.598	Tasa Variable	805,116.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202424/01/202511.7364	Tasa Variable	1,530,610.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202427/01/202511.7364	Tasa Variable	659,837.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202427/01/202511.7364	Tasa Variable	559,789.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202427/03/202511.598	Tasa Variable	5,064,921.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/10/202404/02/202511.598	Tasa Variable	1,728,696.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202427/01/202511.7399	Tasa Variable	650,874.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202404/02/202511.7399	Tasa Variable	106,377.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202427/01/202511.7399	Tasa Variable	357,362.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202406/01/202511.7399	Tasa Variable	353,616.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202406/01/202511.7399	Tasa Variable	41,100.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202401/04/202511.6064	Tasa Variable	11,167.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202427/03/202511.6064	Tasa Variable	1,981,591.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202424/01/202511.7399	Tasa Variable	548,132.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202406/01/202511.7399	Tasa Variable	309,091.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202406/01/202511.7399	Tasa Variable	352,450.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202404/02/202511.7399	Tasa Variable	22,764.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202406/01/202511.7399	Tasa Variable	30,978.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/10/202420/03/202511.6064	Tasa Variable	271,413.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/10/202406/01/202511.7852	Tasa Variable	246,290.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/10/202406/01/202511.7852	Tasa Variable	114,805.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/10/202406/01/202511.7852	Tasa Variable	16,175.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/10/202427/01/20255.68099	Tasa Variable	52,447.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/10/202406/01/202511.7852	Tasa Variable	12,884.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/10/202401/04/202511.6743	Tasa Variable	69,557.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/10/202427/01/20255.79184	Tasa Variable	12,586.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/10/202413/01/202511.8067	Tasa Variable	37,269.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/10/202406/01/202511.8067	Tasa Variable	68,937.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/10/202407/04/202511.7226	Tasa Variable	242.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/10/202404/03/202511.7226	Tasa Variable	6,778.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/10/202404/03/202511.7226	Tasa Variable	29,373.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/10/202406/01/202511.8067	Tasa Variable	107,440.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/10/202407/04/202511.7226	Tasa Variable	23,682.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202424/01/202511.7856	Tasa Variable	1,308,364.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202406/01/202511.7856	Tasa Variable	2,244.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202404/02/202511.7856	Tasa Variable	672,481.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202404/02/202511.7856	Tasa Variable	95,496.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202406/01/202511.7856	Tasa Variable	77,730.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202431/03/202511.691	Tasa Variable	1,632,376.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202420/01/20255.8682	Tasa Variable	47,203.50

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 78 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202406/01/202511.7856	Tasa Variable	206,372.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202406/01/202511.7856	Tasa Variable	286,302.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202404/03/202511.691	Tasa Variable	96,040.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202404/02/202511.7856	Tasa Variable	94,388.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/10/202407/04/202511.691	Tasa Variable	27,636.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202404/02/202511.7989	Tasa Variable	107,626.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202406/01/202511.7989	Tasa Variable	129,748.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202404/02/202511.7989	Tasa Variable	27,611.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202403/04/202511.7074	Tasa Variable	9,331,197.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202403/04/202511.7074	Tasa Variable	882,903.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202404/03/202511.7074	Tasa Variable	58,417.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202404/02/202511.7989	Tasa Variable	651,868.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202409/01/202511.7989	Tasa Variable	685.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202406/01/202511.7989	Tasa Variable	345,099.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/10/202404/03/202511.7074	Tasa Variable	9,604.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202404/02/202511.8076	Tasa Variable	813,918.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202406/01/202511.8076	Tasa Variable	2,540.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202404/02/202511.8076	Tasa Variable	719,969.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202404/02/202511.8076	Tasa Variable	557,109.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202424/01/202511.8076	Tasa Variable	87,134.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202406/01/202511.8076	Tasa Variable	6,010.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202404/02/202511.8076	Tasa Variable	284,138.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202404/03/202511.712	Tasa Variable	54,245.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202406/01/202511.8076	Tasa Variable	64,622.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/10/202404/03/202511.712	Tasa Variable	44,147.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202406/01/202511.7874	Tasa Variable	58,312.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202404/02/202511.7874	Tasa Variable	1,578,149.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202406/01/202511.7874	Tasa Variable	36,211.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202411/04/202511.6871	Tasa Variable	2,779,487.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202401/04/202511.6871	Tasa Variable	900.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202404/03/202511.6871	Tasa Variable	46,735.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202404/03/202511.6871	Tasa Variable	4,207,602.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202404/02/20255.84358	Tasa Variable	314,610.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202427/01/202511.7877	Tasa Variable	53,390.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202404/02/202511.7877	Tasa Variable	113,333.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202404/02/202511.7877	Tasa Variable	466,203.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202424/03/202511.6871	Tasa Variable	995,611.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202404/03/202511.6871	Tasa Variable	22,040.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202404/02/202511.7877	Tasa Variable	68,621.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202406/01/202511.7877	Tasa Variable	230,719.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202406/01/202511.7877	Tasa Variable	710,292.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202406/01/202511.7877	Tasa Variable	23,203.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/10/202404/03/202511.6871	Tasa Variable	20,345.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202410/01/20255.84745	Tasa Variable	43,047.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202407/02/202511.8127	Tasa Variable	395,185.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202404/02/202511.8127	Tasa Variable	242,779.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202404/03/202511.7258	Tasa Variable	115,298.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202431/01/202511.8127	Tasa Variable	97,124.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202407/02/202511.8127	Tasa Variable	19,500.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202420/01/202511.8127	Tasa Variable	15,595.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202404/02/202511.8127	Tasa Variable	215,812.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202404/02/202511.8127	Tasa Variable	122,372.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202406/01/202511.8127	Tasa Variable	21,231.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/10/202404/04/202511.7258	Tasa Variable	1,038,786.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202404/02/202511.7874	Tasa Variable	320,227.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202404/02/202511.7874	Tasa Variable	55,789.46

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 79 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/10/202404/02/202511.7874	Tasa Variable	868,943.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202404/02/202511.8404	Tasa Variable	227,605.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202404/02/202511.8404	Tasa Variable	600,656.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202404/02/202511.8404	Tasa Variable	227,133.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202404/02/202511.8404	Tasa Variable	5,316.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202414/04/202511.7758	Tasa Variable	9,152.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202410/04/202511.7758	Tasa Variable	2,010,435.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202410/04/202511.7758	Tasa Variable	6,502,125.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202404/03/202511.7758	Tasa Variable	2,379,207.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202404/03/202511.7758	Tasa Variable	29,385.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202410/02/202511.8404	Tasa Variable	1,217,832.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202404/02/202511.8404	Tasa Variable	1,022,969.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202410/02/202511.8404	Tasa Variable	812,651.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202404/02/202511.8404	Tasa Variable	713,986.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202404/02/202511.8404	Tasa Variable	65,950.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/10/202413/01/202511.8404	Tasa Variable	360,222.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202410/02/202511.8205	Tasa Variable	3,179,233.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202404/02/202511.8205	Tasa Variable	2,356,907.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202404/02/202511.8205	Tasa Variable	956,335.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202404/02/202511.8205	Tasa Variable	4,295.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202413/01/202511.8205	Tasa Variable	62,973.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202404/02/202511.8205	Tasa Variable	50,263.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202404/02/202511.8205	Tasa Variable	42,315.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202404/02/202511.8205	Tasa Variable	13,695.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202414/04/202511.7506	Tasa Variable	16,582.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202404/03/202511.7506	Tasa Variable	44,653.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/10/202404/03/202511.7506	Tasa Variable	50,655.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202410/02/20255.84371	Tasa Variable	338,935.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202404/02/202511.7768	Tasa Variable	372,904.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202406/01/202511.7768	Tasa Variable	168,606.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202413/01/202511.7768	Tasa Variable	223.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202404/03/202511.7283	Tasa Variable	24,872.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202404/02/202511.7768	Tasa Variable	94,561.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202404/02/202511.7768	Tasa Variable	249,306.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202404/02/202511.7768	Tasa Variable	35,055.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202404/02/202511.7768	Tasa Variable	55,217.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/10/202404/02/202511.7768	Tasa Variable	45,167.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/10/202427/01/20255.83756	Tasa Variable	559,844.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/10/202407/02/202511.8083	Tasa Variable	220,392.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/10/202404/02/202511.8083	Tasa Variable	290,886.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/10/202420/01/202511.8083	Tasa Variable	1,266,873.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/10/202404/02/202511.8083	Tasa Variable	119,783.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/10/202404/02/202511.8083	Tasa Variable	906,638.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/10/202408/04/202511.7897	Tasa Variable	131,106.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/10/202404/03/202511.7897	Tasa Variable	5,162,148.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/10/202406/01/202511.8138	Tasa Variable	109,068.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/10/202421/04/202511.7941	Tasa Variable	22,289.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/10/202427/01/202511.8138	Tasa Variable	540,774.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/10/202404/02/202511.8138	Tasa Variable	467,637.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/10/202406/01/202511.8138	Tasa Variable	42,205.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/10/202404/02/202511.8138	Tasa Variable	151,028.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/10/202404/03/202511.7941	Tasa Variable	164,768.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202413/01/202511.8032	Tasa Variable	13,326.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202404/02/202511.8032	Tasa Variable	111,649.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202404/02/202511.8032	Tasa Variable	252,927.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202410/04/202511.785	Tasa Variable	4,168,938.91

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 80 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202404/03/202511.785	Tasa Variable	603,371.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202404/03/202511.785	Tasa Variable	36,746.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202417/01/202511.8032	Tasa Variable	28,674.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202417/02/202511.8032	Tasa Variable	960,268.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202404/02/202511.8032	Tasa Variable	130,701.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202420/01/202511.8032	Tasa Variable	25,380.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202417/02/202511.8032	Tasa Variable	835,572.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202404/02/202511.8032	Tasa Variable	760,154.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202406/01/202511.8032	Tasa Variable	2,627.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202404/02/202511.8032	Tasa Variable	393,796.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202406/01/202511.8032	Tasa Variable	3,139.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202406/01/202511.8032	Tasa Variable	4,273.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202416/04/202511.785	Tasa Variable	3,311,583.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202421/04/202511.785	Tasa Variable	44,291.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202404/03/202511.785	Tasa Variable	34,425.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/10/202404/03/202511.785	Tasa Variable	280,083.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202420/01/20255.81721	Tasa Variable	134,971.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202417/01/202511.783	Tasa Variable	32,180.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202417/02/202511.783	Tasa Variable	1,948,419.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202406/01/202511.783	Tasa Variable	4,283.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202404/02/202511.783	Tasa Variable	2,318,953.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202404/02/202511.783	Tasa Variable	158,573.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202420/01/202511.783	Tasa Variable	317,724.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202417/01/202511.783	Tasa Variable	179,103.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202404/02/202511.783	Tasa Variable	220,779.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202404/02/202511.783	Tasa Variable	235,805.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202404/03/202511.7558	Tasa Variable	277,748.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202417/02/202511.783	Tasa Variable	111,534.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202406/01/202511.783	Tasa Variable	112,304.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/10/202406/01/202511.783	Tasa Variable	108,718.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202417/02/20255.83072	Tasa Variable	239,337.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202417/01/202511.733	Tasa Variable	110,307.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202420/01/202511.733	Tasa Variable	42,206.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202427/03/202511.7109	Tasa Variable	115,698.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202417/02/202511.733	Tasa Variable	422,278.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202404/02/202511.733	Tasa Variable	28,385.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202404/02/202511.733	Tasa Variable	230,770.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202404/02/202511.733	Tasa Variable	128,492.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202404/02/202511.733	Tasa Variable	65,024.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202404/03/202511.7109	Tasa Variable	57,210.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202404/03/202511.7109	Tasa Variable	49,851.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202404/03/202511.7109	Tasa Variable	126,255.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/10/202404/03/202511.7109	Tasa Variable	20,761.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/10/202420/01/202511.744	Tasa Variable	100,751.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/10/202425/04/202511.7256	Tasa Variable	2,383,892.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/10/202415/04/202511.7256	Tasa Variable	678,265.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/10/202404/03/202511.7256	Tasa Variable	89,274.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/10/202404/02/202511.744	Tasa Variable	43,015.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202417/01/202511.7481	Tasa Variable	18,863.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202404/02/202511.7481	Tasa Variable	289,980.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202428/04/202511.7276	Tasa Variable	69,024.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202404/02/202511.7481	Tasa Variable	8,745.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202404/02/202511.7481	Tasa Variable	4,080.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202404/02/202511.7481	Tasa Variable	32,441.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202404/03/202511.7276	Tasa Variable	3,924,333.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202404/03/202511.7276	Tasa Variable	103,997.21



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 81 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202404/02/202511.7481	Tasa Variable	23,150.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/10/202428/04/202511.7276	Tasa Variable	26,515.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202417/01/20255.77106	Tasa Variable	43,026.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202406/01/202511.7841	Tasa Variable	210,762.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202404/02/202511.7841	Tasa Variable	2,755,113.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202404/02/202511.7841	Tasa Variable	338,734.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202404/02/202511.7841	Tasa Variable	181,759.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202424/04/202511.7549	Tasa Variable	9,565,395.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202404/03/202511.7549	Tasa Variable	107,773.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202404/03/202511.7549	Tasa Variable	41,588.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202427/01/202511.7841	Tasa Variable	358,615.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202414/02/202511.7841	Tasa Variable	189,654.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202424/02/202511.7841	Tasa Variable	591,909.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202404/02/202511.7841	Tasa Variable	13,197.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202419/02/202511.7841	Tasa Variable	2,346,311.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202404/02/202511.7841	Tasa Variable	36,611.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/11/202404/02/202511.7841	Tasa Variable	112,694.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202404/02/202511.7753	Tasa Variable	558,469.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202404/02/202511.7753	Tasa Variable	149,678.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202404/02/202511.7753	Tasa Variable	217,695.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202413/01/202511.7753	Tasa Variable	265,693.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202427/01/202511.7753	Tasa Variable	1,386,187.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202427/01/202511.7753	Tasa Variable	1,276.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202429/01/202511.7753	Tasa Variable	12,699,432.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202427/01/202511.7753	Tasa Variable	156,403.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202424/02/202511.7753	Tasa Variable	940,112.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202404/02/202511.7753	Tasa Variable	52,218.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202424/02/202511.7753	Tasa Variable	1,004,001.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202406/01/202511.7753	Tasa Variable	157,792.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202415/01/202511.7753	Tasa Variable	360,036.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/11/202419/02/202511.7753	Tasa Variable	668,129.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202420/01/202511.784	Tasa Variable	95,332.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202404/02/202511.784	Tasa Variable	29,931.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202404/02/202511.784	Tasa Variable	54,785.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202404/02/202511.784	Tasa Variable	66,172.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202419/02/202511.784	Tasa Variable	705,485.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202404/02/202511.784	Tasa Variable	498,779.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202404/02/202511.784	Tasa Variable	90,547.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202417/02/202511.784	Tasa Variable	17,822.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202419/02/202511.784	Tasa Variable	310,042.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202404/02/202511.784	Tasa Variable	37,651.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/11/202404/02/202511.784	Tasa Variable	20,715.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/11/202424/01/202511.7664	Tasa Variable	9,617.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/11/202427/01/202511.7664	Tasa Variable	42,333.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/11/202424/01/202511.7664	Tasa Variable	74,871.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/11/202404/02/202511.7664	Tasa Variable	143,161.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/11/202404/02/202511.7664	Tasa Variable	3,251.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/11/202404/02/202511.7664	Tasa Variable	65,867.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202424/02/20255.7803	Tasa Variable	77,038.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202424/01/202511.7392	Tasa Variable	627,031.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202424/02/202511.7392	Tasa Variable	149,783.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202426/02/202511.7392	Tasa Variable	183,458.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202405/05/202511.721	Tasa Variable	116,795.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202405/05/202511.721	Tasa Variable	1,169,001.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202404/02/202511.7392	Tasa Variable	97,303.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202404/03/202511.7392	Tasa Variable	4,334,628.31

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 82 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202404/03/202511.7392	Tasa Variable	21,933.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202405/05/202511.721	Tasa Variable	1,667.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202404/02/202511.7392	Tasa Variable	37,477.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202404/03/202511.7392	Tasa Variable	18,257.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202404/03/202511.7392	Tasa Variable	8,843.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/11/202404/03/202511.7392	Tasa Variable	24,963.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202424/02/20255.79641	Tasa Variable	38,239.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202410/02/202511.7025	Tasa Variable	42,647.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202426/02/202511.7025	Tasa Variable	69,779.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202402/05/202511.6631	Tasa Variable	826,582.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202404/02/202511.7025	Tasa Variable	674,589.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202404/02/202511.7025	Tasa Variable	181,708.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202404/02/202511.7025	Tasa Variable	360.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202403/03/202511.7025	Tasa Variable	1,146,078.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202426/02/202511.7025	Tasa Variable	181,938.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202403/03/202511.7025	Tasa Variable	170,534.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202404/03/202511.7025	Tasa Variable	399,869.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202404/03/202511.7025	Tasa Variable	39,546.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202402/05/202511.6631	Tasa Variable	5,039,628.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/11/202404/04/202511.6631	Tasa Variable	54,537.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202406/01/202511.7655	Tasa Variable	329,729.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202406/01/202511.7655	Tasa Variable	56,327.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202406/01/202511.7655	Tasa Variable	1,833,076.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202406/01/202511.7655	Tasa Variable	214,426.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202406/01/202511.7655	Tasa Variable	42.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/02/202511.6684	Tasa Variable	46,491.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202429/01/202511.6684	Tasa Variable	45,650.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/02/202511.6684	Tasa Variable	37,596.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/02/202511.6684	Tasa Variable	16,900.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/02/202511.6684	Tasa Variable	107,353.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202407/03/202511.6684	Tasa Variable	49,952.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/03/202511.6684	Tasa Variable	2,827.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202426/02/202511.6684	Tasa Variable	2,441,261.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202403/03/202511.6684	Tasa Variable	305,345.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/03/202511.6684	Tasa Variable	378,228.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/03/202511.6684	Tasa Variable	137,304.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202402/05/202511.6205	Tasa Variable	1,737,364.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202403/01/202511.7655	Tasa Variable	1,338,564.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202406/01/202511.7655	Tasa Variable	287,084.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/02/202511.6684	Tasa Variable	11,057.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/03/202511.6684	Tasa Variable	87,863.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202424/04/202511.6205	Tasa Variable	326,972.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/02/202511.6684	Tasa Variable	251,621.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/02/202511.6684	Tasa Variable	34,104.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/11/202404/02/202511.6684	Tasa Variable	197,492.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/11/202404/02/202511.6623	Tasa Variable	12,053.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/11/202404/03/202511.6623	Tasa Variable	42,600.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/11/202409/05/202511.6162	Tasa Variable	1,033,853.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/11/202404/02/202511.6623	Tasa Variable	34,401.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/11/202404/03/202511.6623	Tasa Variable	33,145.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/11/202405/02/202511.6623	Tasa Variable	349,888.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/11/202419/02/202511.6623	Tasa Variable	132,731.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202406/01/20255.71617	Tasa Variable	114,940.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202406/01/20255.71617	Tasa Variable	26,742.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202403/03/20255.80107	Tasa Variable	1,210,112.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202406/01/202511.7721	Tasa Variable	177,313.78

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 83 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202415/01/202511.6716	Tasa Variable	1,779,713.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202405/03/202511.6716	Tasa Variable	2,916,528.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202405/05/202511.6155	Tasa Variable	3,430.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202406/05/202511.6155	Tasa Variable	1,054,908.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202404/03/202511.6716	Tasa Variable	26,478.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202405/03/202511.6716	Tasa Variable	435,755.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202404/03/202511.6716	Tasa Variable	124,300.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202404/04/202511.6155	Tasa Variable	9,839.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202404/04/202511.6155	Tasa Variable	13,312.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202406/01/202511.7721	Tasa Variable	285,167.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202406/01/202511.7721	Tasa Variable	595,945.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202406/01/202511.7721	Tasa Variable	44,732.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202404/02/202511.6716	Tasa Variable	6,224.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202405/03/202511.6716	Tasa Variable	809,395.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/11/202404/04/202511.6155	Tasa Variable	34,660.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202403/01/202511.7671	Tasa Variable	177,770.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202407/02/202511.6738	Tasa Variable	177,045.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202404/02/202511.6738	Tasa Variable	2,346.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202407/03/202511.6738	Tasa Variable	427,095.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202405/03/202511.6738	Tasa Variable	328,277.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202405/03/202511.6738	Tasa Variable	15,182.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202409/05/202511.6256	Tasa Variable	141,154.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202404/04/202511.6256	Tasa Variable	1,890,531.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202403/01/202511.7671	Tasa Variable	286,930.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202406/01/202511.7671	Tasa Variable	815,370.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202404/02/202511.6738	Tasa Variable	4,914.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202412/02/202511.6738	Tasa Variable	1,467,085.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202404/03/202511.6738	Tasa Variable	1,971,548.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202404/03/202511.6738	Tasa Variable	411,986.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202405/03/202511.6738	Tasa Variable	748,069.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202412/05/202511.6256	Tasa Variable	3,160.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202407/02/202511.6738	Tasa Variable	509,150.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202429/01/202511.6738	Tasa Variable	2,848,979.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202428/02/202511.6738	Tasa Variable	1,409,119.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202405/03/202511.6738	Tasa Variable	6,370.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO14/11/202405/03/202511.6738	Tasa Variable	2,363.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202403/01/202511.7501	Tasa Variable	417,054.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202413/01/202511.7501	Tasa Variable	22,145.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202406/01/202511.7501	Tasa Variable	14,009.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/02/202511.655	Tasa Variable	36,075.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202412/02/202511.655	Tasa Variable	190,833.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202424/02/202511.655	Tasa Variable	4,855.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202405/03/202511.655	Tasa Variable	183,753.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/03/202511.655	Tasa Variable	86,613.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/03/202511.655	Tasa Variable	185,642.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202426/02/202511.655	Tasa Variable	922,138.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202408/05/202511.6106	Tasa Variable	3,838,623.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/04/202511.6106	Tasa Variable	1,224,747.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202406/01/202511.7501	Tasa Variable	617,230.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202410/02/202511.655	Tasa Variable	699,019.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/02/202511.655	Tasa Variable	3,794.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/02/202511.655	Tasa Variable	148,488.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/02/202511.655	Tasa Variable	662,478.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/02/202511.655	Tasa Variable	35,709.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/02/202511.655	Tasa Variable	1,924.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202412/02/202511.655	Tasa Variable	91,676.23

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 84 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202410/03/202511.655	Tasa Variable	1,533,240.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/03/202511.655	Tasa Variable	95,872.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202405/03/202511.655	Tasa Variable	112,485.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202410/03/202511.655	Tasa Variable	748,104.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/03/202511.655	Tasa Variable	564,932.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/03/202511.655	Tasa Variable	75,700.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202405/03/202511.655	Tasa Variable	5,663,835.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202408/05/202511.6106	Tasa Variable	5,295,197.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/11/202404/04/202511.6106	Tasa Variable	49,202.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202410/01/202511.7521	Tasa Variable	6,212,950.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202413/01/202511.7521	Tasa Variable	2,309.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202413/01/202511.7521	Tasa Variable	578,816.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202413/01/202511.7521	Tasa Variable	137,864.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202410/02/202511.6263	Tasa Variable	4,060.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202405/02/202511.6263	Tasa Variable	137,228.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202410/02/202511.6263	Tasa Variable	55,624.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/03/202511.6263	Tasa Variable	82,089.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202410/03/202511.6263	Tasa Variable	144,782.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/03/202511.6263	Tasa Variable	153,469.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/03/202511.6263	Tasa Variable	238,603.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202413/01/202511.7521	Tasa Variable	375,925.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202413/01/202511.7521	Tasa Variable	568,522.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202410/02/202511.6263	Tasa Variable	309,995.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/02/202511.6263	Tasa Variable	320,170.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202420/01/202511.6263	Tasa Variable	25,180.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/02/202511.6263	Tasa Variable	107,194.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/03/202511.6263	Tasa Variable	70,522.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/03/202511.6263	Tasa Variable	128,363.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/04/202511.5628	Tasa Variable	3,607,432.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202410/01/202511.7521	Tasa Variable	5,225,757.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202410/02/202511.6263	Tasa Variable	429,454.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202410/03/202511.6263	Tasa Variable	533,728.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202403/01/202511.7521	Tasa Variable	857,871.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202402/01/202511.7521	Tasa Variable	63,841.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202429/01/202511.6263	Tasa Variable	62,317.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/02/202511.6263	Tasa Variable	108,057.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202412/02/202511.6263	Tasa Variable	46,812.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202404/03/202511.6263	Tasa Variable	33,134.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/11/202426/02/202511.6263	Tasa Variable	47,472.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202413/01/20255.721	Tasa Variable	365,992.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202406/01/202511.6202	Tasa Variable	457,118.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202406/01/202511.6202	Tasa Variable	37,621.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202407/02/202511.5825	Tasa Variable	440,481.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/02/202511.5825	Tasa Variable	19,899.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/02/202511.5825	Tasa Variable	1,784,452.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202403/03/202511.5825	Tasa Variable	583,125.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/03/202511.5825	Tasa Variable	437,490.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/02/202511.5825	Tasa Variable	4,082.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/02/202511.5825	Tasa Variable	4,002.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202410/02/202511.5825	Tasa Variable	62,440.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/03/202511.5825	Tasa Variable	2,700.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/03/202511.5825	Tasa Variable	411,730.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/04/202511.5204	Tasa Variable	20,568.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/03/202511.5825	Tasa Variable	47,160.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/03/202511.5825	Tasa Variable	52,952.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202408/05/202511.5204	Tasa Variable	138,544.54

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 85 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/11/202404/04/202511.5204	Tasa Variable	637.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202413/01/20255.72014	Tasa Variable	13,719.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202406/01/202511.615	Tasa Variable	643,967.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/02/202511.5544	Tasa Variable	6,438.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202410/02/202511.5544	Tasa Variable	6,484.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202405/02/202511.5544	Tasa Variable	673,252.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202419/03/202511.5544	Tasa Variable	2,026,318.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/03/202511.5544	Tasa Variable	23,072.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202412/03/202511.5544	Tasa Variable	468,018.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/03/202511.5544	Tasa Variable	439,647.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/03/202511.5544	Tasa Variable	41,568.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202426/02/202511.5544	Tasa Variable	226,487.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202410/02/202511.5544	Tasa Variable	131,083.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202410/03/202511.5544	Tasa Variable	639,649.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202410/03/202511.5544	Tasa Variable	964,474.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/03/202511.5544	Tasa Variable	32,250.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/02/202511.5544	Tasa Variable	105,099.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/02/202511.5544	Tasa Variable	776,995.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202410/02/202511.5544	Tasa Variable	657.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202429/01/202511.5544	Tasa Variable	58,267.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202412/03/202511.5544	Tasa Variable	109,415.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202410/03/202511.5544	Tasa Variable	219,517.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/03/202511.5544	Tasa Variable	33,298.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/03/202511.5544	Tasa Variable	64,944.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202419/05/202511.4774	Tasa Variable	54,978.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/11/202404/04/202511.4774	Tasa Variable	2,476,531.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202424/01/20255.71379	Tasa Variable	2,360,466.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202413/01/20255.71379	Tasa Variable	48,014.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202413/01/20255.71379	Tasa Variable	80,975.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202413/01/202511.617	Tasa Variable	13,370.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/02/202511.5434	Tasa Variable	3,916.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202410/02/202511.5434	Tasa Variable	1,817.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202410/03/202511.5434	Tasa Variable	74,242.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202412/03/202511.5434	Tasa Variable	338,572.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/03/202511.5434	Tasa Variable	66,413.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/03/202511.5434	Tasa Variable	38,076.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202416/05/202511.4581	Tasa Variable	582,664.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202407/01/202511.617	Tasa Variable	711,792.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202420/01/202511.617	Tasa Variable	583,236.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202420/01/202511.617	Tasa Variable	286,593.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202417/02/202511.5434	Tasa Variable	868,666.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202417/02/202511.5434	Tasa Variable	245,208.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202427/01/202511.5434	Tasa Variable	686.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202418/03/202511.5434	Tasa Variable	1,901,097.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202410/03/202511.5434	Tasa Variable	112,418.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/03/202511.5434	Tasa Variable	13,108.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202412/03/202511.5434	Tasa Variable	1,061,162.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202415/05/202511.4581	Tasa Variable	2,533,205.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/04/202511.4581	Tasa Variable	96,475.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202420/01/202511.617	Tasa Variable	322,891.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202420/01/202511.617	Tasa Variable	1,016,044.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202417/02/202511.5434	Tasa Variable	394,602.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202417/02/202511.5434	Tasa Variable	1,971.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202417/02/202511.5434	Tasa Variable	43,779.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202429/01/202511.5434	Tasa Variable	68,612.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202418/03/202511.5434	Tasa Variable	711,547.29

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 86 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/03/202511.5434	Tasa Variable	42,145.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202412/03/202511.5434	Tasa Variable	33,629.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202418/03/202511.5434	Tasa Variable	582,625.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/03/202511.5434	Tasa Variable	80,964.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/03/202511.5434	Tasa Variable	8,430.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202412/03/202511.5434	Tasa Variable	208,518.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202415/05/202511.4581	Tasa Variable	2,566,333.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/04/202511.4581	Tasa Variable	11,505.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/04/202511.4581	Tasa Variable	15,758.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/11/202404/04/202511.4581	Tasa Variable	69,501.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202416/01/20255.72084	Tasa Variable	246,536.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202410/03/20255.83378	Tasa Variable	634,384.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202417/01/202511.6136	Tasa Variable	2,132,846.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202420/01/202511.6136	Tasa Variable	54,881.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202406/01/202511.6136	Tasa Variable	204,009.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202417/02/202511.5487	Tasa Variable	687,494.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/03/202511.5487	Tasa Variable	4,963.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202412/03/202511.5487	Tasa Variable	297,876.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/03/202511.5487	Tasa Variable	41,162.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202412/03/202511.5487	Tasa Variable	2,319,547.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202406/01/202511.6136	Tasa Variable	9,907.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202406/01/202511.6136	Tasa Variable	143,427.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202406/01/202511.6136	Tasa Variable	6,394.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202406/01/202511.6136	Tasa Variable	2,755.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202407/02/202511.5487	Tasa Variable	773,048.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/02/202511.5487	Tasa Variable	39,215.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/02/202511.5487	Tasa Variable	171,352.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/02/202511.5487	Tasa Variable	334,535.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/02/202511.5487	Tasa Variable	3,834.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/03/202511.5487	Tasa Variable	45,830.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/03/202511.5487	Tasa Variable	1,961,999.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/03/202511.5487	Tasa Variable	800,993.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202412/03/202511.5487	Tasa Variable	73,908.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/04/202511.4719	Tasa Variable	17,304.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202403/01/202511.6136	Tasa Variable	2,925.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202413/01/202511.6136	Tasa Variable	54,138.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202421/02/202511.5487	Tasa Variable	309,333.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202418/03/202511.5487	Tasa Variable	66,205.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202431/01/202511.5487	Tasa Variable	524,912.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202414/03/202511.5487	Tasa Variable	608,011.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202405/03/202511.5487	Tasa Variable	226,652.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/03/202511.5487	Tasa Variable	130,472.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202404/03/202511.5487	Tasa Variable	86,448.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202412/03/202511.5487	Tasa Variable	204,845.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/11/202405/05/202511.4719	Tasa Variable	8,955.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202407/02/20255.72094	Tasa Variable	622,574.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202420/01/20255.72094	Tasa Variable	651,416.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202427/01/20255.72094	Tasa Variable	395,656.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202414/01/202511.5665	Tasa Variable	2,577,502.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202406/01/202511.5665	Tasa Variable	1,849.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202418/03/202511.4587	Tasa Variable	135,825.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202404/03/202511.4587	Tasa Variable	57,902.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202404/03/202511.4587	Tasa Variable	218,034.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202423/05/202511.396	Tasa Variable	3,013,159.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202410/01/202511.5665	Tasa Variable	11,633.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202404/02/202511.4587	Tasa Variable	76,151.97

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 87 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202404/03/202511.4587	Tasa Variable	78,730.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202405/05/202511.396	Tasa Variable	38,384.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202404/04/202511.396	Tasa Variable	329,053.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/11/202412/05/202511.396	Tasa Variable	960,816.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202420/01/20255.72108	Tasa Variable	368,326.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202414/01/202511.5565	Tasa Variable	774,631.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202406/01/202511.5565	Tasa Variable	251,837.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202406/01/202511.5565	Tasa Variable	118,797.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202417/02/202511.4421	Tasa Variable	79,276.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/03/202511.4421	Tasa Variable	38,422.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202406/01/202511.5565	Tasa Variable	268,099.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/03/202511.4421	Tasa Variable	1,194,472.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/03/202511.4421	Tasa Variable	43,914.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/03/202511.4421	Tasa Variable	48,843.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202419/05/202511.3584	Tasa Variable	927.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/04/202511.3584	Tasa Variable	39,193.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/03/202511.4421	Tasa Variable	21,147.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202412/03/202511.4421	Tasa Variable	132,149.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/03/202511.4421	Tasa Variable	1,654,232.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/03/202511.4421	Tasa Variable	49,828.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/03/202511.4421	Tasa Variable	32,955.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/11/202404/04/202511.3584	Tasa Variable	13,896.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202403/01/202511.5674	Tasa Variable	80,997.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202421/02/202511.4703	Tasa Variable	303,027.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202421/03/202511.4703	Tasa Variable	301,494.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202403/01/202511.5674	Tasa Variable	13,140.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202406/01/202511.5674	Tasa Variable	31,596.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202406/01/202511.5674	Tasa Variable	821,012.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202406/01/202511.5674	Tasa Variable	71,837.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202421/02/202511.4703	Tasa Variable	1,093,664.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202404/03/202511.4703	Tasa Variable	27,179.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202419/03/202511.4703	Tasa Variable	221,412.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202404/03/202511.4703	Tasa Variable	470,747.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202404/03/202511.4703	Tasa Variable	181,457.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202419/03/202511.4703	Tasa Variable	8,311,440.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202426/05/202511.3969	Tasa Variable	41,778.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202420/01/202511.5674	Tasa Variable	1,423.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202417/02/202511.4703	Tasa Variable	465.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202418/03/202511.4703	Tasa Variable	332,055.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202406/01/202511.5674	Tasa Variable	36,561.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202429/01/202511.4703	Tasa Variable	559,941.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202414/03/202511.4703	Tasa Variable	1,213,808.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202404/03/202511.4703	Tasa Variable	646,178.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202404/03/202511.4703	Tasa Variable	17,314.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202404/03/202511.4703	Tasa Variable	99,002.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/11/202426/05/202511.3969	Tasa Variable	8,618.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202410/01/202511.5622	Tasa Variable	567,971.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202413/01/202511.5622	Tasa Variable	30,677.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202406/01/202511.5622	Tasa Variable	149,459.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/02/202511.4569	Tasa Variable	95,813.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/03/202511.4569	Tasa Variable	312,199.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/03/202511.4569	Tasa Variable	353,408.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202422/05/202511.3809	Tasa Variable	4,599,261.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/04/202511.3809	Tasa Variable	3,939,252.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/04/202511.3809	Tasa Variable	98,268.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202406/01/202511.5622	Tasa Variable	85.06

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA **88 / 99**

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202402/01/202511.5622	Tasa Variable	150,719.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/03/202511.4569	Tasa Variable	118,775.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/03/202511.4569	Tasa Variable	103,396.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/03/202511.4569	Tasa Variable	61,775.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/04/202511.3809	Tasa Variable	81,061.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202413/01/202511.5622	Tasa Variable	30,163.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202406/01/202511.5622	Tasa Variable	2,967,376.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202426/02/202511.4569	Tasa Variable	467,547.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202424/03/202511.4569	Tasa Variable	776,822.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/03/202511.4569	Tasa Variable	27,721.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202419/03/202511.4569	Tasa Variable	39,208.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202424/03/202511.4569	Tasa Variable	573,016.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/03/202511.4569	Tasa Variable	111,930.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202419/03/202511.4569	Tasa Variable	3,128,215.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO29/11/202404/04/202511.3809	Tasa Variable	9,518.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202420/01/20255.69937	Tasa Variable	196,461.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202420/01/20255.69937	Tasa Variable	235,031.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202431/01/202511.5582	Tasa Variable	104,046.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202428/01/202511.5582	Tasa Variable	2,761,232.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202427/01/202511.5582	Tasa Variable	202,585.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202427/01/202511.5582	Tasa Variable	582,599.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202421/02/202511.503	Tasa Variable	226,908.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/02/202511.503	Tasa Variable	581,093.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/02/202511.503	Tasa Variable	464,066.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/02/202511.503	Tasa Variable	207,249.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202426/02/202511.503	Tasa Variable	165,203.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202414/03/202511.4576	Tasa Variable	469,936.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/03/202511.4576	Tasa Variable	1,004,866.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/03/202511.4576	Tasa Variable	245,798.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202419/03/202511.4576	Tasa Variable	9,603,898.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/01/202511.5582	Tasa Variable	854,443.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202427/01/202511.5582	Tasa Variable	163,295.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/02/202511.503	Tasa Variable	97,028.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/02/202511.503	Tasa Variable	180.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/03/202511.4576	Tasa Variable	106,031.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202427/01/202511.5582	Tasa Variable	443.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/02/202511.503	Tasa Variable	16,158.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/03/202511.4576	Tasa Variable	203,285.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202404/03/202511.4576	Tasa Variable	467,092.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/03/202511.4576	Tasa Variable	39,599.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202404/03/202511.4576	Tasa Variable	194,946.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202405/02/202511.503	Tasa Variable	40,041.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/03/202511.4576	Tasa Variable	1,478,909.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202419/03/202511.4576	Tasa Variable	260,443.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202424/03/202511.4576	Tasa Variable	91,764.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202404/03/202511.4576	Tasa Variable	137,371.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202404/03/202511.4576	Tasa Variable	74,074.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202404/03/202511.4576	Tasa Variable	54,170.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202404/04/202511.3811	Tasa Variable	38,686.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/12/202404/04/202511.3811	Tasa Variable	1,294.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202415/01/202511.5123	Tasa Variable	621,149.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202427/01/202511.5123	Tasa Variable	851,296.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/03/202511.3532	Tasa Variable	30,364.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202419/03/202511.3532	Tasa Variable	1,511,332.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/03/202511.3532	Tasa Variable	174,272.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202412/03/202511.3532	Tasa Variable	77,023.42



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 89 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202427/01/20255.6662	Tasa Variable	392,817.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202427/01/20255.6662	Tasa Variable	103,824.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202420/01/20255.6662	Tasa Variable	21,013.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202424/03/20255.78359	Tasa Variable	195,073.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202428/01/202511.5123	Tasa Variable	6,452,264.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/03/202511.3532	Tasa Variable	119,257.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/04/202511.2733	Tasa Variable	96,150.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/02/202511.4113	Tasa Variable	8,625.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/03/202511.3532	Tasa Variable	20,037.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/03/202511.3532	Tasa Variable	75,071.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/04/202511.2733	Tasa Variable	26,585.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/04/202511.2733	Tasa Variable	6,095.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/12/202404/04/202511.2733	Tasa Variable	26,835.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202406/01/20255.66472	Tasa Variable	8,863.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202403/01/202511.5697	Tasa Variable	983.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202431/01/202511.507	Tasa Variable	3,532.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202407/02/202511.4067	Tasa Variable	1,324.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202426/03/202511.3523	Tasa Variable	1,186,409.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202430/05/202511.2702	Tasa Variable	2,773,378.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202428/04/202511.2702	Tasa Variable	938,856.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202410/01/202511.507	Tasa Variable	2,519.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202420/01/202511.507	Tasa Variable	23,836.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202406/01/202511.507	Tasa Variable	27,179.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202404/03/202511.4067	Tasa Variable	94,571.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202404/03/202511.4067	Tasa Variable	143,866.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202404/03/202511.4067	Tasa Variable	545,359.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202426/03/202511.3523	Tasa Variable	1,348,483.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202426/03/202511.3523	Tasa Variable	65,067.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202424/02/202511.4067	Tasa Variable	8,893.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202404/03/202511.4067	Tasa Variable	139,275.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202404/03/202511.4067	Tasa Variable	70,489.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202404/03/202511.4067	Tasa Variable	63,188.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202426/03/202511.3523	Tasa Variable	13,878.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202404/04/202511.2702	Tasa Variable	25,636.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202404/04/202511.2702	Tasa Variable	24,980.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/12/202404/04/202511.2702	Tasa Variable	33,055.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202404/03/202511.381	Tasa Variable	174,083.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202404/04/202511.3301	Tasa Variable	3,649,671.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202426/03/202511.3301	Tasa Variable	2,916.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202402/06/202511.2545	Tasa Variable	4,969.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202413/01/202511.491	Tasa Variable	161,997.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202406/01/202511.491	Tasa Variable	489,967.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202404/03/202511.381	Tasa Variable	2,000.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202404/03/202511.381	Tasa Variable	67,716.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202426/03/202511.3301	Tasa Variable	88,605.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202426/03/202511.3301	Tasa Variable	53,248.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202428/01/202511.491	Tasa Variable	2,530,938.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202406/01/202511.491	Tasa Variable	12,642.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202419/02/202511.381	Tasa Variable	919,589.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202404/03/202511.381	Tasa Variable	175,657.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202404/04/202511.3301	Tasa Variable	2,352.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202426/03/202511.3301	Tasa Variable	71,808.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202404/04/202511.3301	Tasa Variable	39,438.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/12/202402/06/202511.2545	Tasa Variable	13,604.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202424/01/202511.4848	Tasa Variable	1,106,400.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202409/01/202511.4848	Tasa Variable	13,228.42

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 90 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/02/202511.4848	Tasa Variable	413,589.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202417/02/202511.3749	Tasa Variable	43,952.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/03/202511.3749	Tasa Variable	29,808.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202402/06/202511.2283	Tasa Variable	1,623.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202403/01/202511.5559	Tasa Variable	105,040.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202417/01/202511.4848	Tasa Variable	67,240.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/03/202511.3749	Tasa Variable	36,915.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/04/202511.3156	Tasa Variable	283,935.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/04/202511.3156	Tasa Variable	179,282.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/02/202511.4848	Tasa Variable	82,382.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/02/202511.4848	Tasa Variable	5,046.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/03/202511.3749	Tasa Variable	2,327.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/03/202511.3749	Tasa Variable	85,174.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202431/03/202511.3156	Tasa Variable	122,283.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202426/03/202511.3156	Tasa Variable	1,116,360.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202431/03/202511.3156	Tasa Variable	369,335.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202404/04/202511.3156	Tasa Variable	27,300.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/12/202429/05/202511.2283	Tasa Variable	2,845,032.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202424/01/20255.62844	Tasa Variable	520,671.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202413/01/20255.62844	Tasa Variable	57,520.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202406/01/202511.5494	Tasa Variable	1,081,777.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202431/01/202511.4576	Tasa Variable	21,337.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/02/202511.4576	Tasa Variable	48,998.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/02/202511.4576	Tasa Variable	3,013,963.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202428/02/202511.327	Tasa Variable	265,815.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202403/03/202511.327	Tasa Variable	28,209.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202403/03/202511.327	Tasa Variable	797,612.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/03/202511.327	Tasa Variable	78,153.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/03/202511.327	Tasa Variable	87,851.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202403/03/202511.327	Tasa Variable	58,799.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202428/03/202511.2641	Tasa Variable	85,260.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202431/03/202511.2641	Tasa Variable	703,983.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202402/04/202511.2641	Tasa Variable	2,014,392.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/04/202511.2641	Tasa Variable	5,992.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202426/03/202511.2641	Tasa Variable	37,764.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202431/03/202511.2641	Tasa Variable	339,746.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/04/202511.2641	Tasa Variable	678,455.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202429/05/202511.1759	Tasa Variable	1,364,824.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202406/01/202511.5494	Tasa Variable	99.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202406/01/202511.5494	Tasa Variable	546,542.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202428/01/202510.9576	Tasa Variable	20,907,114.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202413/01/202511.4576	Tasa Variable	16,091.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/02/202511.4576	Tasa Variable	12,007.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/02/202511.4576	Tasa Variable	556,985.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202420/01/202511.4576	Tasa Variable	114.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/03/202511.327	Tasa Variable	46,274.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/03/202511.327	Tasa Variable	560,098.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/04/202511.2641	Tasa Variable	638.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202426/03/202511.2641	Tasa Variable	542,186.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/04/202511.2641	Tasa Variable	127,409.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/04/202511.2641	Tasa Variable	298,789.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202404/04/202511.2641	Tasa Variable	52,509.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO09/12/202405/05/202511.1759	Tasa Variable	6,983.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202404/02/20255.62672	Tasa Variable	333,890.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202431/03/20255.72942	Tasa Variable	21,668.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202413/01/202511.4383	Tasa Variable	56,425.15

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 91 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202404/03/202511.2952	Tasa Variable	12,498.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202426/03/202511.2299	Tasa Variable	633,113.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202404/04/202511.2299	Tasa Variable	78,014.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202406/01/202511.5419	Tasa Variable	188,364.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202406/01/202511.5419	Tasa Variable	142,372.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202410/01/202511.4383	Tasa Variable	85,890.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202404/02/202511.4383	Tasa Variable	176,181.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202403/03/202511.2952	Tasa Variable	56,859.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202404/03/202511.2952	Tasa Variable	343,909.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202404/03/202511.2952	Tasa Variable	60,077.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202426/03/202511.2299	Tasa Variable	38,925.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202418/03/202511.2299	Tasa Variable	47,760.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202406/01/202511.5419	Tasa Variable	231,350.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202427/01/202511.4383	Tasa Variable	23,080.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202404/02/202511.4383	Tasa Variable	1,257.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202403/03/202511.2952	Tasa Variable	360,081.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202405/03/202511.2952	Tasa Variable	39,002.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202404/03/202511.2952	Tasa Variable	64,706.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/12/202431/03/202511.2299	Tasa Variable	347,991.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202413/01/20255.59622	Tasa Variable	61,024.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202424/02/20255.59622	Tasa Variable	116,046.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202431/03/20255.68907	Tasa Variable	180,959.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202406/01/202511.5381	Tasa Variable	60,397.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202406/01/202511.5381	Tasa Variable	84,398.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202430/01/202511.4213	Tasa Variable	2,430.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202403/03/202511.2625	Tasa Variable	41,185.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202404/03/202511.2625	Tasa Variable	743,543.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202421/03/202511.1888	Tasa Variable	533,348.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202404/04/202511.1888	Tasa Variable	2,013,053.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202404/04/202511.1888	Tasa Variable	411,915.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202404/04/202511.1888	Tasa Variable	118,192.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202402/04/202511.1888	Tasa Variable	23,733.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202402/06/202511.0731	Tasa Variable	1,062,609.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202427/01/202511.4213	Tasa Variable	1,281,230.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202404/02/202511.4213	Tasa Variable	34,052.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202404/02/202511.4213	Tasa Variable	780,659.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202410/02/202511.2625	Tasa Variable	5,713.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202404/04/202511.1888	Tasa Variable	326,254.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202404/04/202511.1888	Tasa Variable	487,474.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202407/01/202511.5381	Tasa Variable	338,666.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202431/01/202511.4213	Tasa Variable	1,110.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202407/03/202511.2625	Tasa Variable	43,728.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202407/01/202511.5381	Tasa Variable	94,773.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202406/01/202511.5381	Tasa Variable	91,370.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202407/03/202511.2625	Tasa Variable	281,831.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202404/04/202511.1888	Tasa Variable	1,304,641.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202409/06/202511.0731	Tasa Variable	21,302.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/12/202405/05/202511.0731	Tasa Variable	2,076,190.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/12/202410/01/202511.5381	Tasa Variable	166,979.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/12/202406/01/202511.5381	Tasa Variable	262,139.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/12/202407/02/202511.4213	Tasa Variable	7,503,674.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/12/202404/03/202511.2625	Tasa Variable	167,232.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/12/202404/04/202511.1888	Tasa Variable	66,158.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/12/202404/04/202511.1888	Tasa Variable	216,213.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/12/202426/03/202511.1888	Tasa Variable	157,202.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO13/12/202406/06/202511.0731	Tasa Variable	1,031,057.87

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 92 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202409/06/202511.0731 Tasa Variable 12,132.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202406/01/202511.5381 Tasa Variable 64,423.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202424/01/202511.4213 Tasa Variable 15,796.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202410/02/202511.4213 Tasa Variable 1,384,220.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/02/202511.4213 Tasa Variable 26,627.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202427/01/202511.4213 Tasa Variable 6,284.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/02/202511.4213 Tasa Variable 511,998.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/02/202511.4213 Tasa Variable 82,460.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/02/202511.4213 Tasa Variable 51,063.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202428/02/202511.2625 Tasa Variable 28,329.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202410/03/202511.2625 Tasa Variable 107,253.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/03/202511.2625 Tasa Variable 1,512,787.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/03/202511.2625 Tasa Variable 99,549.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/03/202511.2625 Tasa Variable 881,904.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/03/202511.2625 Tasa Variable 13,414.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202414/03/202511.1888 Tasa Variable 512,837.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202407/04/202511.1888 Tasa Variable 198,824.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/04/202511.1888 Tasa Variable 181,493.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202402/04/202511.1888 Tasa Variable 179,736.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202404/04/202511.1888 Tasa Variable 255,365.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202402/04/202511.1888 Tasa Variable 51,986.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202409/06/202511.0731 Tasa Variable 1,490.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202405/05/202511.0731 Tasa Variable 196,195.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/12/202405/05/202511.0731 Tasa Variable 4,214.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202427/01/20255.55857 Tasa Variable 40,453.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202431/03/20255.66045 Tasa Variable 926,559.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202410/01/202511.5324 Tasa Variable 460,316.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202406/01/202511.5324 Tasa Variable 361,585.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202406/01/202511.5324 Tasa Variable 819,739.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202417/01/202511.4005 Tasa Variable 63,774.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202407/03/202511.2245 Tasa Variable 47,622.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202404/04/202511.143 Tasa Variable 16,451.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202404/04/202511.143 Tasa Variable 32,454.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202404/04/202511.143 Tasa Variable 11,682.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202405/05/202511.0217 Tasa Variable 47,601.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202410/01/202511.5324 Tasa Variable 165,972.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202413/01/202511.5324 Tasa Variable 12,683.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202417/01/202511.4005 Tasa Variable 39,630.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202410/02/202511.4005 Tasa Variable 724,268.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202410/02/202511.4005 Tasa Variable 779,018.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202430/01/202511.4005 Tasa Variable 1,897,452.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202410/02/202511.4005 Tasa Variable 7,260.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202407/03/202511.2245 Tasa Variable 99,693.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202410/03/202511.2245 Tasa Variable 355,295.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202410/03/202511.2245 Tasa Variable 33,740.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202410/03/202511.2245 Tasa Variable 182,924.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202407/04/202511.143 Tasa Variable 506,710.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202407/04/202511.143 Tasa Variable 155,259.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202409/06/202511.0217 Tasa Variable 47,300.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202428/01/202511.4005 Tasa Variable 778,306.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202404/02/202511.4005 Tasa Variable 176,110.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202404/02/202511.4005 Tasa Variable 97,058.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202404/02/202511.4005 Tasa Variable 3,229.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202404/03/202511.2245 Tasa Variable 7,792.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202407/04/202511.143 Tasa Variable 620.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/12/202404/04/202511.143 Tasa Variable 188,605.35

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 93 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/12/202404/04/202511.143	Tasa Variable	372,688.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/12/202405/05/202511.0217	Tasa Variable	191,695.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/12/202405/05/202511.0217	Tasa Variable	19,639.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/12/202428/01/202510.9005	Tasa Variable	5,356,197.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/12/202404/04/202511.143	Tasa Variable	68,913.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/12/202404/04/202511.143	Tasa Variable	364,363.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/12/202404/04/202511.143	Tasa Variable	30,772.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202421/02/20255.54872	Tasa Variable	2,262,631.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202410/02/20255.54872	Tasa Variable	276,765.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202410/02/20255.54872	Tasa Variable	131,553.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202431/01/202511.4019	Tasa Variable	759,507.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202411/02/202511.4019	Tasa Variable	5,351,372.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202404/03/202511.2249	Tasa Variable	43,869.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202421/03/202511.147	Tasa Variable	117,778.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202404/04/202511.147	Tasa Variable	4,979,968.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202402/06/202511.0329	Tasa Variable	421,930.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202413/01/202511.5366	Tasa Variable	442.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202411/02/202511.4019	Tasa Variable	4,552,592.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202404/02/202511.4019	Tasa Variable	6,709.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202410/02/202511.4019	Tasa Variable	145.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202410/03/202511.2249	Tasa Variable	2,510,669.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202424/03/202511.147	Tasa Variable	503,694.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202404/04/202511.147	Tasa Variable	228,418.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202404/04/202511.147	Tasa Variable	51,778.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202421/02/202511.2249	Tasa Variable	134,636.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202404/03/202511.2249	Tasa Variable	119,458.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/12/202404/04/202511.147	Tasa Variable	18,752.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202410/02/202511.3983	Tasa Variable	165,071.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202404/04/202511.1563	Tasa Variable	128,421.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202409/04/202511.1563	Tasa Variable	21,497.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202405/05/202511.0525	Tasa Variable	120,804.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202431/01/202511.3983	Tasa Variable	639,083.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202410/03/202511.2312	Tasa Variable	13,511.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202410/03/202511.2312	Tasa Variable	1,060.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202404/04/202511.1563	Tasa Variable	30,946.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202409/04/202511.1563	Tasa Variable	18,569.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202405/05/202511.0525	Tasa Variable	42,164.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202410/03/202511.2312	Tasa Variable	49,601.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202411/04/202511.1563	Tasa Variable	306,816.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/12/202404/04/202511.1563	Tasa Variable	64,207.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202407/04/20255.67749	Tasa Variable	459,879.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202410/01/202511.518	Tasa Variable	43,178.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202406/01/202511.518	Tasa Variable	95,904.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202406/01/202511.518	Tasa Variable	206,582.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202414/02/202511.3913	Tasa Variable	23,005.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202414/03/202511.2274	Tasa Variable	567,244.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202403/03/202511.2274	Tasa Variable	2,767.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202411/04/202511.1612	Tasa Variable	371,333.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202407/04/202511.1612	Tasa Variable	30,050.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202409/04/202511.1612	Tasa Variable	58,675.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202413/06/202511.0781	Tasa Variable	2,004,854.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202416/06/202511.0781	Tasa Variable	4,649.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202403/01/202511.518	Tasa Variable	20,255.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202405/02/202511.3913	Tasa Variable	436,923.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202410/03/202511.2274	Tasa Variable	14,722.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202404/04/202511.1612	Tasa Variable	125,673.78

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 94 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202405/05/202511.0781	Tasa Variable	2,518,715.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202404/02/202511.3913	Tasa Variable	9,023.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202404/03/202511.2274	Tasa Variable	80,824.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202404/04/202511.1612	Tasa Variable	9,871.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202404/04/202511.1612	Tasa Variable	273,195.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202416/06/202511.0781	Tasa Variable	37,362.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202405/05/202511.0781	Tasa Variable	3,905.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/12/202405/05/202511.0781	Tasa Variable	19,428.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202427/01/202511.4371	Tasa Variable	25,428.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202413/03/202511.3082	Tasa Variable	282,196.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202409/04/202511.2149	Tasa Variable	24,832.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202404/04/202511.2149	Tasa Variable	279,546.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202404/04/202511.2149	Tasa Variable	284,850.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202407/02/202511.4371	Tasa Variable	38,554.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202417/02/202511.4371	Tasa Variable	73,983.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202421/02/202511.3082	Tasa Variable	318,408.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202421/03/202511.2149	Tasa Variable	248,417.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202404/04/202511.2149	Tasa Variable	755,661.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202409/04/202511.2149	Tasa Variable	19,603.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202405/05/202511.0882	Tasa Variable	124,766.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202406/01/202511.5146	Tasa Variable	63,716.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202404/02/202511.4371	Tasa Variable	515,547.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202417/02/202511.4371	Tasa Variable	1,091,276.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202423/01/202511.4371	Tasa Variable	1,205.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202418/03/202511.3082	Tasa Variable	389,869.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202418/03/202511.3082	Tasa Variable	6,614.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202404/04/202511.2149	Tasa Variable	537,625.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202414/04/202511.2149	Tasa Variable	489,438.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202404/04/202511.2149	Tasa Variable	1,581,709.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202404/04/202511.2149	Tasa Variable	11,609.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202416/06/202511.0882	Tasa Variable	81,220.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202405/06/202511.0882	Tasa Variable	2,200,376.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/12/202405/05/202511.0882	Tasa Variable	1,881,703.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202406/01/202511.5249	Tasa Variable	139,168.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202417/02/202511.493	Tasa Variable	239,432.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202417/02/202511.493	Tasa Variable	37,494.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202417/02/202511.493	Tasa Variable	58,244.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202418/03/202511.4096	Tasa Variable	6,630.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202418/03/202511.4096	Tasa Variable	1,463,553.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/03/202511.4096	Tasa Variable	40,961.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202418/03/202511.4096	Tasa Variable	85,405.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202414/04/202511.3259	Tasa Variable	268,627.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/04/202511.3259	Tasa Variable	364,711.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202405/05/202511.1932	Tasa Variable	11,093.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202405/05/202511.1932	Tasa Variable	38,826.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202420/01/202511.5249	Tasa Variable	384,448.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202406/01/202511.5249	Tasa Variable	12,146.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202406/01/202511.5249	Tasa Variable	307,274.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202406/01/202511.5249	Tasa Variable	84,236.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202427/01/202511.493	Tasa Variable	332,717.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/03/202511.4096	Tasa Variable	1,387,726.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/03/202511.4096	Tasa Variable	107,166.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/03/202511.4096	Tasa Variable	102,289.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202414/04/202511.3259	Tasa Variable	196,175.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/04/202511.3259	Tasa Variable	382,793.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202409/04/202511.3259	Tasa Variable	41,190.35

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 95 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/04/202511.3259	Tasa Variable	164,640.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/04/202511.3259	Tasa Variable	35,858.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/02/202511.493	Tasa Variable	22,362.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202427/03/202511.3259	Tasa Variable	28,258.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/04/202511.3259	Tasa Variable	1,269,838.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202404/04/202511.3259	Tasa Variable	634,692.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/12/202405/05/202511.1932	Tasa Variable	12,485.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202417/02/20255.52742	Tasa Variable	359,957.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202418/03/202511.452	Tasa Variable	5,430.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202414/04/202511.3981	Tasa Variable	19,804.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202404/04/202511.3981	Tasa Variable	274,568.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202409/06/202511.224	Tasa Variable	773,429.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202405/05/202511.224	Tasa Variable	2,347,160.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202420/01/202511.3289	Tasa Variable	6,443.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202417/02/202511.405	Tasa Variable	44,646.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202418/03/202511.452	Tasa Variable	38,509.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202414/04/202511.3981	Tasa Variable	206,125.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202404/04/202511.3981	Tasa Variable	109,116.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202404/04/202511.3981	Tasa Variable	41,548.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202417/01/202511.3289	Tasa Variable	443,272.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202424/01/202511.405	Tasa Variable	31,981.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202407/03/202511.452	Tasa Variable	13,729.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202417/01/202511.3289	Tasa Variable	235,694.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202424/01/202511.405	Tasa Variable	101,942.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202421/03/202511.452	Tasa Variable	207,189.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202411/04/202511.3981	Tasa Variable	118,420.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/12/202404/04/202511.3981	Tasa Variable	400,701.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202411/02/202511.4151	Tasa Variable	2,116,775.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/02/202511.4151	Tasa Variable	414,556.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/04/202511.3959	Tasa Variable	40,515.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/04/202511.3959	Tasa Variable	343,629.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202414/02/202511.4151	Tasa Variable	3,844.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/04/202511.3959	Tasa Variable	40,734.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/04/202511.3959	Tasa Variable	9,696.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/04/202511.3959	Tasa Variable	16,639.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202406/01/202511.3389	Tasa Variable	36,445.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202406/01/202511.3389	Tasa Variable	310,160.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202406/01/202511.3389	Tasa Variable	7,098.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202414/02/202511.4151	Tasa Variable	2,511,729.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/02/202511.4151	Tasa Variable	2,473,038.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/02/202511.4151	Tasa Variable	134,198.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/02/202511.4151	Tasa Variable	2,954.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/03/202511.4616	Tasa Variable	109,686.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/03/202511.4616	Tasa Variable	1,193,173.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/03/202511.4616	Tasa Variable	53,411.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/04/202511.3959	Tasa Variable	422,531.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/04/202511.3959	Tasa Variable	263,359.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/04/202511.3959	Tasa Variable	1,220,822.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/12/202404/04/202511.3959	Tasa Variable	88,431.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202406/01/202511.3392	Tasa Variable	158,975.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202406/01/202511.3392	Tasa Variable	8,412.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202404/02/202511.3623	Tasa Variable	1,507,823.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202417/02/202511.3623	Tasa Variable	262,669.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202413/02/202511.3623	Tasa Variable	4,697.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202404/02/202511.3623	Tasa Variable	29,979.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202404/03/202511.3488	Tasa Variable	2,877,293.76

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 96 / 99

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202404/03/202511.3488	Tasa Variable	119,499.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202404/03/202511.3488	Tasa Variable	158,045.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202404/04/202511.3031	Tasa Variable	578,610.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202404/04/202511.3031	Tasa Variable	157,828.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202404/04/202511.3031	Tasa Variable	755,175.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202424/06/202511.2224	Tasa Variable	12,290.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202423/06/202511.2224	Tasa Variable	352,553.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202420/02/20255.52666	Tasa Variable	3,492.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202413/01/202511.3392	Tasa Variable	54,089.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202424/02/202511.3623	Tasa Variable	769,675.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202413/03/202511.3488	Tasa Variable	133,535.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202413/01/202511.3392	Tasa Variable	17,902.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202424/02/202511.3623	Tasa Variable	278,693.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202424/02/202511.3623	Tasa Variable	1,813.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202428/02/202511.3488	Tasa Variable	463,664.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202427/02/202510.8488	Tasa Variable	14,553,955.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202424/03/202511.3488	Tasa Variable	1,620,662.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202424/03/202511.3488	Tasa Variable	537.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202424/03/202511.3488	Tasa Variable	521,159.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202421/04/202511.3031	Tasa Variable	599,529.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202420/01/202511.3392	Tasa Variable	356.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202417/02/202511.3623	Tasa Variable	18,876.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/12/202424/06/202511.2224	Tasa Variable	259.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/12/202424/02/20255.52466	Tasa Variable	113,183.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/12/202427/01/202511.3443	Tasa Variable	60,392.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/12/202424/02/202511.3641	Tasa Variable	1,454,743.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/12/202424/03/202511.3495	Tasa Variable	99,882.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/12/202421/04/202511.3101	Tasa Variable	188,025.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/12/202414/02/202511.3641	Tasa Variable	283,303.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/12/202404/04/202511.3101	Tasa Variable	33,653.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/12/202424/02/20255.52878	Tasa Variable	463,016.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/12/202424/02/20255.52878	Tasa Variable	56,348.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/12/202414/04/20255.68493	Tasa Variable	307,948.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/12/202404/04/202511.3302	Tasa Variable	190,592.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/12/202404/04/202511.3302	Tasa Variable	142,388.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/12/202424/02/202511.3713	Tasa Variable	724.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/12/202404/04/202511.3302	Tasa Variable	49,629.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/12/202427/06/202511.2669	Tasa Variable	1,058,528.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/12/202405/05/202511.2669	Tasa Variable	43,343.56

TOTAL	5,440,341,169.02	3,417,482,943.95	3,976,891,101.02	8,926,543,132.76
	3,039,299,116.15	369,366,547.77	427,318,706.45	3,180,674,283.38
	315,122,049.88	484,410,172.94	-	2,135,368,536.77
Total bancarios	5,440,341,169.02	3,417,482,943.95	3,976,891,101.02	8,926,543,132.76
	3,039,299,116.15	369,366,547.77	11,774,699,087.25	5,288,549,410.34
	315,122,049.88	484,410,172.94	-	2,135,368,536.77

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
 Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
 Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
 Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]  
 Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro]  
 Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 97 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Bursátiles y colocaciones privadas [sinopsis]

Bursátiles listadas en bolsa (quiropgrafarios)

CEBUR 94\_SCOTIAB\_23NO18/08/202302/03/2026TIIIE28 + 0.047,125,499,300  
 CEBUR 94\_SCOTIAB\_24NO26/02/202425/02/2027TIIIE Fondeo + 0.325,189,390,200  
 CEBUR 94\_SCOTIAB\_24-2NO26/02/202417/02/2031TF 9.24 + 0.51,008,708,700  
 CEBUR 94\_SCOTIAB\_24-2NO26/02/202417/02/2031TF 9.24 + 0.53,801,901,100  
 CEBUR 94\_SCOTIAB\_24-3NO13/09/202405/09/2031TF 9.893,969,611,100  
 CEBUR 94\_SCOTIAB\_24VNO13/09/202413/09/2027TIIIE Fondeo + 0.324,324,520,000  
 PRLV I\_BSCTIA\_25012No09/10/202407/01/202510.530051,302,506  
 PRLV I\_BSCTIA\_25012No11/07/202407/01/202511.2700164,412,625  
 PRLV I\_BSCTIA\_25015No16/07/202410/01/202511.180142,185,434  
 PRLV I\_BSCTIA\_25031No22/07/202420/01/202511.260057,497,847  
 PRLV I\_BSCTIA\_25032No25/07/202421/01/202511.28004,902,333  
 PRLV I\_BSCTIA\_25032No25/07/202421/01/202511.2800120,133,335  
 PRLV I\_BSCTIA\_25041No29/07/202427/01/202511.230058,886,450  
 PRLV I\_BSCTIA\_25053No09/08/202405/02/202511.210038,192,542  
 PRLV I\_BSCTIA\_25053No09/08/202405/02/202511.210076,455,972  
 PRLV I\_BSCTIA\_25075No27/05/202421/02/202511.320058,927,630  
 PRLV I\_BSCTIA\_25075No23/02/202421/02/202511.3501222,755,007  
 PRLV I\_BSCTIA\_25081No26/08/202424/02/202510.870058,829,806  
 PRLV I\_BSCTIA\_25082No29/08/202425/02/202510.91002,107,099  
 PRLV I\_BSCTIA\_25082No29/08/202425/02/202510.910084,124,041  
 PRLV I\_BSCTIA\_25101No10/09/202410/03/202510.7300131,441,870  
 PRLV I\_BSCTIA\_25102No12/09/202411/03/202510.730080,090,488  
 PRLV I\_BSCTIA\_25122No25/11/202425/03/202510.420051,696,667  
 PRLV I\_BSCTIA\_25141No09/10/202407/04/202510.59014,378,238  
 PRLV I\_BSCTIA\_25141No09/10/202407/04/202510.5901128,483,458  
 PRLV I\_BSCTIA\_25145No12/04/202411/04/202511.350111,127,385  
 PRLV I\_BSCTIA\_25145No16/07/202411/04/202511.170043,308,709  
 PRLV I\_BSCTIA\_25162No23/04/202422/04/202511.4199177,061,082  
 PRLV I\_BSCTIA\_25171No29/04/202428/04/202511.500060,621,031  
 PRLV I\_BSCTIA\_25192No14/11/202413/05/202510.4800102,626,400  
 PRLV I\_BSCTIA\_25211No25/11/202426/05/202510.3700112,996,235  
 PRLV I\_BSCTIA\_25213No29/11/202428/05/202510.28006,301,501  
 PRLV I\_BSCTIA\_25213No29/11/202428/05/202510.280071,775,787  
 PRLV I\_BSCTIA\_25221No02/12/202402/06/202510.2500106,717,344  
 PRLV I\_BSCTIA\_25242No19/12/202417/06/202510.01002,918,456  
 PRLV I\_BSCTIA\_25242No19/12/202417/06/202510.010063,788,953  
 PRLV I\_BSCTIA\_25271No09/10/202407/07/202510.490053,891,867  
 PRLV I\_BSCTIA\_25281No31/12/202414/07/202510.1500232,481,613  
 PRLV I\_BSCTIA\_25282No18/10/202415/07/202510.600168,227,428  
 PRLV I\_BSCTIA\_25282No16/07/202415/07/202511.140088,913,951  
 PRLV I\_BSCTIA\_25325No16/08/202415/08/202510.799955,358,894  
 PRLV I\_BSCTIA\_25371No19/12/202415/09/20259.910053,660,001  
 PRLV I\_BSCTIA\_25403No09/10/202408/10/202510.360055,187,020  
 PRLV I\_BSCTIA\_25415No18/10/202417/10/202510.570055,232,510  
 PRLV I\_BSCTIA\_25424No24/10/202423/10/202510.500061,867,764  
 PRLV I\_BSCTIA\_25471No25/11/202424/11/202510.2700110,304,782  
 PRLV I\_BSCTIA\_25481No02/12/202401/12/202510.1000220,262,597  
 PRLV I\_BSCTIA\_25504No19/12/202418/12/20259.849954,924,123  
 PRLV I\_BSCTIA\_25512No24/12/202423/12/202510.0800535,488,068  
 CEBUR\_94\_SCOTIAB\_24DN013/09/202410/09/2027TF 4.30497,975,722

TOTAL 3,841,846,849.00 7,125,499,300.00 9,513,910,200.00 - - 8,780,220,900.00  
 - - 497,975,721.69 - - -



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 99 / 99

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
 Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
 Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
 Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]  
 Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro]  
 Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]  
 Proveedores [sinopsis]  
 Proveedores

TOTAL - - - - -  
 Total proveedores - - - - -  
 Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
 Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
 Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
 Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]  
 Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro]  
 Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]  
 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 43,417,188,018.02 10,542,982,243.95 13,490,801,301.02 8,926,543,132.76  
 3,039,299,116.15 18,057,587,447.77 11,774,699,087.25 5,288,549,410.34 2,633,344,258.46  
 315,122,049.88 484,410,172.94 0.00

Comentarios:  
 El tipo de cambio tomado al cierre de diciembre es de 20.8829

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 1 / 18

**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 a las políticas establecidas.

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

1)Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

2)Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.

3)Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

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

1)Manual de Operación de Derivados.

2)Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

3)Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM) .

4)Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

5)Política de Riesgo de Contraparte

6)Política de Sobregiros

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al riesgo de tasas de interés y al riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura", en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las operaciones de cobertura.

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

Núm.Tipo de Cobertura Posición Cubierta Tipo de posición cubierta Condición de Mercado Derivado

1.Flujos de Efectivo 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

funcionalPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

6.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)

7.Flujos de EfectivoReportosPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de MercadoDerivado

8.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjeraActiva 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-MXNCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional

9.Flujo de EfectivoBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir 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 pesosCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

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

SubyacenteFuturosOpcionesSwaps

MRMRMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

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

2).(MR) Mercados reconocidos

3).(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las

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

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

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

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

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

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

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

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de diciembre 2024 y en promedio para el cuarto trimestre de 2024 es de:

Scotiabank-

Brechas de liquidez acumuladas

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 75,31363,746

Liquidity Buffer 142,206134,379

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 5 / 18

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

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

## INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

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

### INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

ProductoSubyacenteMonedaMódulo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios  
Cross Currency Interest Rate Swap(All Interest Rate)MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY,GBP SwapInterest Rate CurveVALMER  
FX RateVALMER

Interest Rate Swap(All Interest Rate)MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY,GBP SwapInterest Rate CurveVALMER

Interest Rate Cap/Floor(All Interest Rate)MXN,USD Cap/Floor Black'sInterest Rate  
CurveVALMER

SurfaceBloomberg/Reuters

OTC Binary Interest rate Option(All Interest Rate)MXN,USD Cap/Floor Black's  
Interest Rate CurveVALMER

SurfaceBloomberg/Reuters

IRS FuturesTIIE FondeoMXNPricePriceVALMER

Listed Interest Rate Swap (CME)TIIE FondeoMXN SwapInterest Rate CurveVALMER

OTC European Index Call Spread OptionOTC European Index Call Spread Option  
MXN,CAD,USD,

EUR,JPY Call Spread OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Basket OptionEquity Index, Common StockMXN,CAD,USD,

EUR,JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-FactorCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETF and Bond Index with  
Target Volatility (Vol Under 15%)MXN,CAD,USD,

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC Index Binary Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETFMXN,CAD,USD,

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

ProductoSubyacenteMonedaMódulo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios  
OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 6 / 18

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

PriceK2  
SurfaceTrader's mark  
Correlation  
Dividend  
Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER  
Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVALMER  
Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER  
Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER  
Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVALMER  
FX FuturesFX SpotUSD, BRL, CLP, COP,  
MXN, PEN, AUD, EUR,  
JPY, GBP, CHF, CADPriceOPICSVALMER  
OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN, CAD, USD,  
EUR, JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER  
FX Rate  
Surface  
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN, CAD, USD,  
EUR, JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER  
FX Rate  
Surface  
OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN, CAD, USD,  
EUR, JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER  
FX Rate  
Surface  
OTC FX Binary OptionFX SpotMXN, CAD, USD,  
EUR, JPYBlack-ScholesCurveVALMER  
FX Rate  
Surface  
Price  
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN, USD, CAD, EUR,  
BRL, CLP, COP, PEN,  
AUD, JPY, GBP, CHF ForexCurveVALMER  
  
FX Rate

## INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO

ProductoSubyacenteMonedaMódulo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios  
Listed Structured Notes Common Stock MXN, CAD, USD,  
EUR, JPY PricePriceVALMER

## POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO

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

TIPOS DE OPERACIÓN QUE SON OFRECIDOS EN FUNCIÓN AL TIPO DE ACREDITADO

a) Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

- Necesidades de tesorería del Banco
- Relación de corresponsalía
- Límites recíprocos

b) Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

- Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:

• Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO

1) Tesorería: Call Money

2) Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

3) Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

4) Cambios: FOREX

5) Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

6) Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

7) Metales

SUJETOS DE CRÉDITO

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

• Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat

• Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.

• Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)

• Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público

REGLAS PARTICULARES

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

• La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure".

• La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar.

• Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.

• La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.

IDONEIDAD DEL CLIENTE

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

• El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar

• Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

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

POLÍTICAS DE VAR

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

Debido a que la medida VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución deberá realizar diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al

riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

**B) DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN****MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:****CÁLCULO DE SENSIBILIDADES**

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

**PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)**

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

**BONOS DE TASA FLOTANTE**

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

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

**BONOS CUPÓN CERO**

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

**RIESGO DE CRÉDITO**

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

**SENSIBILIDAD DEL PASIVO**

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

**DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS****SWAPS DE TASA DE INTERÉS**

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

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

**FUTUROS DE TIIE**

---

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

**FUTUROS DE BONO M**

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

**FUTUROS DE CETE**

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

**EFFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:**

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

Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios mensuales históricos, es decir una ventana de observación de cinco años con base en un análisis de regresión.

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

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

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

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

Significancia de la regresión:  $F > 5$ .

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de diciembre 2024 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas. Durante el cuarto trimestre de 2024 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

**COBERTURA DE FLUJOS DE EFECTIVO:**

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

El componente que forma parte de "Otro Resultado Integral" asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre: la ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.

**COBERTURA DE VALOR RAZONABLE:**

La ganancia o pérdida que resulte de valorar el instrumento de cobertura a su valor razonable es reconocida de forma inmediata en los resultados del periodo 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, 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 o 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 2024 y promedio del cuarto trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank-

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Liquidity Buffer 142,206 134,379

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:

Parámetro Descripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos

subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.

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

Scotiabank

(millones de pesos) Normal Escenario

Posible Escenario

Probable Escenario

Estrés

Gap 30d Gap Acum 75,31369,77869,77769,775

Cambios en el Gap respecto al escenario normal (5,535) (5,536) (5,538)

#### 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

Cifras expresadas en pesos

A) ANÁLISIS DE SENSIBILIDADES DEL PORTAFOLIO DE OPERACIONES DERIVADAS DE TASA.

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a diciembre 31, 2024

	0-3 Months	3-12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	10,743.00	557,493.00	(331,005.00)	158,457.00	159,117.00	(11,971.00)	542,834.00
CCS	4.00	(88.00)	(115.00)	198.00	528.00	107.00	634.00
Caps&Floors	763.00	(3,944.00)	(2,445.00)	1,130.00	(16.00)	(1.00)	(4,513.00)
Binary Caps&Floors	-----						
F TIE Futures	-----						
Total	11,510.00	553,461.00	(333,565.00)	159,785.00	159,629.00	(11,865.00)	538,955.00

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD

SUPUESTOS DE CÁLCULO.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIE, 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 04 AÑO: 2024

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 13 / 18

CONSOLIDADO

INFORMACIÓN DICTAMINADA

Impresión Final

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 (37.08) Millones de pesos.
  - b) Con escenario poco probable un P&L de (74.16) Millones de pesos.
  - c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (158.46) Millones de pesos.
- Los escenarios de stress están basados en el movimiento al alza que pudieran tener las tasas de interés, en el escenario probable de 50 pb, en el escenario poco probable de 100 pb y en el escenario muy poco probable 200pb. Los escenarios se muestran a continuación.

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	0.54211	1.8150.00	(26.95)100.00	(53.90)200.00
				(107.79)			
		Volatilidad al 1%	Caps & Floors	-1.630	1.0(0.00)0.40	-1.00	
		a FX %	Forwards	4.85101	1.330.10(10.13)0.20	(20.27)0.50	(50.66)
		a FX %	Opciones Divisa	--0.100	0.000.20	-0.50	
		Total		(37.08)	(74.16)	(158.46)	

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 2024 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options AAPL.OQ---			
Options AMZN.OQ---			
Options BNPUI5.INDX---			
Options EEM.P---			
Options ENHFO5.INDX---			
Options ENHGE5.INDX---			
Options FXI.P---			
Options GOOG.OQ---			
Options ICLN.OQ---			
Options IDBTV1.INDX---			
Options META.OQ---			
Options MEXIPC.INDX---			
Options MSFDV1.INDX---			
Options QQQ.OQ---			
Options SHELL.AS---			
Options SOXX.OQ---			
Options SPX.INDX---			
Options SPXFP.INDX---			
Options SPXSR5.INDX---			
Options VLO.N---			
TOTAL---			



## Análisis de Stress

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

Escenarios a la baja(0.1) (0.3) (0.5)

Options AAPL.OQ---  
Options AMZN.OQ---  
Options BNPUI5.INDX---  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX---  
Options META.OQ---  
Options MEXIPC.INDX---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SHELL.AS---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPX.INDX---  
Options SPXFP.INDX---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
TOTAL---

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

Escenarios al alza0.050.150.2

Options AAPL.OQ---  
Options AMZN.OQ---  
Options BNPUI5.INDX---  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX---  
Options META.OQ---  
Options MEXIPC.INDX---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SHELL.AS---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPX.INDX---  
Options SPXFP.INDX---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
Total---

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:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04** AÑO: **2024**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 15 / 18

**CONSOLIDADO**

**INFORMACIÓN DICTAMINADA**

**Impresión Final**

EscenarioMonto  
Probable-  
Poco Probable-  
Muy poco Probable-

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 2024 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte Colateral Recibido MXN Colateral Enviado MXN Colateral Recibido USD Colateral Enviado USD

CLIENTE 1--12,745,000 (23,770,000)  
CLIENTE 21,060,000,000 (1,269,000,000) --  
CLIENTE 3--200,000 (11,635,000)  
CLIENTE 4--22,900,000-  
CLIENTE 542,300,170 (376,822,600) 24,650,000 (60,125,000)  
CLIENTE 6--13,730,000 (24,260,000)  
CLIENTE 7--268,550,000 (143,130,000)  
CLIENTE 8--189,100,000 (173,300,000)  
CLIENTE 9--8,610,000 (420,000)  
CLIENTE 10--- (100,000)  
CLIENTE 11--50,760,000 (22,140,000)  
CLIENTE 1293,000,000 (127,500,000) --  
CLIENTE 13348,600,000 (327,400,000) --  
CLIENTE 14136,500,000 (181,700,000) 184,620,000 (158,050,000)  
CLIENTE 1566,213,453 (2,871,151,000) --  
CLIENTE 1616,300,000 (22,300,000) --  
CLIENTE 17--1,850,000 (140,000)  
CLIENTE 18--1,870,000 (1,260,000)  
CLIENTE 19--220,000 (3,640,000)  
CLIENTE 20--15,150,000 (22,100,000)  
CLIENTE 212,700,000 (35,800,000) --  
TOTAL 1,765,613,623 (5,211,673,600) 794,955,000 (644,070,000)

REVELACIÓN DE CUALQUIER INCUMPLIMIENTO QUE SE HAYA PRESENTADO A LOS CONTRATOS RESPECTIVOS

DESCRIBIR Y NUMERAR LOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS QUE HAYAN VENCIDO DURANTE EL TRIMESTRE

Cifras expresadas en pesos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2024**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 16 / 18

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2024**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 17 / 18

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **04**

AÑO: **2024**

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

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 18 / 18

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS  
Cifras expresadas en pesos

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

---