

Scotiabank Inverlat

BANCO LÍDER EN LAS AMÉRICAS

Scotiabank[®]

Scotiabank Indicadores Financieros	2021	2020			
	T1	T4	T3	T2	T1
ROE (Utilidad neta del trimestre anualizada / Capital contable promedio)	11.4	7.9	2.6	1.4	10.3
ROA (Utilidad neta del trimestre anualizada / Activo total promedio)	1.0	0.7	0.2	0.1	0.9
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.2	2.8	2.2	2.2	2.7
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	3.0	3.0	3.0	2.8	3.0
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	3.57	3.05	2.62	2.58	2.31
Índice de Cobertura de Cartera de Crédito Vencida (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre)	116.1	134.8	143.8	125.0	121.4
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	17.00*	15.94	15.91	15.14	14.43
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	14.51*	13.91	13.85	13.44	12.91
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	69.1	64.0	76.5	65.9	65.8

* Sujeto a aprobación del Banco Central.

Scotiabank Información Financiera Condensada (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021	A/A Δ%
Ingresos por intereses	12,722	11,208	10,968	-14%
Gastos por intereses	(6,764)	(4,779)	(4,658)	31%
Margen Financiero	5,958	6,429	6,310	6%
Comisiones	1,030	1,004	1,084	5%
Intermediación	742	508	204	-73%
OI OE	495	592	465	-6%
Ingresos no Financieros	2,267	2,104	1,753	-23%
Ingresos	8,225	8,533	8,063	-2%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(2,003)	(2,153)	(1,349)	33%
Total Ingresos	6,222	6,380	6,714	8%
Gastos de Administración y Promoción	(4,592)	(4,960)	(4,805)	-5%
Resultado de la Operación	1,630	1,420	1,909	17%
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	-	-	(1)	0%
Utilidad antes de Impuestos a la Utilidad	1,630	1,420	1,908	17%
Impuestos a la Utilidad	(246)	(338)	(296)	-20%
Utilidad después de Impuestos a la Utilidad	1,384	1,082	1,612	16%

En el primer trimestre de 2021, la utilidad neta consolidada de Scotiabank Inverlat, S.A. de C.V. (Scotiabank), se ubicó en \$1,612 millones, un incremento anual de \$228 millones o 16%, debido principalmente a un menor requerimiento de reservas crediticias y a mayores ingresos por margen financiero; compensado parcialmente por mayores gastos de administración y promoción, así como menores ingresos no financieros principalmente por una mayor utilidad cambiaria en 2020.

Respecto al trimestre anterior la utilidad neta mostró un incremento de \$530 millones o 49%, debido principalmente a un menor requerimiento de reservas crediticias, así como menores ingresos totales debido a una mayor utilidad por venta de títulos disponibles para la venta en el cuarto trimestre de 2020 y a menores ingresos en el margen financiero.

Las principales variaciones se ven reflejadas en los cuadros siguientes:

Scotiabank Comisiones y Tarifas (netas)	3 meses			
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021	A/A Δ%
Comisiones de Crédito	108	132	154	43%
Manejo de cuenta	83	77	66	-20%
Tarjeta de Crédito y Débito	450	452	414	-8%
Actividades fiduciarias	49	46	48	-2%
Servicios de banca electrónica	119	120	120	1%
Compraventa de valores	14	9	14	0%
Cartas de crédito sin refinanciamiento	44	43	42	-5%
Otras	163	125	226	39%
Total de Comisiones y Tarifas (netas)	1,030	1,004	1,084	5%

Scotiabank Otros Ingresos/Egresos de la Operación	3 meses			
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021	A/A Δ%
Otras Recuperaciones	3	-	-	-100%
Gastos por Adquisición de Cartera de Crédito	(7)	(1)	(2)	71%
Castigos y Quebrantos	(138)	(196)	(195)	-41%
Resultado neto por Venta de Bienes Adjudicados	26	52	55	> +100%
Intereses por Préstamos a Empleados	1	1	1	0%
Ingresos por Arrendamiento	21	18	19	-10%
Otras partidas de los Ingresos/Egresos de la operación	589	718	587	0%
Pérdida por Cesión de Cartera de Crédito	-	-	-	0%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación	495	592	465	-6%

Scotiabank Gastos de Administración y Promoción	3 meses			
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021	A/A Δ%
Gastos de Personal	(75)	(75)	(103)	-37%
Gastos de Operación	(4,517)	(4,885)	(4,702)	-4%
Total de Gastos de Administración y Promoción	(4,592)	(4,960)	(4,805)	-5%

En el primer trimestre de 2021, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$1,349 millones, una disminución de \$654 millones o 33% respecto al mismo periodo del año anterior; debido a la reducción de reservas voluntarias por \$302 millones y menores requerimientos en la cartera comercial, tarjeta de crédito, automotriz y consumo; compensados parcialmente por mayores requerimientos en la cartera hipotecaria.

Respecto al trimestre anterior, la estimación preventiva para riesgos crediticios muestra una disminución de \$804 millones o 37%, debido principalmente a la creación de reservas voluntarias en 2020 y reducción de \$302 millones en 2021, así como menores requerimientos en la cartera de consumo, tarjeta de crédito, automotriz e hipotecaria; compensado parcialmente por mayores requerimientos en la cartera comercial.

Scotiabank Impuestos	3 meses			
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021	A/A Δ%
Impuesto a la Utilidad Causado	(1,179)	(770)	(456)	61%
Impuesto a la Utilidad Diferido	933	432	160	-83%
Total de Impuestos a la Utilidad	(246)	(338)	(296)	-20%

En el primer trimestre de 2021, se registró un impuesto neto a cargo por \$296 millones, un incremento de \$50 millones respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por una mayor utilidad en el periodo.

Respecto al trimestre anterior, el total de impuestos netos disminuyó \$42 millones, debido a una mayor inflación registrada en el periodo.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021	A/A Δ%
Caja, bancos, Valores	176,163	210,986	214,496	22%
Cartera Vigente	435,945	402,545	408,907	-6%
Cartera Vencida	10,301	12,661	15,159	47%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(12,504)	(17,063)	(17,602)	41%
Otros Activos	36,620	28,634	35,978	-2%
Activo Total	646,525	637,763	656,938	2%
Depósitos	410,461	406,125	410,719	0%
Préstamos bancarios	61,897	66,612	62,421	1%
Obligaciones Subordinadas	9,091	9,052	9,094	0%
Otros Pasivos	110,809	100,653	117,365	6%
Capital	54,267	55,321	57,339	6%
Total Pasivo y Capital	646,525	637,763	656,938	2%

Al 31 de marzo de 2021, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$656,938 millones, un incremento de \$10,413 millones o 2% respecto al cierre de marzo de 2020. Este incremento anual se debió principalmente por mayores volúmenes inversiones en valores gubernamentales principalmente en títulos disponibles para la venta y de negociación, así como en deudores por reporto; parcialmente compensados por un menor volumen en cartera de crédito vigente, crecimiento en la estimación preventiva para riesgos crediticios, menores disponibilidades (préstamos interbancarios “call money”) y derivados.

Respecto al cierre del trimestre anterior, los activos totales incrementaron \$19,175 millones o 3%, debido principalmente mayores volúmenes en inversiones en valores gubernamentales principalmente en títulos de negociación, mayores volúmenes en cartera de crédito total, en deudores por liquidación de operaciones y reporto; compensado parcialmente por menores volúmenes en derivados con fines de negociación, en disponibilidades y en deudores por colaterales otorgados en efectivo.

El total del pasivo ascendió a \$599,599 millones al 31 de marzo de 2021, un incremento de \$7,341 millones o 1% respecto al año pasado. Este incremento fue resultado principalmente de mayores volúmenes en acreedores por reporto; compensados parcialmente por menores acreedores por liquidación de operaciones, valores asignados por liquidar y derivados.

Respecto al trimestre anterior, el pasivo total incrementó \$17,157 millones o 3%, debido principalmente a mayores acreedores por reporto y deposito; los cuales fueron compensados parcialmente por derivados con fines de negociación.

La cartera vigente de préstamos de menudeo, creció \$1,231 millones o 1% respecto al año pasado y disminuyó \$3,217 millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual fue impulsado por un mayor volumen en la cartera hipotecaria por \$8,752 millones o 6%; parcialmente compensado con un menor volumen en tarjeta de crédito y otros préstamos personales por \$7,521 millones o 17%. La disminución trimestral, fue debido principalmente a un menor volumen en tarjeta de crédito y otros préstamos personales.

El total de préstamos vigentes con entidades comerciales, financieras y gubernamentales mostró una disminución anual de \$28,269 u 11% y un incremento trimestral de \$9,579 millones o 4%. La disminución anual se debió a un menor volumen en créditos comerciales, entidades financieras y gubernamentales. El incremento trimestral se debió a un mayor volumen en los créditos comerciales y en entidades gubernamentales; compensados parcialmente con un menor volumen en créditos a entidades financieras.

Los depósitos de clientes se ubicaron en \$368,953 millones, un incremento de \$43,461 millones o 13% respecto al año pasado y de \$11,978 millones o 3% respecto al trimestre anterior.

Al 31 de marzo de 2021, el total de depósitos se ubica en \$410,719 millones, sin cambios significativos respecto al año pasado. Los depósitos a la vista y ahorro aumentaron \$23,735 millones o 14% y los depósitos a plazo mostraron una disminución de \$17,200 millones o 9%.

Respecto al trimestre anterior, el total de depósitos aumentó \$4,594 millones o 1%, debido a un incremento en depósitos a plazo del público en general; compensado casi en su totalidad con una disminución de 2% en los depósitos vista y ahorro y de 48% en mercado de dinero.

Los títulos de crédito emitidos mostraron una disminución anual de \$6,264 millones o 16%, debido principalmente al vencimiento de certificados bursátiles. Respecto al trimestre anterior, sin cambios significativos.

Las principales variaciones se ven reflejadas en los cuadros siguientes:

Scotiabank – Cartera de Crédito Vigente (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	43,717	39,036	36,196	-17%
Créditos a la Vivienda	137,081	146,210	145,833	6%
Total Préstamos de Menudeo	180,798	185,246	182,029	1%
Actividad Empresarial o Comercial	204,333	179,410	186,316	-9%
Entidades Financieras	36,406	28,878	27,583	-24%
Entidades Gubernamentales	14,408	9,011	12,979	-10%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	255,147	217,299	226,878	-11%
Total Cartera Vigente	435,945	402,545	408,907	-6%

Scotiabank – Cartera de Crédito Vencida (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021	A/A Δ%
Cartera Vencida	10,301	12,661	15,159	47%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(12,504)	(17,063)	(17,602)	41%
Cartera Vencida Neta	(2,203)	(4,402)	(2,443)	-11%
Cartera Vencida Bruta a Cartera Total	2.31%	3.05%	3.57%	127 pb

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021	A/A Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro	174,340	202,354	198,075	14%
Público en General	151,152	154,621	170,878	13%
Mercado de Dinero	45,005	15,536	8,079	-82%
Total Depósitos a Plazo	196,157	170,157	178,957	-9%
Títulos de Crédito Emitidos	39,375	33,000	33,111	-16%
Cuenta global de captación sin movimientos	589	614	576	-2%
Total de Depósitos	410,461	406,125	410,719	0%

Scotiabank
Composición de Inversiones en Valores
(millones de pesos al 31 de marzo de 2021 valor razonable)

Categoría	Deuda		Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda		Total
	Gubernamental	Deuda Bancaria				
Títulos para negociar	65,844	-	6	14	65,864	
Sin restricción:	-	-	-	-	-	
Restringidos:	65,844	-	6	14	65,864	
<i>En operaciones de reporto</i>	61,681	-	-	14	61,695	
<i>Préstamos de valores</i>	844	-	-	-	844	
<i>Otros</i>	3,319	-	6	-	3,325	
Títulos disponibles para la venta	50,423	13,797	-	699	64,919	
Sin restricción:	48,438	13,797	-	699	62,934	
Restringidos:	1,985	-	-	-	1,985	
<i>En operaciones de reporto</i>	1,580	-	-	-	1,580	
<i>Otros</i>	405	-	-	-	405	
Títulos conservados a vencimiento	5,071	-	-	-	5,071	
Sin restricción	5,071	-	-	-	5,071	
Total	121,338	13,797	6	713	135,854	

Scotiabank
Inversiones en Valores no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)
(millones de pesos al 31 de marzo de 2021)

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I-BANSAN-21165	11,936,096,663	3.90%	28	11,905

Scotiabank
Derivados y operaciones de cobertura
(millones de pesos al 31 de marzo de 2021; valor razonable)

	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		
Con fines de Negociación	1,049	1,157	-	-	509	327	251	291	12,583	13,026	-	-	14,392	14,801
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	4,836	5,885	-	-	4,836	5,885

Scotiabank
Montos nacionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de marzo de 2021)

	Contratos adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de instrumentos Derivados	
	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva
Con fines de negociación												
Posición USD	1,964	1,812	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN							130	130				
Divisas USD	-	-	-	-	4	4	335	335	-	-	-	-
Posición JPY	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	2	1	-	-	-	-	1	1	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	483	254	356	200	-	-	-	-
Acciones USD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	428	2,110	2,110	428	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	1	1	23,986	23,935	302,465	302,739	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	134	132	1,234	1,694	-	-
CLF Chilena	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Euros									25			
Pesos Colombianos									177,500			
Con fines de cobertura												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	45,503	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	473	5	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	4	-	-	-

Scotiabank Cartera de Crédito Vigente (millones de pesos al 31 de marzo de 2021)	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	145,998	40,318	186,316
Créditos a entidades financieras	26,742	841	27,583
Créditos a entidades gubernamentales	12,979	-	12,979
Créditos al consumo	36,196	-	36,196
Créditos a la vivienda	145,800	33	145,833
Total	367,715	41,192	408,907

Scotiabank Cartera de Crédito Vencida (millones de pesos al 31 de marzo de 2021)	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	4,843	142	4,985
Créditos a entidades financieras	121	-	121
Créditos al consumo	3,422	-	3,422
Créditos a la vivienda	6,568	63	6,631
Total	14,954	205	15,159

Scotiabank	
Variaciones de Cartera Vencida	
(millones de pesos)	
Saldo al 31 de diciembre de 2020	12,661
Traspaso de Cartera Vigente a Vencida	3,420
Recuperaciones	(16)
Quitas y Castigos	(914)
Fluctuación Tipo de Cambio	8
Saldo al 31 de marzo de 2021	15,159

Scotiabank	
Estimaciones preventivas para riesgos crediticios	
(millones de pesos)	
Saldo al 31 de diciembre de 2020	17,063
Más: Creación de reservas	1,444
Menos: Liberaciones	-
Cancelaciones	-
Adjudicaciones y otros	14
Castigos y quitas	914
Comercial	174
Hipotecario	46
Consumo	694
Castigos y aplicaciones por programa de apoyo	-
Desliz cambiario	(23)
Saldo al 31 de marzo de 2021	17,602

Scotiabank	31 mar	31 dic	31 mar
Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito	2020	2020	2021
Cartera Vigente			
Metropolitano	58.6%	56.5%	57.4%
Noroeste – Centro	10.9%	11.9%	12.1%
Norte	16.0%	15.9%	15.8%
Bajío	8.6%	9.3%	8.7%
Sur	5.9%	6.4%	6.0%
Cartera Vencida			
Metropolitano	39.3%	37.6%	41.3%
Noroeste – Centro	21.1%	21.1%	18.8%
Norte	11.6%	11.1%	10.6%
Bajío	9.8%	9.7%	9.5%
Sur	18.2%	20.5%	19.8%

Scotiabank		
Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico		
(millones de pesos al 31 de marzo de 2021)		
No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
1	11,030	21.38%
2	7,465	14.47%
3	6,848	13.27%
4	6,507	12.61%
5	5,903	11.44%
6	5,652	10.96%
7	5,219	10.12%
Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos		25,343

Scotiabank
Calificación de la Cartera Crediticia
Al 31 de marzo de 2021
(millones de pesos)

	Importe Cartera Crediticia	Cartera Comercial	Reservas Preventivas Necesarias			Total Reservas Preventivas
			No Revolventes	Consumo Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes	Cartera de Vivienda	
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	311,232	875	104	372	235	1,586
Riesgo A2	70,943	716	34	195	14	959
Riesgo B1	20,876	295	47	68	11	421
Riesgo B2	11,983	138	47	42	55	282
Riesgo B3	12,755	308	18	47	49	422
Riesgo C1	4,445	95	28	98	60	281
Riesgo C2	3,438	29	40	178	197	444
Riesgo D	7,642	1,024	79	535	1,011	2,649
Riesgo E	8,649	2,700	1,641	1,459	923	6,723
Total	451,963	6,180	2,038	2,994	2,555	13,767
Exceso						3,835
Reservas Constituidas						17,602

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 marzo de 2021.
- La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, pudiendo calificarse por metodologías internas autorizadas por la Comisión.

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$ -
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	73
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos	300
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	<u>3,462</u>
Total	\$ 3,835

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 marzo de 2021 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en valores - Títulos conservados al vencimiento” son:

Scotiabank			
Terminación anticipada de los programas hipotecarios			
Cetes especiales			
(millones de pesos)			
	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 220707	3,961,831	515	07-jul-22
B4 220804	21,792	3	04-ago-22
B4 270701	11,209,686	1,458	01-jul-27
BC 220804	3,115	-	04-ago-22
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	15,196,430	1,976	

Scotiabank			
Tasas Pagadas en Captación Tradicional			
(millones de pesos al 31 de marzo de 2021)			
	Pesos	Tasa Promedio Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	1.85%	0.04%	-
Depósitos a plazo	3.98%	0.00%	-

Scotiabank						
Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos						
(millones de pesos al 31 de marzo de 2021)						
Vencimiento	Préstamos		Financiamiento		Otros	Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	8,500	10,915	2,935	22,350
Largo	-	1,107	22,582	6,342	-	30,031
Total	-	1,107	31,082	17,257	2,935	52,381
Tasa Promedio	0.00%	4.03%	5.71%	4.55%	4.66%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	7,189	-	19	410	-	7,618
Largo	-	-	-	374	2,048	2,422
Total	7,189	-	19	784	2,048	10,040
Tasa Promedio	0.25%	0.00%	2.36%	0.88%	0.87%	
Total Préstamos Interbancarios	7,189	1,107	31,101	18,041	4,983	62,421

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 marzo de 2021.

Scotiabank Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	31 mar 2020	31 dic 2020	31 mar 2021
Depósitos a la Vista	47.1%	54.3%	52.6%
Metropolitano	24.5%	24.3%	23.8%
Noroeste – Centro	6.5%	10.5%	10.4%
Norte	6.1%	8.1%	7.4%
Bajío	4.8%	5.5%	5.3%
Sur	5.2%	5.9%	5.7%
Depósitos Ventanilla	40.8%	41.5%	45.3%
Metropolitano	17.0%	20.7%	20.4%
Noroeste - Centro	5.7%	5.1%	5.4%
Norte	8.0%	7.0%	9.4%
Bajío	5.4%	3.9%	4.7%
Sur	4.7%	4.8%	5.4%
Total de Captación del Público	87.9%	95.8%	97.9%
Fondeo Profesional	12.1%	4.2%	2.1%

Scotiabank Impuestos Diferidos (millones de pesos al 31 de marzo de 2021)		
Pérdida de arrastre fiscal		8
Provisión por perdidas de crédito		5,257
Compensación diferida		(1,035)
Ingresos diferidos		592
Instalaciones y equipos / depreciación		649
Beneficios a los empleados		352
Provisiones		378
Otros		452
Efecto Neto en Diferido		6,653

Al 31 de marzo de 2021, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank Resultados por Intermediación (millones de pesos al 31 de marzo de 2021)		
	Resultados del periodo por Valuación	Resultados del periodo por Compra - Venta
Inversiones en valores	(83)	196
Operaciones con instrumentos financieros derivados de negociación y cobertura	(738)	346
Divisas y otros	45	438
Total	(776)	980

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

Programas de apoyo

Mediante oficios número P285/2020 y P293/2020 de fecha 26 de marzo y 15 de abril de 2020, respectivamente, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV) determinó emitir con carácter temporal, los CCE aplicables a los programas de apoyo otorgados por el Banco. Posteriormente, mediante oficio número P-325/2020 de fecha 23 de junio de 2020, la CNBV indicó lo siguiente:

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

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

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

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

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

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

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

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

El detalle por tipo de cartera de los importes que se hubieran registrado y presentado en el balance general consolidado y en el estado consolidado de resultados al 31 de marzo de 2021, de no haber aplicado los criterios contables especiales se presenta a continuación:

Concepto	Saldos apoyo COVID	Efectos (Cartera de Crédito y EPRC)	Saldo sin apoyo COVID
Balance General			
Cartera de crédito vigente			
Créditos comerciales	226,878	(130)	226,748
Créditos consumo	36,196	(2,010)	34,186
Créditos vivienda	145,833	(3,405)	142,428
Subtotal cartera vigente	408,907	(5,545)	403,362
Cartera de crédito vencida			
Créditos comerciales	5,106	98	5,204
Créditos consumo	3,422	1,643	5,065
Créditos vivienda	6,631	3,335	9,966
Subtotal cartera vencida	15,159	5,076	20,235
Total Cartera de crédito	424,066	(469)	423,597
(Menos) Estimación preventiva para riesgos crediticios			
Créditos comerciales	5,923	46	5,969
Créditos consumo	5,032	467	5,499
Créditos vivienda	2,555	1,303	3,858
Operaciones contingentes y avales	257	0	257
Estimación preventiva para riesgos crediticios derivada de la calificación	13,767	1,816	15,583
Estimación preventiva para riesgos crediticios adicional	3,835	(1,401)	2,434
Total Estimación preventiva para riesgos crediticios	17,602	415	18,017
Cartera de crédito (neta)	406,464	(884)	405,580
Cuentas de Orden			
Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	759	140	899
Estado de Resultados			
Ingresos por intereses de Cartera			
Créditos comerciales	3,264	(10)	3,254
Créditos consumo	1,737	2	1,739
Créditos vivienda	3,662	102	3,764
Total Ingresos por intereses de Cartera	8,663	94	8,757
Estimación preventiva para riesgos crediticios			
Créditos comerciales	351	40	391
Créditos consumo	825	(66)	759
Créditos vivienda	375	(308)	67
Operaciones contingentes y avales	24	0	24
Estimación preventiva para riesgos crediticios derivada de la calificación	1,575	(334)	1,241
Estimación preventiva para riesgos crediticios adicional	(226)	2,349	2,123
Total Estimación preventiva para riesgos crediticios	1,349	2,015	3,364

¹El Banco ha constituido a la fecha \$3,750 millones de reservas adicionales por efectos de COVID-19, con la finalidad de cubrir riesgos incrementales que no se encuentran actualmente previstos en las diferentes metodologías de calificación; las cuales cubren las necesidades en caso de no contar con criterios contables especiales. En el primer trimestre de 2021, Banco aplicó \$302 millones.

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

Emisión de Certificados Bursátiles

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

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

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

* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

** Programa autorizado por la CNBV en septiembre de 2015

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

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

Emisión de Obligaciones Subordinadas

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

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
BONO SCOTIAB 2-19	716,915	11-abr-19	09-abr-21	729	NIKKEI 225	71,691,500
BONO SCOTIAB 4-19	980,100	22-may-19	21-may-21	730	S&P/TSX 60	98,010,000
BONO SCOTIAB 6-19	238,250	04-jun-19	03-jun-21	730	S&P/TSX 60	23,825,000
BONO SCOTIAB 9-19	1,403,500	25-jul-19	22-jul-21	728	TIEE28	140,350,000
BONO SCOTIAB 12-19	529,100	22-nov-19	22-nov-21	731	MSFDVTHY INDEX	52,910,000
BONO SCOTIAB 13-19	663,200	22-nov-19	22-nov-22	1,096	MSFDVTHY INDEX	66,320,000
BONO SCOTIAB 05-20	1,930,500	19-feb-20	17-feb-23	1,094	MSFDVTIG IDEX	193,050,000
BONO SCOTIAB 06-20	6,515,910	27-mar-20	27-mar-23	1,095	MSFDVTIG IDEX	651,591,000
BONO SCOTIAB 07-20	7,956,100	14-may-20	12-may-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	795,610,000
BONO SCOTIAB 08-20	415,850	11-jun-20	09-jun-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	41,585,000
BONO SCOTIAB 09-20	633,800	28-dic-20	27-dic-21	364	USDMXN	63,380,000
BONO SCOTIAB 01-21	238,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	23,884,500
BONO SCOTIAB 02-21	212,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLF)	21,284,500
BONO SCOTIAB 03-21	1,845,220	08-mar-21	30-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	184,522,000
BONO SCOTIAB 04-21	102,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
Total Bonos Bancarios al 31 de marzo de 2021						\$2,438,213,500

Capitalización

Scotiabank Integración del Capital Revelación de la integración del Capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios. (millones de pesos al 31 de marzo de 2021)		
Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	10,877
2	Resultado de ejercicios anteriores	39,451
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	7,010
4	Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1 (solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones)	No aplica
5	Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital común de nivel 1)	No aplica
6	Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	57,338
7	Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios	
	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-
12	Reservas pendientes de constituir	-
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	-
14	Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable	No aplica
15	Plan de pensiones por beneficios definidos	-
16 conservador	Inversiones en acciones propias	-
17 conservador	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	-
18 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
19 conservador	Inversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
20 conservador	Derechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%)	-
21	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo)	1,640
22	Monto que excede el umbral del 15% del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
23	del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
24	del cual: Derechos de servicios hipotecarios	No aplica
25	del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales	No aplica
26	Ajustes regulatorios nacionales	6,366
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	6,029
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	337
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones	-
28	Ajustes regulatorios totales al capital común	8,006
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	49,332
	Capital adicional de nivel 1: instrumentos	
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,480
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,480
32	de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables	No aplica
33	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1	-
34	Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el renglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1)	No aplica
35	del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
36	Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	3,480
	Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios	
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde 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	Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1	-
44	Capital adicional de nivel 1 (AT1)	3,480
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	52,812
	Capital de nivel 2: instrumentos y reservas	
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	4,757
47	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2	-
48	Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel2)	No aplica
49	de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
50 conservador	Reservas	2,047
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	6,804
	Capital de nivel 2: ajustes regulatorios	
52 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53 conservador	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica

55 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2	-
58	Capital de nivel 2 (T2)	6,804
59	Capital total (TC = T1 + T2)	59,616
60	Activos ponderados por riesgo totales	410,839
Razones de capital y suplementos		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	12.01%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	12.85%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	14.51%
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)	15.11%
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)	5.01%
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)		
69	Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
70	Razón mínima nacional de T1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
71	Razón mínima nacional de TC (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)		
72	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
73	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
74	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica
75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2		
76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	2,047
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	2,047
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)	-

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

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

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

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

79	0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
80	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
81	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
82	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
83	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.
84	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
85	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

Scotiabank
Relación del Capital neto con el Balance General
(millones de pesos al 31 de marzo de 2021)

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Disponibilidades	25,945
BG2	Cuentas de Margen	2,786
BG3	Inversiones en valores	135,854
BG4	Deudores por reporto	30,660
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Derivados	19,228
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	227
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	406,464
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	19,439
BG11	Bienes adjudicados (neto)	144
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	1,647
BG13	Inversiones permanentes	3,240
BG14	Activos de larga duración disponibles para la venta	22
BG15	Impuestos y PTU diferidos (neto)	6,738
BG16	Otros activos	6,010
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	411,024
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	62,421
	Valores asignados por liquidar	4,309
BG19	Acreeedores por reporto	63,269
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	754
BG22	Derivados	20,686
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	12
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	27,917
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	9,094
BG27	Impuestos y PTU diferidos (neto)	-
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,580
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	10,877
BG30	Capital ganado	46,461
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	270,063
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	383,191

BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	54,240
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	40,111
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	984
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	144,011
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	759
BG41	Otras cuentas de registro	1,478,772

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 marzo de 2021)

Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
	ACTIVO			
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	-	
4	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	13	-	
5	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
6	Inversiones en acciones de la propia institución	16	-	
7	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	17	-	
8	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	
9	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	
10	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
11	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
12	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	1,640	BG 15 Impuestos y PTU Diferidos (Neto) \$1,640
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	2,047	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$2,047
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	6,029	BG 16 Activos Intangibles \$2,999 más Gastos de Instalación \$3,030
21	Participación de los trabajadores en la utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	337	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 337
	PASIVO			
24	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil	8	-	
25	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles	9	-	
26	Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
27	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por beneficios definidos	15	-	
28	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los anteriores	21	-	
29	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R	31	3,480	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,480
30	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental	33	-	
31	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S	46	4,757	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$4,757
32	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario	47	-	
33	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	-	
	CAPITAL CONTABLE			
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	10,877	BG 29 Capital Social \$10,404 más Prima en Venta de Acciones \$473
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	39,451	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$39,451
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	(377)	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo- \$377
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	7,387	BG 30 Reservas de Capital \$6,758 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta \$23 más Remedición por beneficios definidos a los empleados (\$1,006) más Resultado Neto \$1,612
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	

41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
	CUENTAS DE ORDEN			
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
	CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL	Identificador		
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	Estado de Resultados
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

Scotiabank

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

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

16	Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
17	Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
18	Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
19	Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de estas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
20	Cargos diferidos y pagos anticipados.
21	La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos que tengan ser deducidas de acuerdo con el Artículo 2 Bis 8 de las presentes disposiciones.
23	Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.
24	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al crédito mercantil.
25	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a otros intangibles (distintos al crédito mercantil).
26	Pasivos del plan de pensiones por beneficios definidos asociados a inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos.
27	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al plan de pensiones por beneficios definidos.
28	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales distintos los de las referencias 24, 25, 27 y 33.
29	Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.
30	Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital Básico no Fundamental.
31	Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.
32	Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario.
33	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a cargos diferidos y pagos anticipados.
34	Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-Q de las presentes disposiciones.
35	Resultado de ejercicios anteriores.
36	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a valor razonable.
37	Resultado neto y resultado por valuación de títulos disponibles para la venta.
38	Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.
39	Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a costo amortizado.
41	Efecto acumulado por conversión.
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios.
43	Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.
44	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
45	El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
46	Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
47	El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
48	Derogado

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	32,671	2,614
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,907	153
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's	1,923	154
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC	13	1
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	1,606	129
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	1,461	117
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	62	5
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	-	-
Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	3	0
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%)	683	55
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	3,874	310
Grupo III (ponderados al 23%)	-	-
Grupo III (ponderados al 25%)	44	4
Grupo III (ponderados al 50%)	2,447	196
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	-	-
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	3,146	252
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	524	42
Grupo V (ponderados al 50%)	132	11
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 20%)	-	-

Grupo VI (ponderados al 50%)	27,977	2,238
Grupo VI (ponderados al 75%)	21,135	1,691
Grupo VI (ponderados al 100%)	89,295	7,144
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%)	494	40
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	11,117	889
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	700	56
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	6,360	509
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	22	2
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	153,817	12,305
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	637	51
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%)	275	22
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%)	5,334	427
Grupo VIII (ponderados al 150%)	2,616	209
Grupo IX (ponderados al 100%)	14,974	1,198
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5, 6 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	5,073	406
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	19	2

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Estándar Alternativo	20,503	1,640
Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses		
	28,457	

Categoría Capitalización

Al 31 de marzo del 2021, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 11.10% (temporalmente este se ubica en 9.85%, por lo que también se cumple con ese criterio), por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

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

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

Scotiabank Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio

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

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

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

Suplemento de capital contracíclico de la Institución

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

Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en la Dirección Corporativa de Riesgos, la cual a su vez está organizada en 7 direcciones encaminadas a monitorear y mitigar los riesgos a los que está expuesto el Banco; lo anterior para garantizar una gestión adecuada de riesgos tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

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

Riesgo de mercado

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre del 31 de marzo de 2021 fue de \$9.99 y su promedio durante el primer trimestre de 2021 fue de \$16.16 mismo que corresponde a un 0.028% del capital neto (\$57,338 a marzo 2021). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del primer trimestre de 2021 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre marzo 2021	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	756,788	743,875
Mercado de Dinero	60,796	49,201
Tipo de cambio		
Cash	143	79
Derivados	106,173	90,856
Capitales		
Derivados	13,680	12,667

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre marzo 2021	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	11.75	18.80
Tipo de cambio	5.24	3.10
Capitales	0.24	0.31
VaR Global	9.99	16.16

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 primer trimestre de 2021 muestra una pérdida máxima de \$260.31. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, Mexico 1994 por el denominado “Error de diciembre” y Mexico 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 primer trimestre de 2021, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se han establecido límites, los cuales son revisados al menos de manera anual y monitoreados de manera periódica¹ a fin de que los mitigantes del riesgo estén actualizados y sean precisos. Entre los límites aplicables se encuentran aquellos relacionados a activos líquidos, brechas de liquidez, sensibilidad del margen y sensibilidad del valor económico, mismos que se encuentran alineados con el apetito de riesgo de la institución. La estructura de límites de riesgo de liquidez y tasas de interés contempla montos 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.

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de marzo 2021 así como el promedio del primer trimestre de 2021 se muestran a continuación:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)²	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	55,427	17,298
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	103,868	104,247

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales, incluyendo posiciones de derivados de cobertura. Adicionalmente, las exposiciones de riesgo de liquidez se encuentran dentro de los límites aprobados. Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez de frente a la contingencia sanitaria por COVID-19, con un CCL promedio durante el primer trimestre de 2021 de 145%, manteniéndose por arriba del 100%; así como una amplia reserva de activos líquidos.

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

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

Para la medición del riesgo de tasas de interés se emplean indicadores tales como sensibilidad del valor económico y sensibilidad de margen. Para el cálculo de dichos indicadores se utilizan brechas de reprecio, construidas con base en las tasas de referencia de activos y pasivos; para el caso de posiciones a tasa fija son modeladas acorde a sus amortizaciones y vencimientos contractuales, mientras que aquellas posiciones referenciadas a una tasa flotante se modelan en función a su próxima fecha de reprecio. La metodología para el cálculo de los indicadores considera supuestos de estabilidad de depósitos de exigibilidad inmediata y de prepago de hipotecas. El primero consiste en un análisis de cosechas a fin de evaluar la permanencia de los depósitos mientras que el segundo considera 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 ± 100 puntos base en las tasas de interés y considera la máxima pérdida esperada por escenario. Esta medición se realiza de manera semanal y se reporta a los miembros del Comité de Activos y Pasivos, al Comité de Riesgos y Consejo de Administración en sus respectivas sesiones.

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

² Cifras previas al cierre de marzo 2021.
Reporte del Primer Trimestre 2021

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de marzo 2021 y en promedio para el primer trimestre de 2021 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre³	Posición Promedio
Valor Económico (+100 pbs)	(695)	(740)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(541)	(641)

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Títulos Disponibles para la venta	92,436	84,886
Derivados de Cobertura	55,528	56,549

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 marzo 2021 y el promedio del primer trimestre del 2021 fueron \$1,363 y \$1,460, respectivamente.

Riesgo de crédito

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

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

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

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

³ En febrero 2021, el Comité de Riesgos aprobó las actualizaciones en los supuestos para el cálculo de sensibilidades por riesgo de tasas de interés.
Reporte del Primer Trimestre 2021

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Condiciones del diferimiento.

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

Elegibilidad de clientes.

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

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

Considerando la emergencia sanitaria por COVID-19 que se está presentando no solo en México sino a nivel mundial y que afecta el entorno económico y financiero, al 31 de diciembre de 2020, el Banco constituyó reservas adicionales por \$3,750 millones para cubrir riesgos incrementales que no se encuentran actualmente previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia.

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

Por lo tanto, las reservas adicionales fueron constituidas sin asignación directa inicial para algún portafolio, por lo que se trata de reservas genéricas que se aplican acorde con las necesidades particulares de cada portafolio. En el primer trimestre de 2021 se aplicaron \$302 millones.

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

Información metodológica

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito ¹ (Cifras al 31 de marzo 2021)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.4%	3.3%
Consumo	4.9%	11.0%
Cartera Comercial	1.0%	5.2%
Total	1.1%	5.0%

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

Parámetros de Riesgo ¹ (Cifras en millones de pesos al 31 de marzo 2021)	EI ²	PI	SP
Hipotecas	145,833	1.80%	18.76%
Consumo	51,509	6.18%	72.40%
Cartera Comercial	267,244	2.70%	43.09%

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

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

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de marzo de 2021.

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 marzo 2021 y en promedio durante el primer trimestre de 2021, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.03% y 0.03% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.17% y 0.37% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo Operacional

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

Metodología general

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

Políticas para la gestión de riesgo operacional

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

Evaluación de riesgo operacional

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

Manual para la recolección y clasificación de datos de riesgo operacional

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

Niveles de tolerancia de riesgo Operacional

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

Indicadores clave de riesgo (KRI)

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

Riesgo Legal

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

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

Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de enero – marzo 2021, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$177.6 MM, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de marzo 2021 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$207.5 MM, \$64.0 MM corresponden a riesgo operacional y \$143.5 MM a riesgo legal, el 100% de la exposición cuenta con provisiones.

Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

**Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)
Periodo Reportado: diciembre 2020 - marzo 2021**

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez⁴

(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES		
1 Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	103,604.35
SALIDAS DE EFECTIVO		
2 Financiamiento minorista no garantizado	141,363.50	10,565.91
3 Financiamiento estable	71,408.79	3,570.44
4 Financiamiento menos estable	69,954.71	6,995.47
5 Financiamiento mayorista no garantizado	188,679.23	70,291.45
6 Depósitos operacionales	64,792.05	14,901.64
7 Depósitos no operacionales	120,807.04	52,309.66
8 Deuda no garantizada	3,080.14	3,080.14
9 Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	487.41
10 Requerimientos adicionales:	287,272.81	23,724.30
11 Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	11,741.89	4,992.52
12 Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-
13 Líneas de crédito y liquidez	275,530.92	18,731.78
14 Otras obligaciones de financiamiento contractuales	26.32	26.32
15 Otras obligaciones de financiamiento contingentes	-	-
16 TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	105,095.39
ENTRADAS DE EFECTIVO		
17 Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	27,112.13	486.30
18 Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	32,353.40	19,281.58
19 Otras entradas de efectivo	13,914.05	13,914.05
20 TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	73,379.58	33,681.92
		Importe ajustado
21 TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	103,604.35
22 TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	71,413.47
23 COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ	No aplica	145.28⁵

(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 marzo 2021, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):⁶

o Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$38,639 y depósitos a plazo tradicionales por \$39,906, 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 \$2,408 y \$1,363 respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$18,676.

⁴ Anexo 5 de las disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple.

⁵ Cifras previas sujetas a confrontas de Banco de México.

⁶ 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.

- o Principales Entradas de Efectivo:
Entradas por flujo de carteras de \$15,630 y por operaciones de call money de \$6,062 y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$12,356.
- o Activos Líquidos:
Activos Líquidos totales de \$103,774 en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$80,650 en títulos de deuda de nivel 1, \$13,693 en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIEE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por \$6,418 y \$3,011 en títulos de nivel 2A.

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

Cierre de marzo 2021: 150% – cierre de diciembre 2020: 139% (incremento: 11%) El coeficiente de cobertura de liquidez aumentó 11% respecto de diciembre 2020, esto debido principalmente a:

- o El fondeo total del banco creció en MXN 5,262 MM, sin embargo, las salidas ponderadas decrecieron en \$1,835, debido a vencimientos en las emisiones de papel de la tesorería.
- o En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$6,637 y se presenta un incremento en entradas a 30 días por \$9,318, respecto al trimestre anterior.
- o Finalmente, los activos líquidos tuvieron un incremento de \$1,648.

(d) *La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables⁷;*

Evolución de Activos Líquidos T1-2021			
	Enero	Febrero	Marzo
Efectivo	6%	6%	6%
Reservas en el Banco Central	22%	22%	13%
Nivel 1	69%	69%	78%
Nivel 2 ^a	3%	3%	3%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

(e) *La concentración de sus fuentes de financiamiento;*

Concentración de fuentes de Financiamiento	Enero	Febrero	Marzo
CAPTACION TRADICIONAL			
Depósitos de exigibilidad inmediata	41%	42%	42%
Depósitos a plazo			
Del público en general	36%	35%	36%
Mercado de dinero	2%	2%	2%
Títulos de crédito emitidos	7%	7%	7%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	7%	7%	6%
De largo plazo	7%	7%	7%
Total	100%	100%	100%

⁷ Activos líquidos computables bajo los lineamientos establecidos por Banco de México.
Reporte del Primer Trimestre 2021

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

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

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

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

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

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

(Cifras en millones de pesos)	
Exposición Potencial Futura (Marzo 2021)	
Con contrato de compensación	2,229
Sin contrato de compensación	8,119
Posibles llamadas de margen (Marzo 2021)	
Colateral en Tránsito	39
Downgrade (Marzo 2021)	
Baja calificación 3 niveles	1,363

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de marzo 2021 es la siguiente:

Scotiabank Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	756,788
Tipo de cambio	106,173
Capitales	13,680
Total	876,641

(g) *El descalce en divisas;*

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

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

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

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

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

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

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

Concentración de Depósitos ⁸	
Concepto	Límite MM
Concentración de Depósitos (MXN)	7,000 MXN
Concentración de Depósitos (USD)	100 USD

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

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

⁸ Sujeto a excepciones para algunos nombres.

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

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

(b) 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 marzo 2021 y el promedio del primer trimestre de 2021 son:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ⁹	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	55,427	17,298
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	103,868	104,247

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.

⁹ Cifras previas al cierre de marzo 2021.

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:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el primer trimestre de 2021, 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 primer trimestre 2021, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 10).

Posiciones en Acciones

Al cierre de marzo de 2021 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$5.21 millones de pesos, con una minusvalía de \$0.11 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1-GFINBUR-O	163,834	3.04	3.00	0.04
Scotiabank	Pública	1-CHDRAUI-B	6,042	0.20	0.19	0.01
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	357,639	1.97	2.13	(0.16)
Total			527,515	5.21	5.32	(0.11)

Al cierre del primer trimestre del año 2021, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$1.78 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1GCARSOA1	72,128	0.07	(0.04)	0.03
Scotiabank	Pública	1GMEXICOB	98,523	0.14	(0.01)	0.13
Scotiabank	Pública	1KIMBERA	76,298	0.20	0.00	0.20
Scotiabank	Pública	1APBRN	24,374	0.20	(0.05)	0.15
Scotiabank	Pública	1LIVEPOLC-1	170,094	0.03	(0.25)	(0.22)
Scotiabank	Pública	1PE&OLES*	12,924	0.02	(0.08)	(0.06)
Scotiabank	Pública	1IEWZ*	8,300	0.24	0.00	0.24
Scotiabank	Pública	1GFINBURO	425,686	0.12	(0.06)	0.06
Scotiabank	Pública	1ITWM*	5,000	0.05	0.00	0.05
Scotiabank	Pública	1SHV*	3,625	0.12	(0.01)	0.11
Scotiabank	Pública	1IPSQ*	21	0.00	0.00	0.00
Scotiabank	Pública	1CHDRAUIB	394,401	0.58	(0.08)	0.50
Scotiabank	Pública	1AC*	121,751	0.19	(0.01)	0.18
Scotiabank	Pública	1BNAFTRACISHRS	114,775	0.00	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1WALMEX*	32,000	0.03	0.00	0.03
Scotiabank	Pública	1NEMAKA	872,059	0.09	(0.03)	0.06
Scotiabank	Pública	1ELEMENT*	1,222	0.00	0.00	0.00
Scotiabank	Pública	1BRZU*	3,300	0.43	(0.06)	0.37
Scotiabank	Pública	41BSMXB	208,269	0.05	(0.08)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1FEMSAUBD	47,698	0.11	0.00	0.11
Scotiabank	Pública	1KOFUBL	196,766	0.25	(0.04)	0.21
Scotiabank	Pública	1IIBO1N	6,762	0.00	0.00	0.00
Scotiabank	Pública	1AFSLY*	2,700	0.00	(0.50)	(0.50)
Scotiabank	Pública	1ALFAA	576,219	0.13	(0.08)	0.05
Scotiabank	Pública	1BIMBOA	30,886	0.03	0.00	0.03
Scotiabank	Pública	1AMXL	995,000	0.24	(0.14)	0.10
Total			4,500,781	3.32	(1.54)	1.78

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

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

Al 31 de marzo de 2021, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$4.99 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$1.70 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$3.29 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización					
Por Riesgo General de Mercado	POSICIONES			Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición		
	16.73	24.39	7.67	22.23%	1.70
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	8.02	24.39	32.41	8.00%	2.59
Índices accionarios	8.71	-	8.71	4.00%	0.35
Requerimiento por riesgos	8.71	-	8.71	4.00%	0.35
			Total Requerimiento de capital		4.99

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	Dic-20	Mar-21
	Exposiciones dentro del balance		
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	586,347	608,515
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(7,315)	(8,006)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	579,031	600,509
	Exposiciones a instrumentos financieros derivados		
4	Costo actual de reemplazo asociado a <i>todas</i> las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	6,835	4,100
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	3,062	2,891
6	Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo		
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	(8,840)	(6,909)
8	(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)		
9	Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos		
10	(Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)		
11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)	1,057	82
	Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	27,835	30,890
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(27,835)	(30,660)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	12	-
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-	-
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	12	230
	Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	276,490	270,063
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(196,431)	(194,813)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	80,059	75,250
	Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	51,587	52,812
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	660,160	676,071
	Coefficiente de apalancamiento		
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	7.81%	7.81%

Cifras en millones de pesos

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Dic-20	Mar-21
1	Activos totales	638,178	658,404
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	(286)	(337)
3	Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento		
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	(22,939)	(19,147)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(27,823)	(30,430)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	80,059	75,250
7	Otros ajustes	(7,029)	(7,669)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	660,160	676,071

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Dic-20	Mar-21
1	Activos totales	638,178	658,404
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(23,996)	(19,229)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(27,835)	(30,660)
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	586,347	608,515

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

CONCEPTO/PERIODO	Dic-20	Mar-21	Variación
Capital Básico ^{1/}	51,587	52,812	2.37%
Activos Ajustados ^{2/}	660,160	676,071	2.41%
Razón de Apalancamiento ^{3/}	7.81%	7.81%	0.00%

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 diciembre 2020 a marzo de 2021.

Respecto al trimestre anterior el indicador se mantuvo en 7.81%, debido principalmente al incremento de las exposiciones totales por \$15,911 millones (-18 pbs); compensados por el incremento del Capital Nivel 1 por \$1,225 millones (+18 pbs).

La variación de -18 pbs en las exposiciones totales, se debe principalmente a la disminución en la exposiciones dentro del balance excluyendo los instrumentos financieros derivados y los activos deducidos al capital de nivel 1 de Basilea III (-24pbs), compensado parcialmente con menores exposiciones fuera del balance (+6pbs).

El Capital de Nivel 1 mostró un incremento trimestral de \$1,225 millones (+18 pbs) derivado principalmente por el resultado neto del periodo (+24 pbs), dicha mejora se vio disminuida por el incremento de las deducciones (-10 pbs).

TABLA I.2

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

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

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

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

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

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

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

Agencias Calificadoras

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

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

Dividendos

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

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

Fecha de pago

23 de abril de 2013

Importe

\$ 165 millones

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de marzo del 2021, 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\$ 96,953 millones de pesos.
- Disponibilidades en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$ 27,452 millones de pesos.

Adicionalmente:

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

Inversiones relevantes en capital

Al 31 de marzo de 2021, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



I. Información Cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados. Durante el primer trimestre de 2021, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

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

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

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

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

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

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

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

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

(MR) Mercados reconocidos
(ME) Mercados extrabursátiles

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

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algorthmics 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 marzo 2021 y en promedio para el primer trimestre de 2021 es de:

Scotiabank	Posición	Posición
<i>(millones de pesos)</i>	(Cierre) ¹⁰	(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	55,427	17,298

¹⁰ Cifras previas al cierre de marzo 2021.

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

Inventario de modelos de derivados

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

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

Instrumentos a Valor Razonable

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

Instrumentos valuados a costo

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

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

i. Políticas Líneas de Crédito

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

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

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

- Sujetos de Crédito

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

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

- Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

- Idoneidad del Cliente

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

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

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

ii. Políticas de VaR

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

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

b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

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

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

Bonos de Tasa Flotante

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

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

Bonos Cupón Cero

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

Riesgo de Crédito

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

Sensibilidad del Pasivo

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

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

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

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

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con los requerimientos del B5 para concluir cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2021 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se obtuvo que tres coberturas de valor razonable de la cartera de crédito fueron inefectivas dado que en el 2020 fueron restructuradas como parte de las facilidades otorgadas a los clientes por la pandemia del Covid-19.

Durante el primer trimestre de 2021 se observaron cambios en la posición primaria lo que implicó la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

En adición a lo arriba descrito, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base en 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 marzo de 2021 y promedio del primer trimestre 2021 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ¹¹	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	103,868	104,247

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

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

En donde:

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

¹¹ Cifras previas al cierre de marzo 2021.

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario de Estrés
Gap 30d Gap Acum	55,427	54,063	54,061	54,059
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(1,364)	(1,366)	(1,368)

Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

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

Vega

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

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

Rho

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

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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

II. Información Cuantitativa

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a Marzo 31, 2021:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	5,335.30	41,458.00	88,759.00	(57,173.00)	(68,386.00)	(56,919.00)	(46,925.70)
CCS	21.00	339.00	1,255.00	223.00	206.00	1.00	2,045.00
Caps&Floors	(9.00)	1,149.00	(187.00)	(449.00)	2.00	0.00	506.00
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total DERIVATIVES	5,347.30	42,946.00	89,827.00	(57,399.00)	(68,178.00)	(56,918.00)	(44,374.70)

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

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

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock(+/-)	P&L	Stress 1 Shock(+/-)	P&L	Stress 2 Shock(+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	(0.04)	(232.95)	50.00	(2.22)	100.00	(4.45)	200.00	(8.87)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	(0.01)	(0.02)	0.10	(0.00)	0.40	(0.00)	1.00	(0.01)
a FX %	Forwards	9.11	187.77	0.10	(18.78)	0.20	(37.55)	0.50	(93.89)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
Total					(21.00)		(42.00)		(102.77)

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 marzo de 2021.

	Delta	Vega	Gamma
Options AMZN.USM	0.00	0.00	0.00
Options BABA.USM	0.00	0.00	0.00
Options MEXFXI.USM	31,572.60	357.86	(533.00)
Options MEXIXM.INDX	6,051.01	16.27	(774.00)
Options MEXMSF.INDX	0.00	0.00	0.00
Options MEXMSI.INDX	6,219,916.27	66,658.69	0.00
Options MEXSR5.INDX	3,968,713.36	37,298.29	0.00
Options MEXTSX60.INDX	86,291.94	0.00	(12,485.00)
Options MEXXLE.USM	46,992.91	309.06	(3,465.00)
TOTAL	10,359,538.09	104,640.17	(17,257.00)

Análisis de Stress

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

	Escenarios a la Baja		
	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options AMZN.USM	0.00	0.00	0.00
Options BABA.USM	0.00	0.00	0.00
Options MEXFXI.USM	(3,157.26)	(9,471.78)	(15,786.30)
Options MEXIXM.INDX	(605.10)	(1,815.30)	(3,025.50)
Options MEXMSF.INDX	0.00	0.00	0.00
Options MEXMSI.INDX	(621,991.63)	(1,865,974.88)	(3,109,958.13)
Options MEXSR5.INDX	(396,871.34)	(1,190,614.01)	(1,984,356.68)
Options MEXTSX60.INDX	(8,629.19)	(25,887.58)	(43,145.97)
Options MEXXLE.USM	(4,699.29)	(14,097.87)	(23,496.46)
TOTAL	(1,035,953.81)	(3,107,861.42)	(5,179,769.04)

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

	Escenarios a la Alza		
	0.05	0.15	0.2
Options AMZN.USM	0.00	0.00	0.00
Options BABA.USM	0.00	0.00	0.00
Options MEXFXI.USM	1,578.63	4,735.89	6,314.52
Options MEXIXM.INDX	302.55	907.65	1,210.20
Options MEXMSF.INDX	0.00	0.00	0.00
Options MEXMSI.INDX	310,995.81	932,987.44	1,243,983.25
Options MEXSR5.INDX	198,435.67	595,307.00	793,742.67
Options MEXTSX60.INDX	4,314.60	12,943.79	17,258.39
Options MEXXLE.USM	2,349.65	7,048.94	9,398.58
TOTAL	517,976.91	1,553,930.71	2,071,907.61

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del Escenario	Monto
Probable	(1,035,953.81)
Poco Probable	(3,107,861.42)
Muy poco Probable	(5,179,769.04)

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

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
P12065	Cap	05/01/2021	Sell	A	mex					1,161,987
P15769	Cap	13/01/2021	Sell	A	mex					650,000,000
P15770	Cap	13/01/2021	Buy	A	mex					650,000,000
P13586	Cap	22/01/2021	Sell	A	mex					65,000,000
P13588	Cap	22/01/2021	Buy	A	mex					65,000,000
P12247	Cap	27/01/2021	Sell	A	mex					11,251,123
P13176	Cap	27/01/2021	Sell	A	mex					8,216,754
P13053	Cap	28/01/2021	Sell	A	mex					400,000,000
P13054	Cap	28/01/2021	Buy	A	mex					400,000,000
P16279	Cap	03/02/2021	Sell	A	mex					13,359,617
P16282	Cap	03/02/2021	Sell	A	mex					13,359,617
P16283	Cap	03/02/2021	Buy	A	mex					13,359,617
P12610	Cap	05/02/2021	Sell	A	mex					359,193
P13149	Cap	20/02/2021	Sell	A	mex					1,568,048
P13700	Cap	20/02/2021	Sell	A	mex					300,000,000
P13708	Cap	20/02/2021	Buy	A	mex					300,000,000
P12039	Cap	24/02/2021	Buy	A	mex					120,000,000
P12126	Cap	24/02/2021	Sell	A	mex					120,000,000
P12042	Cap	01/03/2021	Buy	A	mex					120,000,000
P12127	Cap	01/03/2021	Sell	A	mex					120,000,000
P13875	Cap	15/03/2021	Sell	A	mex					4,630,791
P15063	Cap	15/03/2021	Buy	A	mex					100,000,000
P15064	Cap	15/03/2021	Sell	A	mex					50,000,000
P15065	Cap	15/03/2021	Sell	A	mex					50,000,000
P15851	Cap	19/03/2021	Sell	A	mex					1,039,185,220
P15852	Cap	19/03/2021	Buy	A	mex					1,039,185,220
P13167	Cap	20/03/2021	Sell	A	mex					336,018
P13785	Cap	21/03/2021	Sell	A	mex					25,000,000
P13786	Cap	21/03/2021	Sell	A	mex					25,000,000
P13787	Cap	21/03/2021	Sell	A	mex					25,000,000
P13804	Cap	21/03/2021	Buy	A	mex					75,000,000
P15939	Cap	24/03/2021	Buy	A	mex					20,000,000
P15940	Cap	24/03/2021	Sell	A	mex					20,000,000
C57675	CC Swap	29/01/2021	Buy	A	usd	58,288,152	usd	1,095,584,105	mex	
C57948	CC Swap	29/01/2021	Buy	A	usd	1,095,584,105	mex	58,288,152	usd	
E61912	Eq Option	20/01/2021	Buy	A	mex					94,980,000
E61913	Eq Option	20/01/2021	Sell	A	mex					94,980,000
E61914	Eq Option	20/01/2021	Sell	A	mex					94,980,000
E61915	Eq Option	20/01/2021	Buy	A	mex					94,980,000
E62158	Eq Option	03/02/2021	Buy	A	mex					10,000,000
E62159	Eq Option	03/02/2021	Sell	A	mex					10,000,000
E62160	Eq Option	03/02/2021	Sell	A	mex					10,000,000
E62161	Eq Option	03/02/2021	Buy	A	mex					10,000,000
E59619	Eq Option	01/03/2021	Sell	A	mex					103,260,000
E59622	Eq Option	01/03/2021	Sell	A	mex					103,260,000
E59627	Eq Option	01/03/2021	Buy	A	mex					103,260,000
E59635	Eq Option	01/03/2021	Buy	A	mex					103,260,000
P15771	Floor	13/01/2021	Sell	A	mex					650,000,000
P15773	Floor	13/01/2021	Buy	A	mex					650,000,000
P13589	Floor	22/01/2021	Buy	A	mex					65,000,000

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
P13590	Floor	22/01/2021	Sell	A	mex					65,000,000
P13788	Floor	21/03/2021	Buy	A	mex					25,000,000
P13789	Floor	21/03/2021	Buy	A	mex					25,000,000
P13790	Floor	21/03/2021	Buy	A	mex					25,000,000
P13792	Floor	21/03/2021	Sell	A	mex					75,000,000
SAH177	SC Swap	01/01/2021	Buy	A	mex	80,000,000	mex	80,000,000	mex	
SU5095	SC Swap	01/01/2021	Buy	A	mex	150,000,000	mex	150,000,000	mex	
SCH115	SC Swap	04/01/2021	Buy	A	mex	16,211,592	mex	16,211,592	mex	
SCH127	SC Swap	04/01/2021	Buy	A	mex	16,211,592	mex	16,211,592	mex	
SCH139	SC Swap	04/01/2021	Buy	A	mex	1,424,000	mex	1,424,000	mex	
SCH142	SC Swap	04/01/2021	Buy	A	mex	1,424,000	mex	1,424,000	mex	
SCV478	SC Swap	05/01/2021	Buy	A	mex	90,000,000	mex	90,000,000	mex	
SCV521	SC Swap	05/01/2021	Buy	A	mex	90,000,000	mex	90,000,000	mex	
SU8259	SC Swap	05/01/2021	Buy	A	mex	9,200,000	mex	9,200,000	mex	
SU8265	SC Swap	05/01/2021	Buy	A	mex	9,000,000	mex	9,000,000	mex	
SU8712	SC Swap	05/01/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU9547	SC Swap	05/01/2021	Buy	A	mex	9,200,000	mex	9,200,000	mex	
SU9548	SC Swap	05/01/2021	Buy	A	mex	9,000,000	mex	9,000,000	mex	
SBK539	SC Swap	06/01/2021	Buy	A	mex	290,000,000	mex	290,000,000	mex	
SU5978	SC Swap	06/01/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU5986	SC Swap	06/01/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU6062	SC Swap	06/01/2021	Buy	A	mex	50,000,000	mex	50,000,000	mex	
SCY172	SC Swap	07/01/2021	Buy	A	usm	1,200,000	usm	1,200,000	usm	
SCY175	SC Swap	07/01/2021	Buy	A	usm	1,200,000	usm	1,200,000	usm	
SU6106	SC Swap	07/01/2021	Buy	A	mex	1,271,000,000	mex	1,271,000,000	mex	
SBK820	SC Swap	08/01/2021	Buy	A	mex	195,000,000	mex	195,000,000	mex	
SBK821	SC Swap	08/01/2021	Buy	A	mex	195,000,000	mex	195,000,000	mex	
SU5226	SC Swap	08/01/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU5402	SC Swap	12/01/2021	Buy	A	mex	60,000,000	mex	60,000,000	mex	
SU7554	SC Swap	12/01/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU5454	SC Swap	13/01/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SU9009	SC Swap	14/01/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SCI403	SC Swap	15/01/2021	Buy	A	mex	7,000,000	mex	7,000,000	mex	
SCI404	SC Swap	15/01/2021	Buy	A	mex	7,000,000	mex	7,000,000	mex	
SCK564	SC Swap	15/01/2021	Buy	A	mex	10,000,000	mex	10,000,000	mex	
SCK605	SC Swap	15/01/2021	Buy	A	mex	10,000,000	mex	10,000,000	mex	
SCY969	SC Swap	15/01/2021	Buy	A	usm	3,000,000	usm	3,000,000	usm	
SCY981	SC Swap	15/01/2021	Buy	A	usm	3,000,000	usm	3,000,000	usm	
SU6245	SC Swap	15/01/2021	Buy	A	mex	870,000,000	mex	870,000,000	mex	
SCE217	SC Swap	18/01/2021	Buy	A	mex	520,000,000	mex	520,000,000	mex	
SCW386	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	1,756,705	usm	1,756,705	usm	
SCW387	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	500,000	usm	500,000	usm	
SCW396	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	275,000	usm	275,000	usm	
SCW398	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	839,908	usm	839,908	usm	
SCW399	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	280,846	usm	280,846	usm	
SCW411	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	1,756,705	usm	1,756,705	usm	
SCW412	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	500,000	usm	500,000	usm	
SCW774	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	839,908	usm	839,908	usm	
SCW775	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	280,846	usm	280,846	usm	
SCW776	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	usm	275,000	usm	275,000	usm	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlD	Option Notional
SU5664	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	mex	170,000,000	mex	170,000,000	mex	
SU5673	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	mex	69,000,000	mex	69,000,000	mex	
SU7563	SC Swap	19/01/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU5682	SC Swap	20/01/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SU5760	SC Swap	20/01/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU5772	SC Swap	20/01/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU6379	SC Swap	20/01/2021	Buy	A	mex	180,000,000	mex	180,000,000	mex	
SCE821	SC Swap	21/01/2021	Buy	A	mex	355,000,000	mex	355,000,000	mex	
SU5888	SC Swap	21/01/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SBM073	SC Swap	22/01/2021	Buy	A	usm	1,000,000	usm	1,000,000	usm	
SBM144	SC Swap	22/01/2021	Buy	A	usm	1,000,000	usm	1,000,000	usm	
SCM001	SC Swap	22/01/2021	Buy	A	mex	1,700,000,000	mex	1,700,000,000	mex	
SCU509	SC Swap	22/01/2021	Buy	A	mex	5,200,000	mex	5,200,000	mex	
SCU510	SC Swap	22/01/2021	Buy	A	mex	5,200,000	mex	5,200,000	mex	
SU5961	SC Swap	22/01/2021	Buy	A	mex	19,571,000	mex	19,571,000	mex	
SU9575	SC Swap	22/01/2021	Buy	A	mex	19,571,000	mex	19,571,000	mex	
SW8476	SC Swap	23/01/2021	Buy	A	mex	2,911,934	mex	2,911,934	mex	
SW8487	SC Swap	23/01/2021	Buy	A	mex	2,911,934	mex	2,911,934	mex	
SCF114	SC Swap	25/01/2021	Buy	A	mex	350,000,000	mex	350,000,000	mex	
SAK333	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	21,276,413	mex	21,276,413	mex	
SAK335	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	15,290,145	mex	15,290,145	mex	
SAK346	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	21,276,413	mex	21,276,413	mex	
SAK348	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	15,290,145	mex	15,290,145	mex	
SV9975	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	25,000,000	mex	25,000,000	mex	
SW0005	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	25,000,000	mex	25,000,000	mex	
SW8251	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	300,000,000	mex	300,000,000	mex	
SW8267	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	300,000,000	mex	300,000,000	mex	
SW8877	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	120,000,000	mex	120,000,000	mex	
SW8964	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	120,000,000	mex	120,000,000	mex	
SW9216	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	350,000,000	mex	350,000,000	mex	
SW9264	SC Swap	26/01/2021	Buy	A	mex	350,000,000	mex	350,000,000	mex	
SCM315	SC Swap	27/01/2021	Buy	A	mex	1,940,000,000	mex	1,940,000,000	mex	
SW9640	SC Swap	27/01/2021	Buy	A	mex	350,000,000	mex	350,000,000	mex	
SAK829	SC Swap	29/01/2021	Buy	A	mex	265,517	mex	265,517	mex	
SAK873	SC Swap	29/01/2021	Buy	A	mex	265,517	mex	265,517	mex	
SCL798	SC Swap	29/01/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SCL806	SC Swap	29/01/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SCL807	SC Swap	29/01/2021	Buy	A	mex	5,000,000	mex	5,000,000	mex	
SCL808	SC Swap	29/01/2021	Buy	A	mex	5,000,000	mex	5,000,000	mex	
SU6176	SC Swap	29/01/2021	Buy	A	mex	150,000,000	mex	150,000,000	mex	
SZ3331	SC Swap	29/01/2021	Buy	A	mex	1,500,000,000	mex	1,500,000,000	mex	
SZ3332	SC Swap	29/01/2021	Buy	A	mex	1,500,000,000	mex	1,500,000,000	mex	
SU6267	SC Swap	01/02/2021	Buy	A	mex	450,000,000	mex	450,000,000	mex	
SU5500	SC Swap	02/02/2021	Buy	A	mex	50,000,000	mex	50,000,000	mex	
SU6329	SC Swap	02/02/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU6548	SC Swap	02/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SX6238	SC Swap	02/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SCM055	SC Swap	03/02/2021	Buy	A	mex	5,000,000	mex	5,000,000	mex	
SCM078	SC Swap	03/02/2021	Buy	A	mex	5,000,000	mex	5,000,000	mex	
SCM921	SC Swap	03/02/2021	Buy	A	mex	480,000,000	mex	480,000,000	mex	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SU6455	SC Swap	03/02/2021	Buy	A	mex	195,000,000	mex	195,000,000	mex	
SBN235	SC Swap	04/02/2021	Buy	A	mex	285,000,000	mex	285,000,000	mex	
SU6660	SC Swap	04/02/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SBN391	SC Swap	05/02/2021	Buy	A	mex	1,300,000,000	mex	1,300,000,000	mex	
SCG098	SC Swap	05/02/2021	Buy	A	mex	965,000,000	mex	965,000,000	mex	
SCN227	SC Swap	05/02/2021	Buy	A	mex	480,000,000	mex	480,000,000	mex	
SU6576	SC Swap	05/02/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SU6618	SC Swap	05/02/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU6637	SC Swap	05/02/2021	Buy	A	mex	50,000,000	mex	50,000,000	mex	
SU6656	SC Swap	05/02/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU6684	SC Swap	05/02/2021	Buy	A	mex	1,000,000,000	mex	1,000,000,000	mex	
SCY381	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	usm	6,500,000	usm	6,500,000	usm	
SCY416	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	usm	6,500,000	usm	6,500,000	usm	
SU6759	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	mex	50,000,000	mex	50,000,000	mex	
SU6777	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU6784	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	mex	150,000,000	mex	150,000,000	mex	
SU6793	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU6830	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	mex	250,000,000	mex	250,000,000	mex	
SU7655	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	mex	155,000,000	mex	155,000,000	mex	
SU7664	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SU7674	SC Swap	08/02/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SX4689	SC Swap	09/02/2021	Buy	A	mex	29,533,767	mex	29,533,767	mex	
SX4693	SC Swap	09/02/2021	Buy	A	mex	29,533,767	mex	29,533,767	mex	
SW9750	SC Swap	10/02/2021	Buy	A	mex	155,000,000	mex	155,000,000	mex	
SBN953	SC Swap	11/02/2021	Buy	A	mex	190,000,000	mex	190,000,000	mex	
SBN960	SC Swap	11/02/2021	Buy	A	mex	846,000,000	mex	846,000,000	mex	
SU8843	SC Swap	11/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8885	SC Swap	11/02/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU8917	SC Swap	11/02/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SU9046	SC Swap	11/02/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SCM888	SC Swap	12/02/2021	Buy	A	mex	10,000,000	mex	10,000,000	mex	
SCM924	SC Swap	12/02/2021	Buy	A	mex	10,000,000	mex	10,000,000	mex	
SU6941	SC Swap	12/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8861	SC Swap	12/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU7067	SC Swap	15/02/2021	Buy	A	mex	80,000,000	mex	80,000,000	mex	
SU7078	SC Swap	15/02/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU7109	SC Swap	15/02/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU7159	SC Swap	16/02/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU7199	SC Swap	16/02/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SBO399	SC Swap	17/02/2021	Buy	A	mex	575,000,000	mex	575,000,000	mex	
SCW757	SC Swap	17/02/2021	Buy	A	mex	865,000,000	mex	865,000,000	mex	
SU7299	SC Swap	17/02/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU7387	SC Swap	17/02/2021	Buy	A	mex	250,000,000	mex	250,000,000	mex	
SU7536	SC Swap	18/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8879	SC Swap	18/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SX4000	SC Swap	18/02/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SCT996	SC Swap	19/02/2021	Buy	A	mex	10,000,000,000	mex	10,000,000,000	mex	
SCT997	SC Swap	19/02/2021	Buy	A	mex	10,000,000,000	mex	10,000,000,000	mex	
SDC290	SC Swap	19/02/2021	Buy	A	usm	1,200,000	usm	1,200,000	usm	
SDC292	SC Swap	19/02/2021	Buy	A	usm	1,200,000	usm	1,200,000	usm	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SU7396	SC Swap	19/02/2021	Buy	A	mex	20,000,000	mex	20,000,000	mex	
SU9577	SC Swap	19/02/2021	Buy	A	mex	20,000,000	mex	20,000,000	mex	
SCR252	SC Swap	21/02/2021	Buy	A	mex	6,797,034	mex	6,797,034	mex	
SCR259	SC Swap	21/02/2021	Buy	A	mex	6,797,034	mex	6,797,034	mex	
SU7770	SC Swap	22/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU7822	SC Swap	23/02/2021	Buy	A	mex	80,000,000	mex	80,000,000	mex	
SU7837	SC Swap	23/02/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU8163	SC Swap	24/02/2021	Buy	A	mex	15,000,000	mex	15,000,000	mex	
SU9580	SC Swap	24/02/2021	Buy	A	mex	15,000,000	mex	15,000,000	mex	
SAL153	SC Swap	25/02/2021	Buy	A	mex	10,000,000	mex	10,000,000	mex	
SAL199	SC Swap	25/02/2021	Buy	A	mex	10,000,000	mex	10,000,000	mex	
SX4531	SC Swap	26/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SX4539	SC Swap	26/02/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SX5533	SC Swap	26/02/2021	Buy	A	mex	26,496,114	mex	26,496,114	mex	
SX5573	SC Swap	26/02/2021	Buy	A	mex	26,496,114	mex	26,496,114	mex	
SBV749	SC Swap	28/02/2021	Buy	A	mex	1,682,111	mex	1,682,111	mex	
SBV848	SC Swap	28/02/2021	Buy	A	mex	1,682,111	mex	1,682,111	mex	
SU8183	SC Swap	01/03/2021	Buy	A	mex	250,000,000	mex	250,000,000	mex	
SU8928	SC Swap	01/03/2021	Buy	A	mex	50,000,000	mex	50,000,000	mex	
SU8296	SC Swap	03/03/2021	Buy	A	mex	1,000,000,000	mex	1,000,000,000	mex	
SU8303	SC Swap	03/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8352	SC Swap	03/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8360	SC Swap	03/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8375	SC Swap	03/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8399	SC Swap	03/03/2021	Buy	A	mex	250,000,000	mex	250,000,000	mex	
SU8976	SC Swap	03/03/2021	Buy	A	mex	50,000,000	mex	50,000,000	mex	
SCD682	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	2,000,000,000	mex	2,000,000,000	mex	
SCI744	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	127,000,000	mex	127,000,000	mex	
SCR452	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	13,980,508	mex	13,980,508	mex	
SCR470	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	13,980,508	mex	13,980,508	mex	
SCY281	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	850,000,000	mex	850,000,000	mex	
SU8443	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU8450	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU8486	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU8521	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU8528	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU9062	SC Swap	04/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SAL757	SC Swap	05/03/2021	Buy	A	mex	20,453,166	mex	20,453,166	mex	
SAL833	SC Swap	05/03/2021	Buy	A	mex	20,453,166	mex	20,453,166	mex	
SAX705	SC Swap	05/03/2021	Buy	A	mex	900,000,000	mex	900,000,000	mex	
SAX710	SC Swap	05/03/2021	Buy	A	mex	900,000,000	mex	900,000,000	mex	
SDE013	SC Swap	05/03/2021	Buy	A	usm	1,500,000	usm	1,500,000	usm	
SDE015	SC Swap	05/03/2021	Buy	A	usm	1,500,000	usm	1,500,000	usm	
SU8543	SC Swap	05/03/2021	Buy	A	mex	250,000,000	mex	250,000,000	mex	
SCO834	SC Swap	08/03/2021	Buy	A	mex	5,000,000	mex	5,000,000	mex	
SCO880	SC Swap	08/03/2021	Buy	A	mex	5,000,000	mex	5,000,000	mex	
SU8618	SC Swap	09/03/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SU9082	SC Swap	09/03/2021	Buy	A	mex	50,000,000	mex	50,000,000	mex	
SBJ458	SC Swap	10/03/2021	Buy	A	mex	1,893,062	mex	1,893,062	mex	
SBJ485	SC Swap	10/03/2021	Buy	A	mex	1,893,062	mex	1,893,062	mex	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SCM508	SC Swap	10/03/2021	Buy	A	mex	1,000,000	mex	1,000,000	mex	
SCM594	SC Swap	10/03/2021	Buy	A	mex	1,000,000	mex	1,000,000	mex	
SCM657	SC Swap	10/03/2021	Buy	A	mex	4,000,000	mex	4,000,000	mex	
SCM680	SC Swap	10/03/2021	Buy	A	mex	4,000,000	mex	4,000,000	mex	
SU7063	SC Swap	10/03/2021	Buy	A	mex	500,000,000	mex	500,000,000	mex	
SCP434	SC Swap	12/03/2021	Buy	A	mex	14,000,000	mex	14,000,000	mex	
SCP459	SC Swap	12/03/2021	Buy	A	mex	14,000,000	mex	14,000,000	mex	
SCV658	SC Swap	12/03/2021	Buy	A	mex	6,000,000	mex	6,000,000	mex	
SCV748	SC Swap	12/03/2021	Buy	A	mex	6,000,000	mex	6,000,000	mex	
SCW002	SC Swap	12/03/2021	Buy	A	mex	5,000,000	mex	5,000,000	mex	
SCW003	SC Swap	12/03/2021	Buy	A	mex	5,000,000	mex	5,000,000	mex	
SCW071	SC Swap	12/03/2021	Buy	A	mex	15,000,000	mex	15,000,000	mex	
SCW077	SC Swap	12/03/2021	Buy	A	mex	15,000,000	mex	15,000,000	mex	
SCH387	SC Swap	16/03/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SU7214	SC Swap	17/03/2021	Buy	A	mex	230,000,000	mex	230,000,000	mex	
SU8943	SC Swap	17/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU8952	SC Swap	17/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8959	SC Swap	17/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8979	SC Swap	17/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU8987	SC Swap	17/03/2021	Buy	A	mex	180,000,000	mex	180,000,000	mex	
SCW960	SC Swap	18/03/2021	Buy	A	mex	10,000,000,000	mex	10,000,000,000	mex	
SCW963	SC Swap	18/03/2021	Buy	A	mex	10,000,000,000	mex	10,000,000,000	mex	
SDB957	SC Swap	19/03/2021	Buy	A	usm	1,756,705	usm	1,756,705	usm	
SDB958	SC Swap	19/03/2021	Buy	A	usm	500,000	usm	500,000	usm	
SDB960	SC Swap	19/03/2021	Buy	A	usm	500,000	usm	500,000	usm	
SDB961	SC Swap	19/03/2021	Buy	A	usm	1,756,705	usm	1,756,705	usm	
SAN069	SC Swap	22/03/2021	Buy	A	mex	20,000,000	mex	20,000,000	mex	
SAN091	SC Swap	22/03/2021	Buy	A	mex	20,000,000	mex	20,000,000	mex	
SU4922	SC Swap	22/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU4932	SC Swap	22/03/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SU6201	SC Swap	22/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU9146	SC Swap	23/03/2021	Buy	A	mex	400,000,000	mex	400,000,000	mex	
SU9151	SC Swap	23/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU9157	SC Swap	23/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU9199	SC Swap	24/03/2021	Buy	A	mex	115,000,000	mex	115,000,000	mex	
SU9205	SC Swap	24/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU9217	SC Swap	24/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU9226	SC Swap	24/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU9236	SC Swap	24/03/2021	Buy	A	mex	315,000,000	mex	315,000,000	mex	
SBX402	SC Swap	25/03/2021	Buy	A	mex	622,000,000	mex	622,000,000	mex	
SCQ570	SC Swap	26/03/2021	Buy	A	mex	10,000,000	mex	10,000,000	mex	
SU4993	SC Swap	26/03/2021	Buy	A	mex	30,000,000	mex	30,000,000	mex	
SU5003	SC Swap	26/03/2021	Buy	A	mex	50,000,000	mex	50,000,000	mex	
SU5013	SC Swap	26/03/2021	Buy	A	mex	325,000,000	mex	325,000,000	mex	
SU5044	SC Swap	26/03/2021	Buy	A	mex	380,000,000	mex	380,000,000	mex	
SU9120	SC Swap	26/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SX9007	SC Swap	26/03/2021	Buy	A	mex	150,000,000	mex	150,000,000	mex	
SX9018	SC Swap	26/03/2021	Buy	A	mex	150,000,000	mex	150,000,000	mex	
SU5106	SC Swap	29/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU5133	SC Swap	29/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SU6232	SC Swap	29/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SCD770	SC Swap	30/03/2021	Buy	A	mex	750,000,000	mex	750,000,000	mex	
SU5236	SC Swap	30/03/2021	Buy	A	mex	100,000,000	mex	100,000,000	mex	
SU5247	SC Swap	30/03/2021	Buy	A	mex	200,000,000	mex	200,000,000	mex	
SU5258	SC Swap	30/03/2021	Buy	A	mex	300,000,000	mex	300,000,000	mex	
SAO205	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	18,000,000	mex	18,000,000	mex	
SAO224	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	18,000,000	mex	18,000,000	mex	
SAU645	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	694,459	mex	694,459	mex	
SAU675	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	694,459	mex	694,459	mex	
SCK717	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	325,000,000	mex	325,000,000	mex	
SCX970	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	10,000,000	mex	10,000,000	mex	
SCX972	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	10,000,000	mex	10,000,000	mex	
SU5306	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	670,000,000	mex	670,000,000	mex	
SU5324	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	190,000,000	mex	190,000,000	mex	
SU5375	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	150,000,000	mex	150,000,000	mex	
SU6260	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	195,000,000	mex	195,000,000	mex	
SU6292	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	3,888,000	mex	3,888,000	mex	
SU8982	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	1,021,000	mex	1,021,000	mex	
SU9180	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	50,000,000	mex	50,000,000	mex	
SU9586	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	3,888,000	mex	3,888,000	mex	
SU9610	SC Swap	31/03/2021	Buy	A	mex	1,021,000	mex	1,021,000	mex	
MO7211	Term Deposit	26/01/2021	Buy	A	mex			350,000,000	mex	
MF549	Term Deposit	05/02/2021	Buy	A	mex			10,000,000	mex	
MF558	Term Loan	05/02/2021	Buy	A	mex	9,331,840	mex			

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2060480	FX	8,540,648	20-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2060482	FX	8,540,648	20-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2060484	FX	8,540,648	20-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2060486	FX	8,540,648	20-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2060584	FX	1,000,000	13-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2060632	FX	1,000,000	13-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065499	FX	25,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065501	FX	25,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065503	FX	25,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065505	FX	25,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065507	FX	25,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065509	FX	25,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065519	FX	25,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065521	FX	25,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065523	FX	25,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065525	FX	25,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065527	FX	25,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065529	FX	25,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066080	FX	15,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066092	FX	15,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066099	FX	70,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066101	FX	70,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066102	FX	70,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066104	FX	70,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2066117	FX	70,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066119	FX	70,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066120	FX	70,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066122	FX	70,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066171	FX	100,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066173	FX	100,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066174	FX	100,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066176	FX	100,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066177	FX	100,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066179	FX	100,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066192	FX	100,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066194	FX	100,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066195	FX	100,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066197	FX	100,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066198	FX	100,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066200	FX	100,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066772	FX	100,000	25-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066778	FX	100,000	25-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066837	FX	100,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066839	FX	100,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066912	FX	100,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066932	FX	100,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067021	FX	40,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067023	FX	40,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067051	FX	40,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067053	FX	40,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067112	FX	60,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067132	FX	60,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067421	FX	77,810	20-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067423	FX	77,810	20-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067425	FX	77,810	20-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067427	FX	77,810	20-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067457	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067459	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067460	FX	2,826	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067477	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067479	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067480	FX	2,826	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067629	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067631	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067632	FX	2,729	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067649	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067651	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067652	FX	2,729	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067829	FX	630,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067831	FX	630,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067832	FX	840,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067834	FX	840,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2067835	FX	630,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067837	FX	630,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067838	FX	840,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067840	FX	840,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067850	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067852	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067853	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067855	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067856	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067858	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067859	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067861	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067862	FX	19,481	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067863	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067865	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067866	FX	19,481	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067871	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067873	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067874	FX	19,481	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067875	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067877	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067878	FX	19,481	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067879	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067881	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2067882	FX	19,481	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068027	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068029	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068030	FX	2,882	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068101	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068103	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068104	FX	2,882	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068272	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068274	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068275	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068277	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068278	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068280	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068311	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068313	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068314	FX	8,024	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068315	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068317	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068318	FX	8,170	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068359	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068361	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068362	FX	8,024	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068363	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068365	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2068366	FX	8,170	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068367	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068369	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068370	FX	8,170	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068464	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068466	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068467	FX	8,539	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068468	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068470	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068471	FX	8,949	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068492	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068494	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068495	FX	8,539	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068496	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068498	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068499	FX	8,949	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068500	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068502	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068503	FX	8,949	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068516	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068518	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068519	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068521	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068522	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068524	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068543	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068545	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068549	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068551	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068636	FX	420,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068638	FX	420,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068639	FX	560,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068641	FX	560,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068642	FX	700,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068644	FX	700,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068645	FX	420,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068647	FX	420,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068648	FX	560,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068650	FX	560,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068651	FX	700,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068653	FX	700,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068759	FX	32,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068761	FX	32,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068762	FX	32,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068764	FX	32,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068765	FX	32,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068767	FX	32,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068768	FX	32,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2068770	FX	32,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068798	FX	32,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068800	FX	32,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068801	FX	32,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068803	FX	32,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068804	FX	32,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068806	FX	32,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068807	FX	32,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068809	FX	32,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068837	FX	32,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068839	FX	32,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068840	FX	32,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068842	FX	32,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068843	FX	32,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068845	FX	32,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068846	FX	32,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068848	FX	32,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068876	FX	32,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068878	FX	32,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068879	FX	32,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068881	FX	32,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068882	FX	32,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068884	FX	32,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068885	FX	32,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068887	FX	32,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068888	FX	525,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068890	FX	525,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068891	FX	700,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068893	FX	700,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068894	FX	500,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068896	FX	500,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068897	FX	525,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068899	FX	525,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068900	FX	700,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068902	FX	700,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068903	FX	500,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068905	FX	500,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068981	FX	250,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068983	FX	250,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068984	FX	250,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068986	FX	250,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068987	FX	250,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068988	FX	250,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068989	FX	250,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2068999	FX	250,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069001	FX	250,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069002	FX	250,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069004	FX	250,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2069017	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069019	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069020	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069022	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069035	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069037	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069038	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069040	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069041	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069043	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069056	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069058	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069059	FX	9,740	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069060	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069062	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069063	FX	9,740	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069080	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069082	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069083	FX	9,740	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069084	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069086	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069087	FX	9,740	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069088	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069090	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069091	FX	9,740	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069119	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069121	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069144	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069146	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069147	FX	29,271	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069171	FX	200,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069173	FX	200,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069174	FX	200,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069176	FX	200,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069177	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069179	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069180	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069182	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069186	FX	200,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069188	FX	200,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069189	FX	200,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069191	FX	200,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069192	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069194	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069195	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069197	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069207	FX	50,000	08-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069209	FX	50,000	08-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2069210	FX	50,000	14-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069212	FX	50,000	14-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069213	FX	50,000	22-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069215	FX	50,000	22-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069216	FX	50,000	28-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069218	FX	50,000	28-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069219	FX	50,000	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069221	FX	50,000	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069222	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069224	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069225	FX	50,000	19-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069227	FX	50,000	19-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069231	FX	50,000	08-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069233	FX	50,000	08-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069234	FX	50,000	14-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069236	FX	50,000	14-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069237	FX	50,000	22-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069239	FX	50,000	22-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069240	FX	50,000	28-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069242	FX	50,000	28-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069243	FX	50,000	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069245	FX	50,000	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069246	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069248	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069249	FX	50,000	19-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069251	FX	50,000	19-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069259	FX	900,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069260	FX	900,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069262	FX	900,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069263	FX	900,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069374	FX	250,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069376	FX	250,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069377	FX	250,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069379	FX	250,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069380	FX	250,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069382	FX	250,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069383	FX	250,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069385	FX	250,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069386	FX	250,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069388	FX	250,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069389	FX	250,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069391	FX	250,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069392	FX	250,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069394	FX	250,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069395	FX	250,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069396	FX	250,000	23-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069397	FX	250,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069398	FX	250,000	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2069399	FX	250,000	02-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069400	FX	250,000	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069401	FX	250,000	09-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069402	FX	250,000	09-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069403	FX	250,000	09-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069404	FX	250,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069405	FX	250,000	16-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069406	FX	250,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069407	FX	250,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069408	FX	250,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069409	FX	250,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069410	FX	250,000	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069411	FX	250,000	30-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069412	FX	250,000	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069452	FX	250,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069454	FX	250,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069455	FX	250,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069457	FX	250,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069458	FX	250,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069460	FX	250,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069461	FX	250,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069463	FX	250,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069464	FX	250,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069466	FX	250,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069467	FX	250,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069469	FX	250,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069470	FX	250,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069472	FX	250,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069473	FX	250,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069474	FX	250,000	23-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069475	FX	250,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069476	FX	250,000	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069477	FX	250,000	02-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069478	FX	250,000	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069479	FX	250,000	09-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069480	FX	250,000	09-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069481	FX	250,000	09-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069482	FX	250,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069483	FX	250,000	16-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069484	FX	250,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069485	FX	250,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069486	FX	250,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069487	FX	250,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069488	FX	250,000	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069489	FX	250,000	30-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069490	FX	250,000	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069560	FX	40,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069562	FX	40,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2069563	FX	2,262	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069564	FX	50,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069566	FX	50,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069567	FX	2,828	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069568	FX	50,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069570	FX	50,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069571	FX	2,828	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069584	FX	40,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069586	FX	40,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069587	FX	2,262	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069588	FX	50,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069590	FX	50,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069591	FX	2,828	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069592	FX	50,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069594	FX	50,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069595	FX	2,828	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069596	FX	1,100,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069598	FX	1,100,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069599	FX	1,100,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069601	FX	1,100,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069618	FX	100,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069627	FX	100,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069630	FX	470,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069633	FX	470,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069741	FX	250,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069744	FX	250,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069747	FX	250,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069750	FX	250,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069780	FX	250,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069783	FX	250,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069786	FX	250,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069789	FX	250,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069911	FX	400,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069913	FX	400,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069914	FX	43,100	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069915	FX	400,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069917	FX	400,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069918	FX	43,100	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069919	FX	400,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069921	FX	400,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069922	FX	43,100	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2070297	FX	30,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2070298	FX	30,000	14-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2070299	FX	30,000	21-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2070310	FX	30,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2070311	FX	30,000	14-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2070312	FX	30,000	21-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071461	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2071463	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071464	FX	25,917	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071465	FX	200,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071467	FX	200,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071468	FX	25,917	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071469	FX	200,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071471	FX	200,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071472	FX	25,917	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071473	FX	200,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071475	FX	200,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071476	FX	25,917	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071477	FX	200,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071479	FX	200,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071480	FX	25,917	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071481	FX	200,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071483	FX	200,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071484	FX	25,917	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071485	FX	200,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071487	FX	200,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071488	FX	25,917	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071489	FX	200,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071491	FX	200,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071492	FX	25,917	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071493	FX	200,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071495	FX	200,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071496	FX	25,917	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071498	FX	200,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071499	FX	200,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071500	FX	25,917	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071501	FX	200,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071503	FX	200,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071504	FX	25,917	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071505	FX	200,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071507	FX	200,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071508	FX	25,917	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071509	FX	200,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071511	FX	200,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071512	FX	25,917	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071569	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071571	FX	200,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071572	FX	25,917	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071573	FX	200,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071575	FX	200,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071576	FX	25,917	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071577	FX	200,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071579	FX	200,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071580	FX	25,917	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071581	FX	200,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2071583	FX	200,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071584	FX	25,917	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071585	FX	200,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071587	FX	200,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071588	FX	25,917	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071589	FX	200,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071591	FX	200,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071592	FX	25,917	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071593	FX	200,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071595	FX	200,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071596	FX	25,917	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071597	FX	200,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071599	FX	200,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071600	FX	25,917	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071601	FX	200,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071603	FX	200,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071604	FX	25,917	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071606	FX	200,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071607	FX	200,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071608	FX	25,917	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071609	FX	200,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071611	FX	200,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071612	FX	25,917	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071613	FX	200,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071615	FX	200,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071616	FX	25,917	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071617	FX	200,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071619	FX	200,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071620	FX	25,917	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071817	FX	50,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071819	FX	50,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071820	FX	4,457	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071821	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071823	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071824	FX	4,457	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071833	FX	50,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071835	FX	50,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071836	FX	4,457	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071837	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071839	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071840	FX	4,457	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071841	FX	1,000,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071843	FX	1,000,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071844	FX	94,348	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071845	FX	1,000,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071847	FX	1,000,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071848	FX	94,348	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071857	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2071859	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071860	FX	5,342	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071861	FX	50,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071863	FX	50,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071864	FX	5,342	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071865	FX	50,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071867	FX	50,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071868	FX	5,342	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071877	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071879	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071880	FX	5,342	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071881	FX	50,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071883	FX	50,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071884	FX	5,342	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071885	FX	50,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071887	FX	50,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071888	FX	5,342	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071908	FX	25,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071910	FX	25,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071911	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071913	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071920	FX	25,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071922	FX	25,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071923	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071925	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071932	FX	25,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071934	FX	25,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071935	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071937	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071944	FX	25,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071946	FX	25,000	13-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071947	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071949	FX	50,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072016	FX	100,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072018	FX	100,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072019	FX	100,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072021	FX	100,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072022	FX	100,000	26-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072024	FX	100,000	26-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072046	FX	100,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072048	FX	100,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072049	FX	100,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072051	FX	100,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072052	FX	100,000	26-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072054	FX	100,000	26-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072079	FX	40,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072081	FX	40,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072082	FX	40,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2072084	FX	40,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072091	FX	40,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072093	FX	40,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072094	FX	40,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072096	FX	40,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072178	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072180	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072181	FX	50,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072183	FX	50,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072184	FX	50,000	26-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072186	FX	50,000	26-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072208	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072210	FX	50,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072211	FX	50,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072213	FX	50,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072214	FX	50,000	26-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072216	FX	50,000	26-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072275	FX	300,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072277	FX	300,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072278	FX	32,609	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072279	FX	300,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072281	FX	300,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072282	FX	32,609	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072284	FX	300,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072285	FX	300,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072286	FX	32,609	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072723	FX	300,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072725	FX	300,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072726	FX	32,609	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072727	FX	300,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072729	FX	300,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072730	FX	32,609	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072732	FX	300,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072733	FX	300,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072734	FX	32,609	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073587	FX	300,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073589	FX	300,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073590	FX	42,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073591	FX	300,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073593	FX	300,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073594	FX	42,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073595	FX	300,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073597	FX	300,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073598	FX	42,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073599	FX	300,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073601	FX	300,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073602	FX	42,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073603	FX	300,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2073605	FX	300,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073606	FX	42,500	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073607	FX	300,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073609	FX	300,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073610	FX	42,500	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073611	FX	300,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073613	FX	300,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073614	FX	42,500	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073616	FX	300,000	22-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073617	FX	300,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073618	FX	42,500	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073619	FX	300,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073621	FX	300,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073622	FX	42,500	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073624	FX	300,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073625	FX	300,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073626	FX	42,500	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073628	FX	300,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073629	FX	300,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073630	FX	42,500	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073631	FX	300,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073633	FX	300,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073634	FX	42,500	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073635	FX	300,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073637	FX	300,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073638	FX	42,500	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073795	FX	250,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073797	FX	250,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073798	FX	35,833	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073799	FX	250,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073801	FX	250,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073802	FX	35,833	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073803	FX	250,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073805	FX	250,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073806	FX	35,833	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073807	FX	250,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073809	FX	250,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073810	FX	35,833	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073811	FX	250,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073813	FX	250,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073814	FX	35,833	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073815	FX	250,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073817	FX	250,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073818	FX	35,833	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073819	FX	250,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073821	FX	250,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073822	FX	35,833	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073824	FX	250,000	22-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2073825	FX	250,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073826	FX	35,833	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073828	FX	250,000	01-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073829	FX	250,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073830	FX	35,833	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073832	FX	250,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073833	FX	250,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073834	FX	35,833	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073836	FX	250,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073837	FX	250,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073838	FX	35,833	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073839	FX	250,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073841	FX	250,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073842	FX	35,833	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073844	FX	250,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073845	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073846	FX	35,833	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074003	FX	300,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074005	FX	300,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074006	FX	42,500	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074007	FX	300,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074009	FX	300,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074010	FX	42,500	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074011	FX	300,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074013	FX	300,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074014	FX	42,500	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074015	FX	300,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074017	FX	300,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074018	FX	42,500	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074019	FX	300,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074021	FX	300,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074022	FX	42,500	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074023	FX	300,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074025	FX	300,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074026	FX	42,500	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074027	FX	300,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074029	FX	300,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074030	FX	42,500	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074032	FX	300,000	22-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074033	FX	300,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074034	FX	42,500	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074035	FX	300,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074037	FX	300,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074038	FX	42,500	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074040	FX	300,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074041	FX	300,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074042	FX	42,500	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074044	FX	300,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2074045	FX	300,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074046	FX	42,500	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074047	FX	300,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074049	FX	300,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074050	FX	42,500	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074051	FX	300,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074053	FX	300,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074054	FX	42,500	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074211	FX	250,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074213	FX	250,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074214	FX	35,833	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074215	FX	250,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074217	FX	250,000	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074218	FX	35,833	11-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074219	FX	250,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074221	FX	250,000	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074222	FX	35,833	15-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074223	FX	250,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074225	FX	250,000	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074226	FX	35,833	25-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074227	FX	250,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074229	FX	250,000	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074230	FX	35,833	29-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074231	FX	250,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074233	FX	250,000	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074234	FX	35,833	08-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074235	FX	250,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074237	FX	250,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074238	FX	35,833	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074240	FX	250,000	22-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074241	FX	250,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074242	FX	35,833	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074244	FX	250,000	01-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074245	FX	250,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074246	FX	35,833	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074248	FX	250,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074249	FX	250,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074250	FX	35,833	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074252	FX	250,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074253	FX	250,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074254	FX	35,833	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074255	FX	250,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074257	FX	250,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074258	FX	35,833	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074260	FX	250,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074261	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074262	FX	35,833	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074419	FX	200,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2074421	FX	200,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074422	FX	200,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074424	FX	200,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074425	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074427	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074428	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074430	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074431	FX	200,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074432	FX	200,000	02-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074433	FX	200,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074434	FX	200,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074436	FX	200,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074437	FX	200,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074439	FX	200,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074440	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074442	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074443	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074445	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074446	FX	200,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074447	FX	200,000	02-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074448	FX	200,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074449	FX	150,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074451	FX	150,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074452	FX	150,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074454	FX	150,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074498	FX	50,000	02-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074499	FX	50,000	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074501	FX	50,000	09-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074502	FX	50,000	09-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074504	FX	50,000	16-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074505	FX	50,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074507	FX	50,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074508	FX	50,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074510	FX	50,000	30-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074511	FX	50,000	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074519	FX	50,000	02-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074520	FX	50,000	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074522	FX	50,000	09-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074523	FX	50,000	09-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074525	FX	50,000	16-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074526	FX	50,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074528	FX	50,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074529	FX	50,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074531	FX	50,000	30-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074532	FX	50,000	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074539	FX	300,000	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074540	FX	300,000	05-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074541	FX	300,000	05-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2074542	FX	300,000	05-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074543	FX	300,000	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074544	FX	300,000	05-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074545	FX	300,000	05-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074546	FX	300,000	05-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074547	FX	300,000	08-ene-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074548	FX	300,000	08-ene-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074549	FX	300,000	05-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074550	FX	300,000	05-feb-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074551	FX	300,000	08-ene-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074552	FX	300,000	08-ene-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074553	FX	300,000	05-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074554	FX	300,000	05-feb-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074555	FX	6,503,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074557	FX	6,503,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074558	FX	6,503,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074560	FX	6,503,000	07-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074561	FX	150,000	08-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074562	FX	150,000	08-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074563	FX	150,000	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074564	FX	150,000	05-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074565	FX	150,000	08-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074566	FX	150,000	08-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074567	FX	150,000	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074568	FX	150,000	05-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074569	FX	150,000	08-ene-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074570	FX	150,000	08-ene-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074571	FX	150,000	05-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074572	FX	150,000	05-feb-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074573	FX	150,000	08-ene-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074574	FX	150,000	08-ene-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074575	FX	150,000	05-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074576	FX	150,000	05-feb-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074599	FX	73,911	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074601	FX	73,911	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074602	FX	73,911	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074604	FX	73,911	05-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074752	FX	300,000	11-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074753	FX	300,000	11-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074756	FX	300,000	11-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074757	FX	300,000	11-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074828	FX	50,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074829	FX	50,000	05-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074830	FX	50,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074831	FX	50,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074832	FX	50,000	12-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074833	FX	50,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074834	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2074836	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074837	FX	50,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074838	FX	50,000	26-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074839	FX	50,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074841	FX	50,000	02-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074842	FX	50,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074843	FX	50,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074844	FX	50,000	09-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074845	FX	50,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074847	FX	50,000	16-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074848	FX	50,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074850	FX	50,000	23-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074851	FX	50,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074853	FX	50,000	01-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074854	FX	50,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074856	FX	50,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074857	FX	50,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074859	FX	50,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074860	FX	50,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074862	FX	50,000	22-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074863	FX	50,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074873	FX	50,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074874	FX	50,000	05-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074875	FX	50,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074876	FX	50,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074877	FX	50,000	12-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074878	FX	50,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074879	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074881	FX	50,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074882	FX	50,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074883	FX	50,000	26-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074884	FX	50,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074886	FX	50,000	02-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074887	FX	50,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074888	FX	50,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074889	FX	50,000	09-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074890	FX	50,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074892	FX	50,000	16-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074893	FX	50,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074895	FX	50,000	23-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074896	FX	50,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074898	FX	50,000	01-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074899	FX	50,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074901	FX	50,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074902	FX	50,000	08-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074904	FX	50,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074905	FX	50,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074907	FX	50,000	22-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2074908	FX	50,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074917	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074919	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074920	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074922	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074923	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074925	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074994	FX	400,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074996	FX	400,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074997	FX	43,100	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075092	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075094	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075095	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075097	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075098	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075100	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075101	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075103	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075104	FX	400,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075106	FX	400,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075107	FX	43,100	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075108	FX	400,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075110	FX	400,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075111	FX	43,100	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075121	FX	65,000	03-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075122	FX	65,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075124	FX	65,000	10-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075125	FX	65,000	10-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075127	FX	65,000	17-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075128	FX	65,000	17-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075130	FX	65,000	24-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075131	FX	65,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075133	FX	65,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075134	FX	65,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075136	FX	65,000	10-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075137	FX	65,000	10-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075139	FX	65,000	17-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075140	FX	65,000	17-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075142	FX	65,000	24-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075143	FX	65,000	24-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075145	FX	65,000	31-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075146	FX	65,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075160	FX	65,000	03-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075161	FX	65,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075163	FX	65,000	10-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075164	FX	65,000	10-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075166	FX	65,000	17-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075167	FX	65,000	17-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2075169	FX	65,000	24-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075170	FX	65,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075172	FX	65,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075173	FX	65,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075175	FX	65,000	10-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075176	FX	65,000	10-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075178	FX	65,000	17-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075179	FX	65,000	17-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075181	FX	65,000	24-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075182	FX	65,000	24-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075184	FX	65,000	31-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075185	FX	65,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075456	FX	200,000	19-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075457	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075458	FX	10,821	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075460	FX	200,000	26-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075461	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075462	FX	10,821	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075464	FX	200,000	02-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075465	FX	200,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075466	FX	10,821	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075468	FX	200,000	09-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075469	FX	200,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075470	FX	10,821	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075472	FX	200,000	16-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075473	FX	200,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075474	FX	10,821	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075476	FX	200,000	23-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075477	FX	200,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075478	FX	10,821	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075480	FX	200,000	02-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075481	FX	200,000	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075482	FX	10,821	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075484	FX	200,000	09-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075488	FX	200,000	16-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075489	FX	200,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075490	FX	10,821	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075492	FX	200,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075493	FX	200,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075494	FX	10,821	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075496	FX	200,000	30-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075497	FX	200,000	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075498	FX	10,821	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075512	FX	200,000	19-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075513	FX	200,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075514	FX	10,821	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075516	FX	200,000	26-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075517	FX	200,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2075518	FX	10,821	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075520	FX	200,000	02-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075521	FX	200,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075522	FX	10,821	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075524	FX	200,000	09-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075525	FX	200,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075526	FX	10,821	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075528	FX	200,000	16-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075529	FX	200,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075530	FX	10,821	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075532	FX	200,000	23-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075533	FX	200,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075534	FX	10,821	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075536	FX	200,000	02-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075537	FX	200,000	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075538	FX	10,821	02-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075540	FX	200,000	09-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075544	FX	200,000	16-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075545	FX	200,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075546	FX	10,821	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075548	FX	200,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075549	FX	200,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075550	FX	10,821	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075552	FX	200,000	30-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075553	FX	200,000	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075554	FX	10,821	30-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075567	FX	35,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075568	FX	35,000	05-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075569	FX	35,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075570	FX	35,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075571	FX	35,000	12-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075572	FX	35,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075573	FX	35,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075575	FX	35,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075576	FX	35,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075577	FX	35,000	26-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075578	FX	35,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075580	FX	35,000	02-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075581	FX	35,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075582	FX	35,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075583	FX	35,000	09-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075584	FX	35,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075586	FX	35,000	16-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075587	FX	35,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075589	FX	35,000	23-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075590	FX	35,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075592	FX	35,000	01-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075593	FX	35,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2075595	FX	35,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075598	FX	35,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075599	FX	35,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075601	FX	35,000	22-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075602	FX	35,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075604	FX	35,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075605	FX	35,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075606	FX	35,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075607	FX	35,000	05-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075608	FX	35,000	05-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075609	FX	35,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075610	FX	35,000	12-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075611	FX	35,000	12-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075612	FX	35,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075614	FX	35,000	19-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075615	FX	35,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075616	FX	35,000	26-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075617	FX	35,000	26-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075619	FX	35,000	02-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075620	FX	35,000	02-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075621	FX	35,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075622	FX	35,000	09-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075623	FX	35,000	09-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075625	FX	35,000	16-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075626	FX	35,000	16-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075628	FX	35,000	23-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075629	FX	35,000	23-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075631	FX	35,000	01-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075632	FX	35,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075634	FX	35,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075637	FX	35,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075638	FX	35,000	12-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075640	FX	35,000	22-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075641	FX	35,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075643	FX	35,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075644	FX	35,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075645	FX	250,000	14-ene-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075646	FX	250,000	14-ene-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075647	FX	250,000	11-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075649	FX	250,000	26-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075650	FX	250,000	26-feb-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075651	FX	250,000	14-ene-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075652	FX	250,000	14-ene-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075653	FX	250,000	11-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075655	FX	250,000	26-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075656	FX	250,000	26-feb-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075657	FX	200,000	14-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075658	FX	200,000	14-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2075659	FX	200,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075660	FX	200,000	11-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075661	FX	200,000	26-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075662	FX	200,000	26-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075663	FX	200,000	14-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075664	FX	200,000	14-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075665	FX	200,000	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075666	FX	200,000	11-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075667	FX	200,000	26-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075668	FX	200,000	26-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075677	FX	300,000	05-mar-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075678	FX	300,000	05-mar-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075693	FX	300,000	05-mar-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075694	FX	300,000	05-mar-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075698	FX	100,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075702	FX	100,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075706	FX	100,000	04-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075710	FX	100,000	04-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075722	FX	100,000	25-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075730	FX	100,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075738	FX	100,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075750	FX	100,000	25-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075808	FX	100,000	16-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075809	FX	100,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075810	FX	6,039	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075832	FX	100,000	16-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075833	FX	100,000	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075834	FX	6,039	16-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075856	FX	100,000	18-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075860	FX	100,000	18-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075895	FX	6,500	04-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075896	FX	6,500	04-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075897	FX	6,500	04-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075898	FX	6,500	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075900	FX	6,500	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075901	FX	6,500	18-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075902	FX	6,500	18-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075903	FX	6,500	18-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075905	FX	6,500	25-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075906	FX	6,500	25-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075908	FX	20,500	04-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075909	FX	20,500	04-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075911	FX	6,500	11-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075912	FX	6,500	11-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075913	FX	20,500	18-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075914	FX	20,500	18-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075915	FX	20,500	18-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075917	FX	6,500	25-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2075918	FX	6,500	25-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075919	FX	20,500	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075920	FX	20,500	31-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075921	FX	20,500	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075949	FX	6,500	04-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075950	FX	6,500	04-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075951	FX	6,500	04-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075952	FX	6,500	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075954	FX	6,500	11-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075955	FX	6,500	18-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075956	FX	6,500	18-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075957	FX	6,500	18-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075959	FX	6,500	25-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075960	FX	6,500	25-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075962	FX	20,500	04-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075963	FX	20,500	04-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075965	FX	6,500	11-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075966	FX	6,500	11-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075967	FX	20,500	18-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075968	FX	20,500	18-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075969	FX	20,500	18-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075971	FX	6,500	25-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075972	FX	6,500	25-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075973	FX	20,500	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075974	FX	20,500	31-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075975	FX	20,500	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076009	FX	50,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076010	FX	50,000	12-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076011	FX	50,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076013	FX	50,000	22-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076014	FX	50,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076016	FX	50,000	01-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076017	FX	50,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076019	FX	50,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076022	FX	50,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076025	FX	50,000	22-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076026	FX	50,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076028	FX	50,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076029	FX	50,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076042	FX	50,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076043	FX	50,000	12-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076044	FX	50,000	12-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076046	FX	50,000	22-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076047	FX	50,000	22-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076049	FX	50,000	01-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076050	FX	50,000	01-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076052	FX	50,000	08-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076055	FX	50,000	12-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2076058	FX	50,000	22-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076059	FX	50,000	22-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076061	FX	50,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076062	FX	50,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076203	FX	100,000	26-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076204	FX	100,000	26-feb-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076205	FX	100,000	26-feb-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076206	FX	100,000	26-feb-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076207	FX	100,000	31-mar-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076208	FX	100,000	31-mar-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076209	FX	100,000	31-mar-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076210	FX	100,000	31-mar-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076227	FX	200,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076228	FX	200,000	31-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076245	FX	200,000	26-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076246	FX	200,000	26-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076259	FX	200,000	26-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076260	FX	200,000	26-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076262	FX	150,000	02-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076266	FX	150,000	09-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076270	FX	150,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076314	FX	150,000	02-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076318	FX	150,000	09-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076322	FX	150,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076365	FX	200,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076366	FX	200,000	31-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076368	FX	50,000	25-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076371	FX	50,000	30-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076377	FX	50,000	25-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076380	FX	50,000	30-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076454	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076456	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076457	FX	19,481	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076458	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076460	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076461	FX	8,170	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076462	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076464	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076465	FX	29,271	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076474	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076476	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076477	FX	8,949	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076478	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076480	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076481	FX	9,740	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076482	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076484	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076485	FX	250,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2076486	FX	250,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076487	FX	250,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076488	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076490	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076497	FX	2,000,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076498	FX	2,000,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076503	FX	2,000,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076504	FX	2,000,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076509	FX	300,000	30-mar-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076510	FX	300,000	30-mar-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076511	FX	300,000	30-mar-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076512	FX	300,000	30-mar-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077087	FX	50,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077088	FX	50,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077089	FX	2,817	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077222	FX	50,000	23-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077223	FX	50,000	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077224	FX	2,817	23-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077459	FX	100,000	24-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077483	FX	100,000	24-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021010403001	FWD	USDMXN	01/05/2021	4,304,607	19.77551	(85,125,774)
2021010403002	FWD	USDMXN	01/06/2021	(4,304,607)	19.7776	85,134,790
2021010403307	FWD	USDMXN	01/06/2021	(30,000,000)	19.85	595,500,000
2021010403406	FWD	USDMXN	01/06/2021	(49,423,393)	19.94	985,502,458
2021010403294	FWD	USDMXN	01/06/2021	26,184,883	19.85	(519,769,920)
2021010403441	FWD	USDMXN	01/06/2021	54,570,000	19.85	(1,083,214,500)
2021010403308	FWD	USDMXN	01/13/2021	30,000,000	19.8659	(595,977,000)
2021010403295	FWD	USDMXN	01/15/2021	(26,158,000)	19.8704	519,769,920
2021010403407	FWD	USDMXN	01/20/2021	49,423,393	19.9718	(987,074,122)
2021010403442	FWD	USDMXN	01/22/2021	(54,570,000)	19.8861	1,085,184,477
2021010503009	FWD	USDMXN	01/06/2021	3,000,000	20.06136	(60,184,088)
2021010503010	FWD	USDMXN	01/07/2021	(3,000,000)	20.0634	60,190,200
2021010503078	FWD	USDMXN	01/07/2021	3,000,000	19.995	(59,985,000)
2021010503079	FWD	USDMXN	01/07/2022	(3,000,000)	20.83	62,490,000
2021010703008	FWD	USDMXN	01/08/2021	(386,667)	19.82629	7,666,168
2021010703009	FWD	USDMXN	01/11/2021	386,667	19.8322	(7,668,453)
2021010703418	FWD	USDMXN	03/11/2021	(25,000,000)	20.085	502,125,000
2021010703419	FWD	USDMXN	04/12/2021	25,000,000	20.156	(503,900,000)
2021010803002	FWD	USDMXN	01/11/2021	(11,386,667)	19.9943	227,668,390
2021010803003	FWD	USDMXN	01/12/2021	11,386,667	19.9962	(227,690,067)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011103000	FWD	USDMXN	01/12/2021	(386,667)	20.16887	7,798,631
2021011103001	FWD	USDMXN	01/13/2021	386,667	20.1708	(7,799,379)
2021011203025	FWD	USDMXN	01/12/2021	(27,200,000)	20	544,000,000
2021011203027	FWD	USDMXN	01/12/2021	27,200,000	20	(544,000,000)
2021011203028	FWD	USDMXN	01/13/2021	(27,200,000)	20.0023	544,062,560
2021011203008	FWD	USDMXN	01/13/2021	30,000,000	20.03	(600,900,000)
2021011203026	FWD	USDMXN	01/13/2021	27,200,000	20.0022	(544,059,840)
2021011203036	FWD	USDMXN	01/13/2021	14,613,333	19.957	(291,638,291)
2021011203009	FWD	USDMXN	01/14/2021	(30,000,000)	20.03205	600,961,500
2021011203037	FWD	USDMXN	01/14/2021	(14,613,333)	19.9589	291,666,056
2021011303209	FWD	USDMXN	01/15/2021	20,119,773	19.805	(398,472,097)
2021011303210	FWD	USDMXN	01/19/2021	(20,119,773)	19.8138	398,649,151
2021011403075	FWD	USDMXN	03/19/2021	(10,000,000)	19.975	199,750,000
2021011403076	FWD	USDMXN	04/19/2021	10,000,000	20.0455	(200,455,000)
2021011503029	FWD	USDMXN	01/19/2021	30,000,000	19.87	(596,100,000)
2021011503030	FWD	USDMXN	01/20/2021	(30,000,000)	19.87238	596,171,250
2021011503346	FWD	USDMXN	01/20/2021	(25,000,000)	19.765	494,125,000
2021011503349	FWD	USDMXN	01/20/2021	(22,338,780)	19.765	441,525,994
2021011503194	FWD	USDMXN	01/20/2021	20,000,000	19.825	(396,500,000)
2021011503190	FWD	USDMXN	01/21/2021	(20,000,000)	19.83	396,600,000
2021011503347	FWD	USDMXN	01/21/2021	25,000,000	19.76733	(494,183,125)
2021011503350	FWD	USDMXN	01/21/2021	22,338,780	19.76733	(441,577,932)
2021011503195	FWD	USDMXN	02/22/2021	(20,000,000)	19.8993	397,986,000
2021011503191	FWD	USDMXN	02/22/2021	20,000,000	19.902	(398,040,000)
2021011503166	FWD	USDMXN	03/19/2021	(10,000,000)	19.94	199,400,000
2021011503167	FWD	USDMXN	04/19/2021	10,000,000	20.0095	(200,095,000)
2021011903039	FWD	USDMXN	01/20/2021	(50,000,000)	19.68	984,000,000
2021011903036	FWD	USDMXN	01/20/2021	50,000,000	19.68	(984,000,000)
2021011903037	FWD	USDMXN	01/21/2021	(50,000,000)	19.6823	984,115,000
2021011903337	FWD	USDMXN	01/21/2021	(30,000,000)	19.64	589,200,000
2021011903040	FWD	USDMXN	01/21/2021	50,000,000	19.6823	(984,115,000)
2021011903199	FWD	USDMXN	01/21/2021	15,000,000	19.67	(295,050,000)
2021011903143	FWD	USDMXN	01/22/2021	(15,000,000)	19.68	295,200,000
2021011903338	FWD	USDMXN	01/22/2021	30,000,000	19.6423	(589,269,000)
2021011903200	FWD	USDMXN	03/22/2021	(15,000,000)	19.806	297,090,000
2021011903144	FWD	USDMXN	03/22/2021	15,000,000	19.812	(297,180,000)
2021011903322	FWD	USDMXN	06/28/2021	(10,150,000)	20.02	203,203,000
2021011903328	FWD	USDMXN	06/28/2021	(1,650,000)	20.024	33,039,600
2021011903329	FWD	USDMXN	06/28/2021	(400,000)	20.02	8,008,000
2021012003080	FWD	USDMXN	01/21/2021	(24,500,000)	19.58	479,710,000
2021012003082	FWD	USDMXN	01/21/2021	(38,780)	19.56105	758,585
2021012003081	FWD	USDMXN	01/22/2021	24,500,000	19.58238	(479,768,188)
2021012003083	FWD	USDMXN	01/22/2021	38,780	19.5634	(758,676)
2021012103236	FWD	USDMXN	01/22/2021	(15,000,000)	19.67	295,050,000
2021012103060	FWD	USDMXN	01/22/2021	19,859,366	19.61	(389,442,158)
2021012103262	FWD	USDMXN	01/22/2021	15,000,000	19.7	(295,500,000)
2021012103061	FWD	USDMXN	01/25/2021	(19,859,366)	19.61675	389,576,208
2021012103234	FWD	USDMXN	01/25/2021	(15,000,000)	19.675	295,125,000
2021012103263	FWD	USDMXN	01/25/2021	(15,000,000)	19.7067	295,600,500
2021012103129	FWD	USDMXN	01/25/2021	20,000,000	19.71	(394,200,000)
2021012103237	FWD	USDMXN	01/25/2021	15,000,000	19.6767	(295,150,500)
2021012103130	FWD	USDMXN	01/26/2021	(20,000,000)	19.71233	394,246,500

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012103235	FWD	USDMXN	01/26/2021	15,000,000	19.6772	(295,158,000)
2021012203032	FWD	USDMXN	01/25/2021	(26,390,634)	19.965	526,889,018
2021012203162	FWD	USDMXN	01/25/2021	(83,970,000)	20	1,679,400,000
2021012203253	FWD	USDMXN	01/25/2021	83,970,000	19.96	(1,676,041,200)
2021012203254	FWD	USDMXN	01/26/2021	(83,970,000)	19.96233	1,676,236,430
2021012203302	FWD	USDMXN	01/26/2021	(15,000,000)	19.98	299,700,000
2021012203322	FWD	USDMXN	01/26/2021	(40,000,000)	19.98	799,200,000
2021012203433	FWD	USDMXN	01/26/2021	(10,000,000)	19.92	199,200,000
2021012203033	FWD	USDMXN	01/26/2021	26,390,634	19.96728	(526,949,056)
2021012203157	FWD	USDMXN	01/26/2021	100,000,000	19.985	(1,998,500,000)
2021012203158	FWD	USDMXN	02/02/2021	(100,000,000)	20.00095	2,000,095,000
2021012203163	FWD	USDMXN	02/02/2021	83,970,000	20.01805	(1,680,915,659)
2021012203303	FWD	USDMXN	02/02/2021	15,000,000	19.99595	(299,939,250)
2021012203323	FWD	USDMXN	02/02/2021	40,000,000	19.996	(799,840,000)
2021012203434	FWD	USDMXN	06/28/2021	10,000,000	20.262	(202,620,000)
2021012503109	FWD	USDMXN	01/26/2021	579,366	20.17784	(11,690,346)
2021012503110	FWD	USDMXN	01/27/2021	(579,366)	20.1801	11,691,654
2021012603009	FWD	USDMXN	01/27/2021	27,500,000	20.01	(550,275,000)
2021012603012	FWD	USDMXN	01/27/2021	79,366	20.00301	(1,587,549)
2021012603010	FWD	USDMXN	01/28/2021	(27,500,000)	20.0124	550,341,000
2021012603013	FWD	USDMXN	01/28/2021	(79,366)	20.0053	1,587,731
2021012703080	FWD	USDMXN	01/28/2021	16,429,064	20.23	(332,359,969)
2021012703081	FWD	USDMXN	01/29/2021	(16,429,064)	20.23235	332,398,578
2021012703025	FWD	USDMXN	01/29/2021	26,000,000	20.22	(525,720,000)
2021012703086	FWD	USDMXN	01/29/2021	42,397	20.2509	(858,586)
2021012703026	FWD	USDMXN	02/02/2021	(26,000,000)	20.2295	525,967,000
2021012703087	FWD	USDMXN	02/02/2021	(42,397)	20.26025	858,983
2021012903006	FWD	USDMXN	02/02/2021	(3,427,603)	20.18199	69,175,848
2021012903007	FWD	USDMXN	02/03/2021	3,427,603	20.1842	(69,183,416)
2021020203004	FWD	USDMXN	02/03/2021	(6,855,205)	20.23748	138,732,067
2021020203002	FWD	USDMXN	02/03/2021	3,427,603	20.23427	(69,355,025)
2021020203003	FWD	USDMXN	02/04/2021	(3,427,603)	20.2364	69,362,337
2021020203005	FWD	USDMXN	02/04/2021	6,855,205	20.2397	(138,747,295)
2021020303000	FWD	USDMXN	02/04/2021	(3,427,603)	20.16337	69,112,012
2021020303050	FWD	USDMXN	02/05/2021	(123,712,384)	20.13	2,490,330,286
2021020303150	FWD	USDMXN	02/05/2021	(14,700,000)	20.2	296,940,000
2021020303001	FWD	USDMXN	02/05/2021	3,427,603	20.1657	(69,120,005)
2021020303090	FWD	USDMXN	02/05/2021	70,000,000	20.145	(1,410,150,000)
2021020303094	FWD	USDMXN	02/05/2021	50,000,000	20.145	(1,007,250,000)
2021020303091	FWD	USDMXN	02/12/2021	(70,000,000)	20.1609	1,411,263,000
2021020303095	FWD	USDMXN	02/12/2021	(50,000,000)	20.1609	1,008,045,000
2021020303051	FWD	USDMXN	02/12/2021	123,615,972	20.1457	(2,490,330,286)
2021020303151	FWD	USDMXN	02/12/2021	14,700,000	20.2159	(297,173,730)
2021020403020	FWD	USDMXN	02/05/2021	14,501,703	20.3	(294,384,562)
2021020403021	FWD	USDMXN	02/12/2021	(14,501,703)	20.316	294,616,589
2021020403385	FWD	USDMXN	10/29/2021	(45,030)	21.01517	946,317
2021020803075	FWD	USDMXN	02/09/2021	(10,000,000)	20.1	201,000,000
2021020803076	FWD	USDMXN	02/10/2021	10,000,000	20.10228	(201,022,750)
2021020903038	FWD	USDMXN	02/10/2021	(10,000,000)	20.1	201,000,000
2021020903039	FWD	USDMXN	02/11/2021	10,000,000	20.1022	(201,022,000)
2021021003005	FWD	USDMXN	02/11/2021	3,000,000	20.10751	(60,322,517)
2021021003006	FWD	USDMXN	02/12/2021	(3,000,000)	20.1096	60,328,800

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021021003090	FWD	USDMXN	02/12/2021	(124,155,043)	20.055	2,489,929,389
2021021003118	FWD	USDMXN	02/12/2021	20,000,000	20.06	(401,200,000)
2021021003163	FWD	USDMXN	02/12/2021	100,000,000	20.058	(2,005,800,000)
2021021003119	FWD	USDMXN	02/17/2021	(20,000,000)	20.07085	401,417,000
2021021003164	FWD	USDMXN	02/19/2021	(100,000,000)	20.0733	2,007,330,000
2021021003091	FWD	USDMXN	02/19/2021	124,060,397	20.0703	(2,489,929,389)
2021021103003	FWD	USDMXN	02/12/2021	2,859,461	19.90394	(56,914,545)
2021021103004	FWD	USDMXN	02/16/2021	(2,859,461)	19.9122	56,938,159
2021021203526	FWD	USDMXN	02/17/2021	15,000,000	19.97	(299,550,000)
2021021203113	FWD	USDMXN	06/17/2021	(71,130,000)	20.2725	1,441,982,925
2021021203216	FWD	USDMXN	06/17/2021	50,000,000	20.218	(1,010,900,000)
2021021203212	FWD	USDMXN	07/28/2021	14,630,000	20.3085	(297,113,355)
2021021203217	FWD	USDMXN	08/17/2021	(50,000,000)	20.3525	1,017,625,000
2021021203527	FWD	USDMXN	08/17/2021	(15,000,000)	20.3605	305,407,500
2021021203114	FWD	USDMXN	08/17/2021	71,130,000	20.4085	(1,451,656,605)
2021021603037	FWD	USDMXN	02/17/2021	(14,800,000)	20.188	298,782,400
2021021603027	FWD	USDMXN	02/17/2021	40,000,000	20.188	(807,520,000)
2021021603039	FWD	USDMXN	02/17/2021	449,553	20.21293	(9,086,783)
2021021603028	FWD	USDMXN	02/18/2021	(40,000,000)	20.1902	807,608,000
2021021603040	FWD	USDMXN	02/18/2021	(449,553)	20.2151	9,087,758
2021021603038	FWD	USDMXN	02/18/2021	14,800,000	20.1902	(298,814,960)
2021021703032	FWD	USDMXN	02/18/2021	(50,447)	20.35093	1,026,644
2021021703110	FWD	USDMXN	02/18/2021	(14,900,000)	20.32	302,768,000
2021021703005	FWD	USDMXN	02/18/2021	30,000,000	20.32	(609,600,000)
2021021703115	FWD	USDMXN	02/18/2021	100,000	20.30282	(2,030,282)
2021021703006	FWD	USDMXN	02/19/2021	(30,000,000)	20.32223	609,666,750
2021021703116	FWD	USDMXN	02/19/2021	(100,000)	20.305	2,030,500
2021021703033	FWD	USDMXN	02/19/2021	50,447	20.3532	(1,026,758)
2021021703111	FWD	USDMXN	02/19/2021	14,900,000	20.3222	(302,800,780)
2021021803086	FWD	USDMXN	02/19/2021	(14,800,000)	20.36	301,328,000
2021021803004	FWD	USDMXN	02/19/2021	815,822	20.21097	(16,488,559)
2021021803005	FWD	USDMXN	02/22/2021	(815,822)	20.2174	16,493,804
2021021803378	FWD	USDMXN	02/22/2021	(34,000,000)	20.41	693,940,000
2021021803087	FWD	USDMXN	02/22/2021	14,800,000	20.3665	(301,424,200)
2021021803431	FWD	USDMXN	02/22/2021	20,000,000	20.38	(407,600,000)
2021021803432	FWD	USDMXN	03/01/2021	(20,000,000)	20.3952	407,904,000
2021021803379	FWD	USDMXN	03/01/2021	34,000,000	20.4252	(694,456,800)
2021021903017	FWD	USDMXN	02/22/2021	(184,178)	20.39098	3,755,565
2021021903018	FWD	USDMXN	02/23/2021	184,178	20.3932	(3,755,974)
2021022203040	FWD	USDMXN	02/23/2021	(184,178)	20.71054	3,814,421
2021022203041	FWD	USDMXN	02/24/2021	184,178	20.7128	(3,814,837)
2021022203140	FWD	USDMXN	02/24/2021	5,000,000	20.73	(103,650,000)
2021022203141	FWD	USDMXN	11/24/2021	(5,000,000)	21.346	106,730,000
2021022303008	FWD	USDMXN	02/23/2021	(2,055,867)	20.67748	42,510,140
2021022303045	FWD	USDMXN	02/24/2021	(184,178)	20.6968	3,811,890
2021022303009	FWD	USDMXN	02/24/2021	2,055,867	20.67982	(42,514,966)
2021022303046	FWD	USDMXN	02/25/2021	184,178	20.6991	(3,812,314)
2021022303110	FWD	USDMXN	06/25/2021	20,000,000	20.8075	(416,150,000)
2021022303111	FWD	USDMXN	08/25/2021	(20,000,000)	20.945	418,900,000
2021022403180	FWD	USDMXN	02/25/2021	10,815,822	20.46911	(221,390,303)
2021022403181	FWD	USDMXN	02/26/2021	(10,815,822)	20.4713	221,413,942
2021022503277	FWD	USDMXN	02/25/2021	(305,000)	20.88549	6,370,073

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021022503020	FWD	USDMXN	02/26/2021	(504,812)	20.6564	10,427,605
2021022503068	FWD	USDMXN	02/26/2021	1,009,624	20.75237	(20,952,099)
2021022503278	FWD	USDMXN	02/26/2021	305,000	20.88787	(6,370,800)
2021022503069	FWD	USDMXN	03/01/2021	(1,009,624)	20.7588	20,958,593
2021022503021	FWD	USDMXN	03/01/2021	504,812	20.6631	(10,430,986)
2021022603353	FWD	USDMXN	03/01/2021	(33,600,000)	20.94	703,584,000
2021022603006	FWD	USDMXN	03/01/2021	1,504,812	20.91529	(31,473,590)
2021022603093	FWD	USDMXN	03/01/2021	33,600,000	20.926	(703,113,600)
2021022603007	FWD	USDMXN	03/02/2021	(1,504,812)	20.9175	31,476,910
2021022603094	FWD	USDMXN	03/02/2021	(33,600,000)	20.92838	703,193,400
2021022603335	FWD	USDMXN	03/02/2021	(50,000,000)	20.914	1,045,700,000
2021022603354	FWD	USDMXN	03/02/2021	33,600,000	20.94233	(703,662,120)
2021022603321	FWD	USDMXN	04/14/2021	57,680,000	21.0061	(1,211,631,848)
2021022603322	FWD	USDMXN	06/01/2021	(57,680,000)	21.1101	1,217,630,568
2021022603336	FWD	USDMXN	06/02/2021	50,000,000	21.1155	(1,055,775,000)
2021030103027	FWD	USDMXN	03/01/2021	(10,000,000)	20.66	206,600,000
2021030103002	FWD	USDMXN	03/02/2021	(33,000,000)	20.87	688,710,000
2021030103028	FWD	USDMXN	03/02/2021	10,000,000	20.6623	(206,623,000)
2021030103031	FWD	USDMXN	03/02/2021	30,504,812	20.67	(630,534,469)
2021030103032	FWD	USDMXN	03/03/2021	(30,504,812)	20.6723	630,604,630
2021030103187	FWD	USDMXN	03/03/2021	(70,000,000)	20.61	1,442,700,000
2021030103269	FWD	USDMXN	03/03/2021	70,000,000	20.625	(1,443,750,000)
2021030103306	FWD	USDMXN	03/03/2021	50,000,000	20.655	(1,032,750,000)
2021030103003	FWD	USDMXN	03/09/2021	33,000,000	20.8856	(689,224,800)
2021030103270	FWD	USDMXN	04/05/2021	(70,000,000)	20.6977	1,448,839,000
2021030103307	FWD	USDMXN	04/05/2021	(50,000,000)	20.7278	1,036,390,000
2021030103143	FWD	USDMXN	04/15/2021	62,430,000	20.6748	(1,290,727,764)
2021030103144	FWD	USDMXN	06/30/2021	(62,430,000)	20.8388	1,300,966,284
2021030103188	FWD	USDMXN	07/06/2021	70,000,000	20.8835	(1,461,845,000)
2021030203004	FWD	USDMXN	03/03/2021	(2,495,188)	20.66931	51,573,818
2021030203005	FWD	USDMXN	03/04/2021	2,495,188	20.6716	(51,579,523)
2021030303039	FWD	USDMXN	03/04/2021	12,932,180	20.78207	(268,757,450)
2021030303040	FWD	USDMXN	03/05/2021	(12,932,180)	20.7843	268,786,303
2021030403012	FWD	USDMXN	03/05/2021	12,545,513	20.88	(261,950,310)
2021030403013	FWD	USDMXN	03/08/2021	(12,545,513)	20.88675	262,034,992
2021030503005	FWD	USDMXN	03/05/2021	(294,000)	21.22559	6,240,325
2021030503003	FWD	USDMXN	03/08/2021	12,545,513	21.24823	(266,570,003)
2021030503006	FWD	USDMXN	03/08/2021	294,000	21.23256	(6,242,372)
2021030503004	FWD	USDMXN	03/09/2021	(12,545,513)	21.2505	266,598,422
2021030503048	FWD	USDMXN	03/09/2021	(32,000,000)	21.25	680,000,000
2021030503063	FWD	USDMXN	03/09/2021	10,000,000	21.185	(211,850,000)
2021030503049	FWD	USDMXN	03/11/2021	32,000,000	21.2545	(680,144,000)
2021030503602	FWD	USDMXN	03/17/2021	20,000,000	21.337	(426,740,000)
2021030503603	FWD	USDMXN	06/16/2021	(20,000,000)	21.5412	430,824,000
2021030503064	FWD	USDMXN	09/09/2021	(10,000,000)	21.607	216,070,000
2021030803003	FWD	USDMXN	03/09/2021	1,545,513	21.54284	(33,294,738)
2021030803004	FWD	USDMXN	03/10/2021	(1,545,513)	21.5451	33,298,230
2021030803355	FWD	USDMXN	03/10/2021	(15,000,000)	21.443	321,645,000
2021030803366	FWD	USDMXN	03/10/2021	(25,000,000)	21.45	536,250,000
2021030803363	FWD	USDMXN	03/10/2021	25,000,000	21.45	(536,250,000)
2021030803364	FWD	USDMXN	03/17/2021	(25,000,000)	21.4667	536,667,500
2021030803367	FWD	USDMXN	03/17/2021	25,000,000	21.4667	(536,667,500)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021030803356	FWD	USDMXN	09/10/2021	15,000,000	21.8755	(328,132,500)
2021030803059	FWD	USDMXN	09/15/2021	(46,790,000)	21.9035	1,024,864,765
2021030803244	FWD	USDMXN	09/15/2021	45,000,000	21.846	(983,070,000)
2021030803245	FWD	USDMXN	12/10/2021	(45,000,000)	22.065	992,925,000
2021030803060	FWD	USDMXN	01/10/2022	46,790,000	22.2005	(1,038,761,395)
2021030803063	FWD	USDMXN	01/10/2022	46,410,000	22.2005	(1,030,325,205)
2021030803064	FWD	USDMXN	03/10/2022	(46,410,000)	22.3535	1,037,425,935
2021030903169	FWD	USDMXN	03/10/2021	(12,900,000)	21.28604	274,589,922
2021030903030	FWD	USDMXN	03/10/2021	45,513	21.26229	(967,709)
2021030903181	FWD	USDMXN	03/10/2021	11,900,000	21.28	(253,232,000)
2021030903031	FWD	USDMXN	03/11/2021	(45,513)	21.2646	967,814
2021030903182	FWD	USDMXN	03/11/2021	(11,900,000)	21.28236	253,260,084
2021030903200	FWD	USDMXN	03/11/2021	(19,800,000)	21.285	421,443,000
2021030903170	FWD	USDMXN	03/11/2021	12,900,000	21.2884	(274,620,360)
2021030903639	FWD	USDMXN	03/11/2021	44,000,000	21.22	(933,680,000)
2021030903640	FWD	USDMXN	03/12/2021	(44,000,000)	21.22233	933,782,300
2021030903201	FWD	USDMXN	03/12/2021	19,800,000	21.2873	(421,488,540)
2021031003017	FWD	USDMXN	03/11/2021	4,959,139	21.07431	(104,510,426)
2021031003018	FWD	USDMXN	03/12/2021	(4,959,139)	21.0766	104,521,796
2021031003154	FWD	USDMXN	12/13/2021	(45,000,000)	21.701	976,545,000
2021031003155	FWD	USDMXN	03/14/2022	45,000,000	21.93	(986,850,000)
2021031103004	FWD	USDMXN	03/11/2021	(1,999,999)	20.72248	41,444,933
2021031103212	FWD	USDMXN	03/12/2021	(13,800,000)	20.75	286,350,000
2021031103005	FWD	USDMXN	03/12/2021	1,999,999	20.72473	(41,449,428)
2021031103139	FWD	USDMXN	03/12/2021	13,800,000	20.72	(285,936,000)
2021031103260	FWD	USDMXN	03/12/2021	772,473	20.65394	(15,954,599)
2021031103140	FWD	USDMXN	03/16/2021	(13,800,000)	20.7288	286,057,440
2021031103261	FWD	USDMXN	03/16/2021	(772,473)	20.6625	15,961,214
2021031103145	FWD	USDMXN	03/16/2021	13,800,000	20.73	(286,074,000)
2021031103213	FWD	USDMXN	03/16/2021	13,800,000	20.75865	(286,469,370)
2021031103146	FWD	USDMXN	03/17/2021	(13,800,000)	20.73223	286,104,705
2021031203025	FWD	USDMXN	03/16/2021	(127,527)	20.74217	2,645,197
2021031203026	FWD	USDMXN	03/17/2021	127,527	20.7444	(2,645,481)
2021031603014	FWD	USDMXN	03/16/2021	(70,000,000)	20.637	1,444,590,000
2021031603016	FWD	USDMXN	03/16/2021	70,000,000	20.637	(1,444,590,000)
2021031603008	FWD	USDMXN	03/17/2021	(20,000,000)	20.6228	412,455,974
2021031603011	FWD	USDMXN	03/17/2021	(25,027,527)	20.62698	516,242,196
2021031603017	FWD	USDMXN	03/17/2021	(70,000,000)	20.63915	1,444,740,500
2021031603034	FWD	USDMXN	03/17/2021	(20,000,000)	20.63	412,600,000
2021031603015	FWD	USDMXN	03/17/2021	70,000,000	20.63915	(1,444,740,500)
2021031603018	FWD	USDMXN	03/17/2021	13,800,000	20.64	(284,832,000)
2021031603019	FWD	USDMXN	03/18/2021	(13,800,000)	20.64223	284,862,705
2021031603009	FWD	USDMXN	03/18/2021	20,000,000	20.625	(412,500,000)
2021031603012	FWD	USDMXN	03/18/2021	25,027,527	20.6292	(516,297,870)
2021031603035	FWD	USDMXN	03/18/2021	20,000,000	20.6322	(412,644,000)
2021031703008	FWD	USDMXN	03/18/2021	(10,000,000)	20.725	207,250,000
2021031703031	FWD	USDMXN	03/18/2021	(44,927,527)	20.697	929,865,036
2021031703014	FWD	USDMXN	03/18/2021	13,700,000	20.71	(283,727,000)
2021031703010	FWD	USDMXN	03/19/2021	(10,000,000)	20.73	207,300,000
2021031703015	FWD	USDMXN	03/19/2021	(13,700,000)	20.71225	283,757,825
2021031703009	FWD	USDMXN	03/19/2021	10,000,000	20.72728	(207,272,750)
2021031703032	FWD	USDMXN	03/19/2021	44,927,527	20.6993	(929,968,369)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031703011	FWD	USDMXN	03/22/2021	10,000,000	20.73675	(207,367,500)
2021031703140	FWD	USDMXN	06/21/2021	30,000,000	20.9045	(627,135,000)
2021031703141	FWD	USDMXN	07/19/2021	(30,000,000)	20.9695	629,085,000
2021031803052	FWD	USDMXN	03/19/2021	(45,300,861)	20.48	927,761,635
2021031803044	FWD	USDMXN	03/19/2021	33,300,000	20.48	(681,984,000)
2021031803045	FWD	USDMXN	03/22/2021	(33,300,000)	20.4867	682,207,110
2021031803439	FWD	USDMXN	03/22/2021	(25,000,000)	20.358	508,950,000
2021031803053	FWD	USDMXN	03/22/2021	45,300,861	20.4867	(928,065,150)
2021031803298	FWD	USDMXN	04/05/2021	50,000,000	20.5	(1,025,000,000)
2021031803440	FWD	USDMXN	04/05/2021	25,000,000	20.3886	(509,715,000)
2021031803588	FWD	USDMXN	04/05/2021	19,000,000	20.465	(388,835,000)
2021031803589	FWD	USDMXN	04/14/2021	(19,000,000)	20.485	389,215,000
2021031803299	FWD	USDMXN	04/22/2021	(50,000,000)	20.5375	1,026,875,000
2021031903126	FWD	USDMXN	03/22/2021	(41,200,861)	20.45	842,557,609
2021031903033	FWD	USDMXN	03/22/2021	19,200,000	20.45	(392,640,000)
2021031903034	FWD	USDMXN	03/23/2021	(19,200,000)	20.45225	392,683,200
2021031903349	FWD	USDMXN	03/23/2021	(26,000,000)	20.5	533,000,000
2021031903127	FWD	USDMXN	03/23/2021	41,200,861	20.45225	(842,650,311)
2021031903350	FWD	USDMXN	12/23/2021	26,000,000	21.149	(549,874,000)
2021032203008	FWD	USDMXN	03/23/2021	(34,800,861)	20.71	720,725,833
2021032203010	FWD	USDMXN	03/23/2021	18,800,000	20.71	(389,348,000)
2021032203011	FWD	USDMXN	03/24/2021	(18,800,000)	20.71228	389,390,770
2021032203009	FWD	USDMXN	03/24/2021	34,800,861	20.71228	(720,805,005)
2021032303014	FWD	USDMXN	03/24/2021	(34,800,861)	20.675	719,507,803
2021032303012	FWD	USDMXN	03/24/2021	18,800,000	20.675	(388,690,000)
2021032303013	FWD	USDMXN	03/25/2021	(18,800,000)	20.67725	388,732,300
2021032303235	FWD	USDMXN	03/25/2021	(80,000,000)	20.68	1,654,400,000
2021032303015	FWD	USDMXN	03/25/2021	34,800,861	20.67725	(719,586,105)
2021032303240	FWD	USDMXN	03/25/2021	18,900,000	20.69	(391,041,000)
2021032303241	FWD	USDMXN	03/26/2021	(18,900,000)	20.69228	391,084,092
2021032303236	FWD	USDMXN	04/05/2021	80,000,000	20.7037	(1,656,296,000)
2021032403012	FWD	USDMXN	03/25/2021	(14,900,861)	20.8	309,937,910
2021032403028	FWD	USDMXN	03/26/2021	(15,000,000)	20.812	312,180,000
2021032403013	FWD	USDMXN	03/26/2021	14,900,861	20.80235	(309,972,927)
2021032403301	FWD	USDMXN	03/26/2021	10,000,000	20.805	(208,050,000)
2021032403487	FWD	USDMXN	03/26/2021	18,700,000	20.91	(391,017,000)
2021032403488	FWD	USDMXN	03/29/2021	(18,700,000)	20.91698	391,147,433
2021032403029	FWD	USDMXN	09/27/2021	15,000,000	21.257	(318,855,000)
2021032403302	FWD	USDMXN	12/27/2021	(10,000,000)	21.491	214,910,000
2021032503014	FWD	USDMXN	03/26/2021	(10,087,528)	20.845	210,274,518
2021032503460	FWD	USDMXN	03/29/2021	(20,000,000)	20.705	414,100,000
2021032503015	FWD	USDMXN	03/29/2021	10,087,528	20.85215	(210,346,644)
2021032503044	FWD	USDMXN	03/29/2021	5,000,000	20.83907	(104,195,350)
2021032503045	FWD	USDMXN	12/29/2021	(5,000,000)	21.52107	107,605,350
2021032503461	FWD	USDMXN	03/29/2022	20,000,000	21.635	(432,700,000)
2021032603020	FWD	USDMXN	03/29/2021	(18,800,000)	20.563	386,584,400
2021032603004	FWD	USDMXN	03/29/2021	3,612,472	20.58766	(74,372,361)
2021032603026	FWD	USDMXN	03/29/2021	18,800,000	20.563	(386,584,400)
2021032603005	FWD	USDMXN	03/30/2021	(3,612,472)	20.59	74,380,801
2021032603027	FWD	USDMXN	03/30/2021	(18,800,000)	20.56535	386,628,580
2021032603021	FWD	USDMXN	03/30/2021	18,800,000	20.56535	(386,628,580)
2021032903025	FWD	USDMXN	03/30/2021	(18,800,000)	20.723	389,592,400

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021032903003	FWD	USDMXN	03/30/2021	3,612,472	20.75465	(74,975,584)
2021032903023	FWD	USDMXN	03/30/2021	18,800,000	20.723	(389,592,400)
2021032903004	FWD	USDMXN	03/31/2021	(3,612,472)	20.7569	74,983,723
2021032903024	FWD	USDMXN	03/31/2021	(18,800,000)	20.7253	389,635,640
2021032903011	FWD	USDMXN	03/31/2021	63,225,805	20.737	(1,311,113,525)
2021032903026	FWD	USDMXN	03/31/2021	18,800,000	20.7253	(389,635,640)
2021032903012	FWD	USDMXN	04/05/2021	(63,225,805)	20.74775	1,311,793,203
2021033003095	FWD	USDMXN	04/05/2021	(10,000,000)	20.553	205,530,000
2021033003464	FWD	USDMXN	04/05/2021	(70,000,000)	20.566	1,439,620,000
2021033003211	FWD	USDMXN	04/05/2021	6,000,000	20.62	(123,720,000)
2021033003292	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,000,000	20.582	(102,910,000)
2021033003096	FWD	USDMXN	10/05/2021	10,000,000	20.9905	(209,905,000)
2021033003212	FWD	USDMXN	01/05/2022	(6,000,000)	21.305	127,830,000
2021033003293	FWD	USDMXN	01/05/2022	(5,000,000)	21.264	106,320,000
2021033003465	FWD	USDMXN	04/05/2022	70,000,000	21.501	(1,505,070,000)
2021033103007	FWD	USDMXN	03/31/2021	19,000,000	20.44	(388,360,000)
2021033103008	FWD	USDMXN	04/05/2021	(19,000,000)	20.4512	388,572,800
2021033103005	FWD	USDMXN	04/05/2021	10,225,805	20.45888	(209,208,564)
2021033103006	FWD	USDMXN	04/06/2021	(10,225,805)	20.4612	209,232,248
2021033103110	FWD	USDMXN	04/06/2021	(139,159,908)	20.43	2,843,036,929
2021033103135	FWD	USDMXN	04/06/2021	50,000,000	20.4376	(1,021,880,000)
2021033103166	FWD	USDMXN	04/06/2021	50,000,000	20.445	(1,022,250,000)
2021033103136	FWD	USDMXN	04/13/2021	(50,000,000)	20.45317	1,022,658,460
2021033103167	FWD	USDMXN	04/13/2021	(50,000,000)	20.4608	1,023,040,000
2021033103111	FWD	USDMXN	04/13/2021	139,051,689	20.4459	(2,843,036,929)
2021010403001	FWD	USDMXN	01/05/2021	4,304,607	19.77551	(85,125,774)
2021010403002	FWD	USDMXN	01/06/2021	(4,304,607)	19.7776	85,134,790
2021010403307	FWD	USDMXN	01/06/2021	(30,000,000)	19.85	595,500,000
2021010403406	FWD	USDMXN	01/06/2021	(49,423,393)	19.94	985,502,458
2021010403294	FWD	USDMXN	01/06/2021	26,184,883	19.85	(519,769,920)
2021010403441	FWD	USDMXN	01/06/2021	54,570,000	19.85	(1,083,214,500)
2021010403308	FWD	USDMXN	01/13/2021	30,000,000	19.8659	(595,977,000)
2021010403295	FWD	USDMXN	01/15/2021	(26,158,000)	19.8704	519,769,920
2021010403407	FWD	USDMXN	01/20/2021	49,423,393	19.9718	(987,074,122)
2021010403442	FWD	USDMXN	01/22/2021	(54,570,000)	19.8861	1,085,184,477
2021010503009	FWD	USDMXN	01/06/2021	3,000,000	20.06136	(60,184,088)
2021010503010	FWD	USDMXN	01/07/2021	(3,000,000)	20.0634	60,190,200
2021010503078	FWD	USDMXN	01/07/2021	3,000,000	19.995	(59,985,000)
2021010503079	FWD	USDMXN	01/07/2022	(3,000,000)	20.83	62,490,000
2021010703008	FWD	USDMXN	01/08/2021	(386,667)	19.82629	7,666,168
2021010703009	FWD	USDMXN	01/11/2021	386,667	19.8322	(7,668,453)
2021010703418	FWD	USDMXN	03/11/2021	(25,000,000)	20.085	502,125,000
2021010703419	FWD	USDMXN	04/12/2021	25,000,000	20.156	(503,900,000)
2021010803002	FWD	USDMXN	01/11/2021	(11,386,667)	19.9943	227,668,390
2021010803003	FWD	USDMXN	01/12/2021	11,386,667	19.9962	(227,690,067)
2021011103000	FWD	USDMXN	01/12/2021	(386,667)	20.16887	7,798,631
2021011103001	FWD	USDMXN	01/13/2021	386,667	20.1708	(7,799,379)
2021011203025	FWD	USDMXN	01/12/2021	(27,200,000)	20	544,000,000
2021011203027	FWD	USDMXN	01/12/2021	27,200,000	20	(544,000,000)
2021011203028	FWD	USDMXN	01/13/2021	(27,200,000)	20.0023	544,062,560
2021011203008	FWD	USDMXN	01/13/2021	30,000,000	20.03	(600,900,000)
2021011203026	FWD	USDMXN	01/13/2021	27,200,000	20.0022	(544,059,840)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011203036	FWD	USDMXN	01/13/2021	14,613,333	19.957	(291,638,291)
2021011203009	FWD	USDMXN	01/14/2021	(30,000,000)	20.03205	600,961,500
2021011203037	FWD	USDMXN	01/14/2021	(14,613,333)	19.9589	291,666,056
2021011303209	FWD	USDMXN	01/15/2021	20,119,773	19.805	(398,472,097)
2021011303210	FWD	USDMXN	01/19/2021	(20,119,773)	19.8138	398,649,151
2021011403075	FWD	USDMXN	03/19/2021	(10,000,000)	19.975	199,750,000
2021011403076	FWD	USDMXN	04/19/2021	10,000,000	20.0455	(200,455,000)
2021011503029	FWD	USDMXN	01/19/2021	30,000,000	19.87	(596,100,000)
2021011503030	FWD	USDMXN	01/20/2021	(30,000,000)	19.87238	596,171,250
2021011503346	FWD	USDMXN	01/20/2021	(25,000,000)	19.765	494,125,000
2021011503349	FWD	USDMXN	01/20/2021	(22,338,780)	19.765	441,525,994
2021011503194	FWD	USDMXN	01/20/2021	20,000,000	19.825	(396,500,000)
2021011503190	FWD	USDMXN	01/21/2021	(20,000,000)	19.83	396,600,000
2021011503347	FWD	USDMXN	01/21/2021	25,000,000	19.76733	(494,183,125)
2021011503350	FWD	USDMXN	01/21/2021	22,338,780	19.76733	(441,577,932)
2021011503195	FWD	USDMXN	02/22/2021	(20,000,000)	19.8993	397,986,000
2021011503191	FWD	USDMXN	02/22/2021	20,000,000	19.902	(398,040,000)
2021011503166	FWD	USDMXN	03/19/2021	(10,000,000)	19.94	199,400,000
2021011503167	FWD	USDMXN	04/19/2021	10,000,000	20.0095	(200,095,000)
2021011903039	FWD	USDMXN	01/20/2021	(50,000,000)	19.68	984,000,000
2021011903036	FWD	USDMXN	01/20/2021	50,000,000	19.68	(984,000,000)
2021011903037	FWD	USDMXN	01/21/2021	(50,000,000)	19.6823	984,115,000
2021011903337	FWD	USDMXN	01/21/2021	(30,000,000)	19.64	589,200,000
2021011903040	FWD	USDMXN	01/21/2021	50,000,000	19.6823	(984,115,000)
2021011903199	FWD	USDMXN	01/21/2021	15,000,000	19.67	(295,050,000)
2021011903143	FWD	USDMXN	01/22/2021	(15,000,000)	19.68	295,200,000
2021011903338	FWD	USDMXN	01/22/2021	30,000,000	19.6423	(589,269,000)
2021011903200	FWD	USDMXN	03/22/2021	(15,000,000)	19.806	297,090,000
2021011903144	FWD	USDMXN	03/22/2021	15,000,000	19.812	(297,180,000)
2021011903322	FWD	USDMXN	06/28/2021	(10,150,000)	20.02	203,203,000
2021011903328	FWD	USDMXN	06/28/2021	(1,650,000)	20.024	33,039,600
2021011903329	FWD	USDMXN	06/28/2021	(400,000)	20.02	8,008,000
2021012003080	FWD	USDMXN	01/21/2021	(24,500,000)	19.58	479,710,000
2021012003082	FWD	USDMXN	01/21/2021	(38,780)	19.56105	758,585
2021012003081	FWD	USDMXN	01/22/2021	24,500,000	19.58238	(479,768,188)
2021012003083	FWD	USDMXN	01/22/2021	38,780	19.5634	(758,676)
2021012103236	FWD	USDMXN	01/22/2021	(15,000,000)	19.67	295,050,000
2021012103060	FWD	USDMXN	01/22/2021	19,859,366	19.61	(389,442,158)
2021012103262	FWD	USDMXN	01/22/2021	15,000,000	19.7	(295,500,000)
2021012103061	FWD	USDMXN	01/25/2021	(19,859,366)	19.61675	389,576,208
2021012103234	FWD	USDMXN	01/25/2021	(15,000,000)	19.675	295,125,000
2021012103263	FWD	USDMXN	01/25/2021	(15,000,000)	19.7067	295,600,500
2021012103129	FWD	USDMXN	01/25/2021	20,000,000	19.71	(394,200,000)
2021012103237	FWD	USDMXN	01/25/2021	15,000,000	19.6767	(295,150,500)
2021012103130	FWD	USDMXN	01/26/2021	(20,000,000)	19.71233	394,246,500
2021012103235	FWD	USDMXN	01/26/2021	15,000,000	19.6772	(295,158,000)
2021012203032	FWD	USDMXN	01/25/2021	(26,390,634)	19.965	526,889,018
2021012203162	FWD	USDMXN	01/25/2021	(83,970,000)	20	1,679,400,000
2021012203253	FWD	USDMXN	01/25/2021	83,970,000	19.96	(1,676,041,200)
2021012203254	FWD	USDMXN	01/26/2021	(83,970,000)	19.96233	1,676,236,430
2021012203302	FWD	USDMXN	01/26/2021	(15,000,000)	19.98	299,700,000
2021012203322	FWD	USDMXN	01/26/2021	(40,000,000)	19.98	799,200,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012203433	FWD	USDMXN	01/26/2021	(10,000,000)	19.92	199,200,000
2021012203033	FWD	USDMXN	01/26/2021	26,390,634	19.96728	(526,949,056)
2021012203157	FWD	USDMXN	01/26/2021	100,000,000	19.985	(1,998,500,000)
2021012203158	FWD	USDMXN	02/02/2021	(100,000,000)	20.00095	2,000,095,000
2021012203163	FWD	USDMXN	02/02/2021	83,970,000	20.01805	(1,680,915,659)
2021012203303	FWD	USDMXN	02/02/2021	15,000,000	19.99595	(299,939,250)
2021012203323	FWD	USDMXN	02/02/2021	40,000,000	19.996	(799,840,000)
2021012203434	FWD	USDMXN	06/28/2021	10,000,000	20.262	(202,620,000)
2021012503109	FWD	USDMXN	01/26/2021	579,366	20.17784	(11,690,346)
2021012503110	FWD	USDMXN	01/27/2021	(579,366)	20.1801	11,691,654
2021012603009	FWD	USDMXN	01/27/2021	27,500,000	20.01	(550,275,000)
2021012603012	FWD	USDMXN	01/27/2021	79,366	20.00301	(1,587,549)
2021012603010	FWD	USDMXN	01/28/2021	(27,500,000)	20.0124	550,341,000
2021012603013	FWD	USDMXN	01/28/2021	(79,366)	20.0053	1,587,731
2021012703080	FWD	USDMXN	01/28/2021	16,429,064	20.23	(332,359,969)
2021012703081	FWD	USDMXN	01/29/2021	(16,429,064)	20.23235	332,398,578
2021012703025	FWD	USDMXN	01/29/2021	26,000,000	20.22	(525,720,000)
2021012703086	FWD	USDMXN	01/29/2021	42,397	20.2509	(858,586)
2021012703026	FWD	USDMXN	02/02/2021	(26,000,000)	20.2295	525,967,000
2021012703087	FWD	USDMXN	02/02/2021	(42,397)	20.26025	858,983
2021012903006	FWD	USDMXN	02/02/2021	(3,427,603)	20.18199	69,175,848
2021012903007	FWD	USDMXN	02/03/2021	3,427,603	20.1842	(69,183,416)
2021020203004	FWD	USDMXN	02/03/2021	(6,855,205)	20.23748	138,732,067
2021020203002	FWD	USDMXN	02/03/2021	3,427,603	20.23427	(69,355,025)
2021020203003	FWD	USDMXN	02/04/2021	(3,427,603)	20.2364	69,362,337
2021020203005	FWD	USDMXN	02/04/2021	6,855,205	20.2397	(138,747,295)
2021020303000	FWD	USDMXN	02/04/2021	(3,427,603)	20.16337	69,112,012
2021020303050	FWD	USDMXN	02/05/2021	(123,712,384)	20.13	2,490,330,286
2021020303150	FWD	USDMXN	02/05/2021	(14,700,000)	20.2	296,940,000
2021020303001	FWD	USDMXN	02/05/2021	3,427,603	20.1657	(69,120,005)
2021020303090	FWD	USDMXN	02/05/2021	70,000,000	20.145	(1,410,150,000)
2021020303094	FWD	USDMXN	02/05/2021	50,000,000	20.145	(1,007,250,000)
2021020303091	FWD	USDMXN	02/12/2021	(70,000,000)	20.1609	1,411,263,000
2021020303095	FWD	USDMXN	02/12/2021	(50,000,000)	20.1609	1,008,045,000
2021020303051	FWD	USDMXN	02/12/2021	123,615,972	20.1457	(2,490,330,286)
2021020303151	FWD	USDMXN	02/12/2021	14,700,000	20.2159	(297,173,730)
2021020403020	FWD	USDMXN	02/05/2021	14,501,703	20.3	(294,384,562)
2021020403021	FWD	USDMXN	02/12/2021	(14,501,703)	20.316	294,616,589
2021020403385	FWD	USDMXN	10/29/2021	(45,030)	21.01517	946,317
2021020803075	FWD	USDMXN	02/09/2021	(10,000,000)	20.1	201,000,000
2021020803076	FWD	USDMXN	02/10/2021	10,000,000	20.10228	(201,022,750)
2021020903038	FWD	USDMXN	02/10/2021	(10,000,000)	20.1	201,000,000
2021020903039	FWD	USDMXN	02/11/2021	10,000,000	20.1022	(201,022,000)
2021021003005	FWD	USDMXN	02/11/2021	3,000,000	20.10751	(60,322,517)
2021021003006	FWD	USDMXN	02/12/2021	(3,000,000)	20.1096	60,328,800
2021021003090	FWD	USDMXN	02/12/2021	(124,155,043)	20.055	2,489,929,389
2021021003118	FWD	USDMXN	02/12/2021	20,000,000	20.06	(401,200,000)
2021021003163	FWD	USDMXN	02/12/2021	100,000,000	20.058	(2,005,800,000)
2021021003119	FWD	USDMXN	02/17/2021	(20,000,000)	20.07085	401,417,000
2021021003164	FWD	USDMXN	02/19/2021	(100,000,000)	20.0733	2,007,330,000
2021021003091	FWD	USDMXN	02/19/2021	124,060,397	20.0703	(2,489,929,389)
2021021103003	FWD	USDMXN	02/12/2021	2,859,461	19.90394	(56,914,545)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021021103004	FWD	USDMXN	02/16/2021	(2,859,461)	19.9122	56,938,159
2021021203526	FWD	USDMXN	02/17/2021	15,000,000	19.97	(299,550,000)
2021021203113	FWD	USDMXN	06/17/2021	(71,130,000)	20.2725	1,441,982,925
2021021203216	FWD	USDMXN	06/17/2021	50,000,000	20.218	(1,010,900,000)
2021021203212	FWD	USDMXN	07/28/2021	14,630,000	20.3085	(297,113,355)
2021021203217	FWD	USDMXN	08/17/2021	(50,000,000)	20.3525	1,017,625,000
2021021203527	FWD	USDMXN	08/17/2021	(15,000,000)	20.3605	305,407,500
2021021203114	FWD	USDMXN	08/17/2021	71,130,000	20.4085	(1,451,656,605)
2021021603037	FWD	USDMXN	02/17/2021	(14,800,000)	20.188	298,782,400
2021021603027	FWD	USDMXN	02/17/2021	40,000,000	20.188	(807,520,000)
2021021603039	FWD	USDMXN	02/17/2021	449,553	20.21293	(9,086,783)
2021021603028	FWD	USDMXN	02/18/2021	(40,000,000)	20.1902	807,608,000
2021021603040	FWD	USDMXN	02/18/2021	(449,553)	20.2151	9,087,758
2021021603038	FWD	USDMXN	02/18/2021	14,800,000	20.1902	(298,814,960)
2021021703032	FWD	USDMXN	02/18/2021	(50,447)	20.35093	1,026,644
2021021703110	FWD	USDMXN	02/18/2021	(14,900,000)	20.32	302,768,000
2021021703005	FWD	USDMXN	02/18/2021	30,000,000	20.32	(609,600,000)
2021021703115	FWD	USDMXN	02/18/2021	100,000	20.30282	(2,030,282)
2021021703006	FWD	USDMXN	02/19/2021	(30,000,000)	20.32223	609,666,750
2021021703116	FWD	USDMXN	02/19/2021	(100,000)	20.305	2,030,500
2021021703033	FWD	USDMXN	02/19/2021	50,447	20.3532	(1,026,758)
2021021703111	FWD	USDMXN	02/19/2021	14,900,000	20.3222	(302,800,780)
2021021803086	FWD	USDMXN	02/19/2021	(14,800,000)	20.36	301,328,000
2021021803004	FWD	USDMXN	02/19/2021	815,822	20.21097	(16,488,559)
2021021803005	FWD	USDMXN	02/22/2021	(815,822)	20.2174	16,493,804
2021021803378	FWD	USDMXN	02/22/2021	(34,000,000)	20.41	693,940,000
2021021803087	FWD	USDMXN	02/22/2021	14,800,000	20.3665	(301,424,200)
2021021803431	FWD	USDMXN	02/22/2021	20,000,000	20.38	(407,600,000)
2021021803432	FWD	USDMXN	03/01/2021	(20,000,000)	20.3952	407,904,000
2021021803379	FWD	USDMXN	03/01/2021	34,000,000	20.4252	(694,456,800)
2021021903017	FWD	USDMXN	02/22/2021	(184,178)	20.39098	3,755,565
2021021903018	FWD	USDMXN	02/23/2021	184,178	20.3932	(3,755,974)
2021022203040	FWD	USDMXN	02/23/2021	(184,178)	20.71054	3,814,421
2021022203041	FWD	USDMXN	02/24/2021	184,178	20.7128	(3,814,837)
2021022203140	FWD	USDMXN	02/24/2021	5,000,000	20.73	(103,650,000)
2021022203141	FWD	USDMXN	11/24/2021	(5,000,000)	21.346	106,730,000
2021022303008	FWD	USDMXN	02/23/2021	(2,055,867)	20.67748	42,510,140
2021022303045	FWD	USDMXN	02/24/2021	(184,178)	20.6968	3,811,890
2021022303009	FWD	USDMXN	02/24/2021	2,055,867	20.67982	(42,514,966)
2021022303046	FWD	USDMXN	02/25/2021	184,178	20.6991	(3,812,314)
2021022303110	FWD	USDMXN	06/25/2021	20,000,000	20.8075	(416,150,000)
2021022303111	FWD	USDMXN	08/25/2021	(20,000,000)	20.945	418,900,000
2021022403180	FWD	USDMXN	02/25/2021	10,815,822	20.46911	(221,390,303)
2021022403181	FWD	USDMXN	02/26/2021	(10,815,822)	20.4713	221,413,942
2021022503277	FWD	USDMXN	02/25/2021	(305,000)	20.88549	6,370,073
2021022503020	FWD	USDMXN	02/26/2021	(504,812)	20.6564	10,427,605
2021022503068	FWD	USDMXN	02/26/2021	1,009,624	20.75237	(20,952,099)
2021022503278	FWD	USDMXN	02/26/2021	305,000	20.88787	(6,370,800)
2021022503069	FWD	USDMXN	03/01/2021	(1,009,624)	20.7588	20,958,593
2021022503021	FWD	USDMXN	03/01/2021	504,812	20.6631	(10,430,986)
2021022603353	FWD	USDMXN	03/01/2021	(33,600,000)	20.94	703,584,000
2021022603006	FWD	USDMXN	03/01/2021	1,504,812	20.91529	(31,473,590)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021022603093	FWD	USDMXN	03/01/2021	33,600,000	20.926	(703,113,600)
2021022603007	FWD	USDMXN	03/02/2021	(1,504,812)	20.9175	31,476,910
2021022603094	FWD	USDMXN	03/02/2021	(33,600,000)	20.92838	703,193,400
2021022603335	FWD	USDMXN	03/02/2021	(50,000,000)	20.914	1,045,700,000
2021022603354	FWD	USDMXN	03/02/2021	33,600,000	20.94233	(703,662,120)
2021022603321	FWD	USDMXN	04/14/2021	57,680,000	21.0061	(1,211,631,848)
2021022603322	FWD	USDMXN	06/01/2021	(57,680,000)	21.1101	1,217,630,568
2021022603336	FWD	USDMXN	06/02/2021	50,000,000	21.1155	(1,055,775,000)
2021030103027	FWD	USDMXN	03/01/2021	(10,000,000)	20.66	206,600,000
2021030103002	FWD	USDMXN	03/02/2021	(33,000,000)	20.87	688,710,000
2021030103028	FWD	USDMXN	03/02/2021	10,000,000	20.6623	(206,623,000)
2021030103031	FWD	USDMXN	03/02/2021	30,504,812	20.67	(630,534,469)
2021030103032	FWD	USDMXN	03/03/2021	(30,504,812)	20.6723	630,604,630
2021030103187	FWD	USDMXN	03/03/2021	(70,000,000)	20.61	1,442,700,000
2021030103269	FWD	USDMXN	03/03/2021	70,000,000	20.625	(1,443,750,000)
2021030103306	FWD	USDMXN	03/03/2021	50,000,000	20.655	(1,032,750,000)
2021030103003	FWD	USDMXN	03/09/2021	33,000,000	20.8856	(689,224,800)
2021030103270	FWD	USDMXN	04/05/2021	(70,000,000)	20.6977	1,448,839,000
2021030103307	FWD	USDMXN	04/05/2021	(50,000,000)	20.7278	1,036,390,000
2021030103143	FWD	USDMXN	04/15/2021	62,430,000	20.6748	(1,290,727,764)
2021030103144	FWD	USDMXN	06/30/2021	(62,430,000)	20.8388	1,300,966,284
2021030103188	FWD	USDMXN	07/06/2021	70,000,000	20.8835	(1,461,845,000)
2021030203004	FWD	USDMXN	03/03/2021	(2,495,188)	20.66931	51,573,818
2021030203005	FWD	USDMXN	03/04/2021	2,495,188	20.6716	(51,579,523)
2021030303039	FWD	USDMXN	03/04/2021	12,932,180	20.78207	(268,757,450)
2021030303040	FWD	USDMXN	03/05/2021	(12,932,180)	20.7843	268,786,303
2021030403012	FWD	USDMXN	03/05/2021	12,545,513	20.88	(261,950,310)
2021030403013	FWD	USDMXN	03/08/2021	(12,545,513)	20.88675	262,034,992
2021030503005	FWD	USDMXN	03/05/2021	(294,000)	21.22559	6,240,325
2021030503003	FWD	USDMXN	03/08/2021	12,545,513	21.24823	(266,570,003)
2021030503006	FWD	USDMXN	03/08/2021	294,000	21.23256	(6,242,372)
2021030503004	FWD	USDMXN	03/09/2021	(12,545,513)	21.2505	266,598,422
2021030503048	FWD	USDMXN	03/09/2021	(32,000,000)	21.25	680,000,000
2021030503063	FWD	USDMXN	03/09/2021	10,000,000	21.185	(211,850,000)
2021030503049	FWD	USDMXN	03/11/2021	32,000,000	21.2545	(680,144,000)
2021030503602	FWD	USDMXN	03/17/2021	20,000,000	21.337	(426,740,000)
2021030503603	FWD	USDMXN	06/16/2021	(20,000,000)	21.5412	430,824,000
2021030503064	FWD	USDMXN	09/09/2021	(10,000,000)	21.607	216,070,000
2021030803003	FWD	USDMXN	03/09/2021	1,545,513	21.54284	(33,294,738)
2021030803004	FWD	USDMXN	03/10/2021	(1,545,513)	21.5451	33,298,230
2021030803355	FWD	USDMXN	03/10/2021	(15,000,000)	21.443	321,645,000
2021030803366	FWD	USDMXN	03/10/2021	(25,000,000)	21.45	536,250,000
2021030803363	FWD	USDMXN	03/10/2021	25,000,000	21.45	(536,250,000)
2021030803364	FWD	USDMXN	03/17/2021	(25,000,000)	21.4667	536,667,500
2021030803367	FWD	USDMXN	03/17/2021	25,000,000	21.4667	(536,667,500)
2021030803356	FWD	USDMXN	09/10/2021	15,000,000	21.8755	(328,132,500)
2021030803059	FWD	USDMXN	09/15/2021	(46,790,000)	21.9035	1,024,864,765
2021030803244	FWD	USDMXN	09/15/2021	45,000,000	21.846	(983,070,000)
2021030803245	FWD	USDMXN	12/10/2021	(45,000,000)	22.065	992,925,000
2021030803060	FWD	USDMXN	01/10/2022	46,790,000	22.2005	(1,038,761,395)
2021030803063	FWD	USDMXN	01/10/2022	46,410,000	22.2005	(1,030,325,205)
2021030803064	FWD	USDMXN	03/10/2022	(46,410,000)	22.3535	1,037,425,935

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021030903169	FWD	USDMXN	03/10/2021	(12,900,000)	21.28604	274,589,922
2021030903030	FWD	USDMXN	03/10/2021	45,513	21.26229	(967,709)
2021030903181	FWD	USDMXN	03/10/2021	11,900,000	21.28	(253,232,000)
2021030903031	FWD	USDMXN	03/11/2021	(45,513)	21.2646	967,814
2021030903182	FWD	USDMXN	03/11/2021	(11,900,000)	21.28236	253,260,084
2021030903200	FWD	USDMXN	03/11/2021	(19,800,000)	21.285	421,443,000
2021030903170	FWD	USDMXN	03/11/2021	12,900,000	21.2884	(274,620,360)
2021030903639	FWD	USDMXN	03/11/2021	44,000,000	21.22	(933,680,000)
2021030903640	FWD	USDMXN	03/12/2021	(44,000,000)	21.22233	933,782,300
2021030903201	FWD	USDMXN	03/12/2021	19,800,000	21.2873	(421,488,540)
2021031003017	FWD	USDMXN	03/11/2021	4,959,139	21.07431	(104,510,426)
2021031003018	FWD	USDMXN	03/12/2021	(4,959,139)	21.0766	104,521,796
2021031003154	FWD	USDMXN	12/13/2021	(45,000,000)	21.701	976,545,000
2021031003155	FWD	USDMXN	03/14/2022	45,000,000	21.93	(986,850,000)
2021031103004	FWD	USDMXN	03/11/2021	(1,999,999)	20.72248	41,444,933
2021031103212	FWD	USDMXN	03/12/2021	(13,800,000)	20.75	286,350,000
2021031103005	FWD	USDMXN	03/12/2021	1,999,999	20.72473	(41,449,428)
2021031103139	FWD	USDMXN	03/12/2021	13,800,000	20.72	(285,936,000)
2021031103260	FWD	USDMXN	03/12/2021	772,473	20.65394	(15,954,599)
2021031103140	FWD	USDMXN	03/16/2021	(13,800,000)	20.7288	286,057,440
2021031103261	FWD	USDMXN	03/16/2021	(772,473)	20.6625	15,961,214
2021031103145	FWD	USDMXN	03/16/2021	13,800,000	20.73	(286,074,000)
2021031103213	FWD	USDMXN	03/16/2021	13,800,000	20.75865	(286,469,370)
2021031103146	FWD	USDMXN	03/17/2021	(13,800,000)	20.73223	286,104,705
2021031203025	FWD	USDMXN	03/16/2021	(127,527)	20.74217	2,645,197
2021031203026	FWD	USDMXN	03/17/2021	127,527	20.7444	(2,645,481)
2021031603014	FWD	USDMXN	03/16/2021	(70,000,000)	20.637	1,444,590,000
2021031603016	FWD	USDMXN	03/16/2021	70,000,000	20.637	(1,444,590,000)
2021031603008	FWD	USDMXN	03/17/2021	(20,000,000)	20.6228	412,455,974
2021031603011	FWD	USDMXN	03/17/2021	(25,027,527)	20.62698	516,242,196
2021031603017	FWD	USDMXN	03/17/2021	(70,000,000)	20.63915	1,444,740,500
2021031603034	FWD	USDMXN	03/17/2021	(20,000,000)	20.63	412,600,000
2021031603015	FWD	USDMXN	03/17/2021	70,000,000	20.63915	(1,444,740,500)
2021031603018	FWD	USDMXN	03/17/2021	13,800,000	20.64	(284,832,000)
2021031603019	FWD	USDMXN	03/18/2021	(13,800,000)	20.64223	284,862,705
2021031603009	FWD	USDMXN	03/18/2021	20,000,000	20.625	(412,500,000)
2021031603012	FWD	USDMXN	03/18/2021	25,027,527	20.6292	(516,297,870)
2021031603035	FWD	USDMXN	03/18/2021	20,000,000	20.6322	(412,644,000)
2021031703008	FWD	USDMXN	03/18/2021	(10,000,000)	20.725	207,250,000
2021031703031	FWD	USDMXN	03/18/2021	(44,927,527)	20.697	929,865,036
2021031703014	FWD	USDMXN	03/18/2021	13,700,000	20.71	(283,727,000)
2021031703010	FWD	USDMXN	03/19/2021	(10,000,000)	20.73	207,300,000
2021031703015	FWD	USDMXN	03/19/2021	(13,700,000)	20.71225	283,757,825
2021031703009	FWD	USDMXN	03/19/2021	10,000,000	20.72728	(207,272,750)
2021031703032	FWD	USDMXN	03/19/2021	44,927,527	20.6993	(929,968,369)
2021031703011	FWD	USDMXN	03/22/2021	10,000,000	20.73675	(207,367,500)
2021031703140	FWD	USDMXN	06/21/2021	30,000,000	20.9045	(627,135,000)
2021031703141	FWD	USDMXN	07/19/2021	(30,000,000)	20.9695	629,085,000
2021031803052	FWD	USDMXN	03/19/2021	(45,300,861)	20.48	927,761,635
2021031803044	FWD	USDMXN	03/19/2021	33,300,000	20.48	(681,984,000)
2021031803045	FWD	USDMXN	03/22/2021	(33,300,000)	20.4867	682,207,110
2021031803439	FWD	USDMXN	03/22/2021	(25,000,000)	20.358	508,950,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031803053	FWD	USDMXN	03/22/2021	45,300,861	20.4867	(928,065,150)
2021031803298	FWD	USDMXN	04/05/2021	50,000,000	20.5	(1,025,000,000)
2021031803440	FWD	USDMXN	04/05/2021	25,000,000	20.3886	(509,715,000)
2021031803588	FWD	USDMXN	04/05/2021	19,000,000	20.465	(388,835,000)
2021031803589	FWD	USDMXN	04/14/2021	(19,000,000)	20.485	389,215,000
2021031803299	FWD	USDMXN	04/22/2021	(50,000,000)	20.5375	1,026,875,000
2021031903126	FWD	USDMXN	03/22/2021	(41,200,861)	20.45	842,557,609
2021031903033	FWD	USDMXN	03/22/2021	19,200,000	20.45	(392,640,000)
2021031903034	FWD	USDMXN	03/23/2021	(19,200,000)	20.45225	392,683,200
2021031903349	FWD	USDMXN	03/23/2021	(26,000,000)	20.5	533,000,000
2021031903127	FWD	USDMXN	03/23/2021	41,200,861	20.45225	(842,650,311)
2021031903350	FWD	USDMXN	12/23/2021	26,000,000	21.149	(549,874,000)
2021032203008	FWD	USDMXN	03/23/2021	(34,800,861)	20.71	720,725,833
2021032203010	FWD	USDMXN	03/23/2021	18,800,000	20.71	(389,348,000)
2021032203011	FWD	USDMXN	03/24/2021	(18,800,000)	20.71228	389,390,770
2021032203009	FWD	USDMXN	03/24/2021	34,800,861	20.71228	(720,805,005)
2021032303014	FWD	USDMXN	03/24/2021	(34,800,861)	20.675	719,507,803
2021032303012	FWD	USDMXN	03/24/2021	18,800,000	20.675	(388,690,000)
2021032303013	FWD	USDMXN	03/25/2021	(18,800,000)	20.67725	388,732,300
2021032303235	FWD	USDMXN	03/25/2021	(80,000,000)	20.68	1,654,400,000
2021032303015	FWD	USDMXN	03/25/2021	34,800,861	20.67725	(719,586,105)
2021032303240	FWD	USDMXN	03/25/2021	18,900,000	20.69	(391,041,000)
2021032303241	FWD	USDMXN	03/26/2021	(18,900,000)	20.69228	391,084,092
2021032303236	FWD	USDMXN	04/05/2021	80,000,000	20.7037	(1,656,296,000)
2021032403012	FWD	USDMXN	03/25/2021	(14,900,861)	20.8	309,937,910
2021032403028	FWD	USDMXN	03/26/2021	(15,000,000)	20.812	312,180,000
2021032403013	FWD	USDMXN	03/26/2021	14,900,861	20.80235	(309,972,927)
2021032403301	FWD	USDMXN	03/26/2021	10,000,000	20.805	(208,050,000)
2021032403487	FWD	USDMXN	03/26/2021	18,700,000	20.91	(391,017,000)
2021032403488	FWD	USDMXN	03/29/2021	(18,700,000)	20.91698	391,147,433
2021032403029	FWD	USDMXN	09/27/2021	15,000,000	21.257	(318,855,000)
2021032403302	FWD	USDMXN	12/27/2021	(10,000,000)	21.491	214,910,000
2021032503014	FWD	USDMXN	03/26/2021	(10,087,528)	20.845	210,274,518
2021032503460	FWD	USDMXN	03/29/2021	(20,000,000)	20.705	414,100,000
2021032503015	FWD	USDMXN	03/29/2021	10,087,528	20.85215	(210,346,644)
2021032503044	FWD	USDMXN	03/29/2021	5,000,000	20.83907	(104,195,350)
2021032503045	FWD	USDMXN	12/29/2021	(5,000,000)	21.52107	107,605,350
2021032503461	FWD	USDMXN	03/29/2022	20,000,000	21.635	(432,700,000)
2021032603020	FWD	USDMXN	03/29/2021	(18,800,000)	20.563	386,584,400
2021032603004	FWD	USDMXN	03/29/2021	3,612,472	20.58766	(74,372,361)
2021032603026	FWD	USDMXN	03/29/2021	18,800,000	20.563	(386,584,400)
2021032603005	FWD	USDMXN	03/30/2021	(3,612,472)	20.59	74,380,801
2021032603027	FWD	USDMXN	03/30/2021	(18,800,000)	20.56535	386,628,580
2021032603021	FWD	USDMXN	03/30/2021	18,800,000	20.56535	(386,628,580)
2021032903025	FWD	USDMXN	03/30/2021	(18,800,000)	20.723	389,592,400
2021032903003	FWD	USDMXN	03/30/2021	3,612,472	20.75465	(74,975,584)
2021032903023	FWD	USDMXN	03/30/2021	18,800,000	20.723	(389,592,400)
2021032903004	FWD	USDMXN	03/31/2021	(3,612,472)	20.7569	74,983,723
2021032903024	FWD	USDMXN	03/31/2021	(18,800,000)	20.7253	389,635,640
2021032903011	FWD	USDMXN	03/31/2021	63,225,805	20.737	(1,311,113,525)
2021032903026	FWD	USDMXN	03/31/2021	18,800,000	20.7253	(389,635,640)
2021032903012	FWD	USDMXN	04/05/2021	(63,225,805)	20.74775	1,311,793,203

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021033003095	FWD	USDMXN	04/05/2021	(10,000,000)	20.553	205,530,000
2021033003464	FWD	USDMXN	04/05/2021	(70,000,000)	20.566	1,439,620,000
2021033003211	FWD	USDMXN	04/05/2021	6,000,000	20.62	(123,720,000)
2021033003292	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,000,000	20.582	(102,910,000)
2021033003096	FWD	USDMXN	10/05/2021	10,000,000	20.9905	(209,905,000)
2021033003212	FWD	USDMXN	01/05/2022	(6,000,000)	21.305	127,830,000
2021033003293	FWD	USDMXN	01/05/2022	(5,000,000)	21.264	106,320,000
2021033003465	FWD	USDMXN	04/05/2022	70,000,000	21.501	(1,505,070,000)
2021033103007	FWD	USDMXN	03/31/2021	19,000,000	20.44	(388,360,000)
2021033103008	FWD	USDMXN	04/05/2021	(19,000,000)	20.4512	388,572,800
2021033103005	FWD	USDMXN	04/05/2021	10,225,805	20.45888	(209,208,564)
2021033103006	FWD	USDMXN	04/06/2021	(10,225,805)	20.4612	209,232,248
2021033103110	FWD	USDMXN	04/06/2021	(139,159,908)	20.43	2,843,036,929
2021033103135	FWD	USDMXN	04/06/2021	50,000,000	20.4376	(1,021,880,000)
2021033103166	FWD	USDMXN	04/06/2021	50,000,000	20.445	(1,022,250,000)
2021033103136	FWD	USDMXN	04/13/2021	(50,000,000)	20.45317	1,022,658,460
2021033103167	FWD	USDMXN	04/13/2021	(50,000,000)	20.4608	1,023,040,000
2021033103111	FWD	USDMXN	04/13/2021	139,051,689	20.4459	(2,843,036,929)
2021010403290	FWD	EURMXN	01/05/2021	330,000	24.375	(8,043,750)
2021010403110	FWD	EURMXN	01/05/2021	(300,000)	24.38301	7,314,902
2021010403302	FWD	EURMXN	01/05/2021	(30,000)	24.30724	729,217
2021010403111	FWD	EURMXN	03/02/2021	300,000	24.57107	(7,371,320)
2021010403303	FWD	EURMXN	03/02/2021	30,000	24.49502	(734,850)
2021010403291	FWD	EURMXN	03/02/2021	(330,000)	24.5675	8,107,275
2021012003533	FWD	EURMXN	02/02/2021	100,000	23.73469	(2,373,469)
2021012003179	FWD	EURMXN	02/02/2021	(100,000)	23.7408	2,374,080
2021012003534	FWD	EURMXN	03/02/2021	100,000	23.82595	(2,382,595)
2021012003180	FWD	EURMXN	03/02/2021	(100,000)	23.835	2,383,500
2021012103032	FWD	EURMXN	01/26/2021	(270,000)	23.93897	6,463,522
2021012703499	FWD	EURUSD	01/28/2021	75,000	1.21138	(90,853)
2021021203354	FWD	EURMXN	02/16/2021	(3,000,000)	24.17666	72,529,989
2021021203355	FWD	EURMXN	03/16/2021	3,000,000	24.26393	(72,791,796)
2021022403589	FWD	EURUSD	02/25/2021	1,900,000	1.21556	(2,309,556)
2021022403591	FWD	EURUSD	02/25/2021	1,200,000	1.21556	(1,458,667)
2021030103266	FWD	EURMXN	03/16/2021	(2,770,000)	24.88775	68,939,071
2021030203423	FWD	EURMXN	04/14/2021	145,000	25.02461	(3,628,569)
2021030203538	FWD	EURMXN	04/14/2021	(102)	25.02477	2,556
2021030503088	FWD	EURMXN	03/08/2021	1,475,000	25.32769	(37,358,349)
2021031203464	FWD	EURMXN	03/16/2021	(230,000)	24.77715	5,698,744
2021031203465	FWD	EURMXN	04/06/2021	230,000	24.84458	(5,714,254)
2021032403412	FWD	EURUSD	03/25/2021	1,200,000	1.18234	(1,418,807)
2021032503056	FWD	EURMXN	03/25/2021	50,000	24.60113	(1,230,057)
2021033003567	FWD	EURMXN	03/31/2021	400,000	24.12475	(9,649,901)
2021033003578	FWD	EURMXN	03/31/2021	800,000	24.12215	(19,297,722)
2021022403582	FWD	GBPUSD	02/25/2021	4,700,000	1.4126	(6,639,206)
2021010403026	FWD	USDMXN	01/04/2021	(100,000,000)	19.745	1,974,500,000
2021010403300	FWD	USDMXN	01/04/2021	100,000,000	19.95	(1,995,000,000)
2021010403120	FWD	USDMXN	01/05/2021	(3,600,000)	19.86943	71,529,941
2021010403301	FWD	USDMXN	01/05/2021	(100,000,000)	19.95235	1,995,235,000
2021010403027	FWD	USDMXN	01/05/2021	100,000,000	19.74725	(1,974,725,000)
2021010403103	FWD	USDMXN	01/05/2021	2,000,000	19.854	(39,708,000)
2021010403106	FWD	USDMXN	01/05/2021	1,000,000	19.854	(19,854,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021010403108	FWD	USDMXN	01/05/2021	600,000	19.854	(11,912,400)
2021010403122	FWD	USDMXN	01/06/2021	(100,000)	19.8615	1,986,150
2021010403124	FWD	USDMXN	01/06/2021	(100,000)	19.86185	1,986,185
2021010403412	FWD	USDMXN	01/06/2021	(416,250)	19.976	8,315,010
2021010403414	FWD	USDMXN	01/06/2021	(300,000)	19.974	5,992,199
2021010403417	FWD	USDMXN	01/06/2021	(500,000)	19.97775	9,988,875
2021010403419	FWD	USDMXN	01/06/2021	(300,000)	19.9785	5,993,550
2021010403029	FWD	USDMXN	01/11/2021	(300,000)	19.828	5,948,400
2021010403095	FWD	USDMXN	01/11/2021	300,000	19.77244	(5,931,734)
2021010403273	FWD	USDMXN	01/14/2021	(1,500,000)	19.85581	29,783,716
2021010403336	FWD	USDMXN	01/14/2021	2,810	19.90848	(55,951)
2021010403030	FWD	USDMXN	01/20/2021	(300,000)	19.8487	5,954,610
2021010403096	FWD	USDMXN	01/20/2021	300,000	19.79205	(5,937,616)
2021010403275	FWD	USDMXN	01/28/2021	476,000	19.89668	(9,470,819)
2021010403337	FWD	USDMXN	01/28/2021	78	19.9384	(1,560)
2021010403413	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,250	20.03762	(8,340,658)
2021010403104	FWD	USDMXN	02/09/2021	(2,000,000)	19.9378	39,875,600
2021010403107	FWD	USDMXN	02/09/2021	(1,000,000)	19.9378	19,937,800
2021010403109	FWD	USDMXN	02/09/2021	(600,000)	19.9378	11,962,680
2021010403121	FWD	USDMXN	02/09/2021	3,600,000	19.94929	(71,817,433)
2021010403372	FWD	USDMXN	02/23/2021	(25,000)	20.065	501,625
2021010403379	FWD	USDMXN	02/23/2021	25,000	20.03381	(500,845)
2021010403105	FWD	USDMXN	02/25/2021	(3,000,000)	20.0225	60,067,500
2021010403233	FWD	USDMXN	02/25/2021	3,000,000	20.01462	(60,043,872)
2021010403374	FWD	USDMXN	03/02/2021	(50,000)	20.0821	1,004,105
2021010403378	FWD	USDMXN	03/02/2021	50,000	20.04981	(1,002,491)
2021010403112	FWD	USDMXN	03/04/2021	(100,000)	19.9636	1,996,360
2021010403123	FWD	USDMXN	03/04/2021	100,000	19.99221	(1,999,221)
2021010403230	FWD	USDMXN	03/25/2021	(1,000,000)	19.9275	19,927,500
2021010403236	FWD	USDMXN	03/25/2021	1,000,000	19.90904	(19,909,041)
2021010403113	FWD	USDMXN	04/05/2021	(100,000)	19.9874	1,998,740
2021010403125	FWD	USDMXN	04/05/2021	100,000	20.06568	(2,006,568)
2021010403039	FWD	USDMXN	04/12/2021	(300,000)	19.953	5,985,900
2021010403415	FWD	USDMXN	04/12/2021	300,000	20.19519	(6,058,554)
2021010403044	FWD	USDMXN	05/12/2021	(500,000)	20.034	10,017,000
2021010403418	FWD	USDMXN	05/12/2021	500,000	20.26936	(10,134,678)
2021010403370	FWD	USDMXN	05/14/2021	(300,000)	20.265	6,079,500
2021010403367	FWD	USDMXN	05/14/2021	300,000	20.24131	(6,072,392)
2021010403371	FWD	USDMXN	06/15/2021	(300,000)	20.348	6,104,400
2021010403368	FWD	USDMXN	06/15/2021	300,000	20.31769	(6,095,308)
2021010403048	FWD	USDMXN	08/09/2021	(300,000)	20.258	6,077,400
2021010403420	FWD	USDMXN	08/09/2021	300,000	20.47551	(6,142,654)
2021010403053	FWD	USDMXN	09/13/2021	(300,000)	20.339	6,101,700
2021010403050	FWD	USDMXN	09/13/2021	300,000	20.33692	(6,101,076)
2021010503020	FWD	USDMXN	01/05/2021	(50,000,000)	20.05	1,002,500,000
2021010503022	FWD	USDMXN	01/05/2021	(50,000,000)	20.06	1,003,000,000
2021010503033	FWD	USDMXN	01/05/2021	(1,500,000)	20.04	30,060,000
2021010503310	FWD	USDMXN	01/05/2021	100,000,000	20.1	(2,010,000,000)
2021010503025	FWD	USDMXN	01/06/2021	(46,000,000)	20.04	921,840,000
2021010503094	FWD	USDMXN	01/06/2021	(54,000,000)	20	1,080,000,000
2021010503021	FWD	USDMXN	01/06/2021	50,000,000	20.0521	(1,002,605,000)
2021010503023	FWD	USDMXN	01/06/2021	50,000,000	20.0621	(1,003,105,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021010503311	FWD	USDMXN	01/07/2021	(100,000,000)	20.1046	2,010,460,000
2021010503026	FWD	USDMXN	01/07/2021	46,000,000	20.0421	(921,936,600)
2021010503095	FWD	USDMXN	01/07/2021	54,000,000	20.00215	(1,080,116,100)
2021010503303	FWD	USDMXN	01/07/2021	500,000	19.87633	(9,938,165)
2021010503034	FWD	USDMXN	01/08/2021	1,500,000	20.046	(30,069,000)
2021010503294	FWD	USDMXN	01/15/2021	10,820,132	19.94014	(215,754,936)
2021010503230	FWD	USDMXN	01/20/2021	(500,000)	19.967	9,983,500
2021010503304	FWD	USDMXN	01/20/2021	(500,000)	19.9042	9,952,098
2021010503223	FWD	USDMXN	01/20/2021	500,000	19.967	(9,983,500)
2021010503096	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,250	20.02785	(8,336,594)
2021010503173	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,000	19.98715	(8,314,653)
2021010503175	FWD	USDMXN	02/02/2021	250	19.98948	(4,997)
2021010503493	FWD	USDMXN	02/09/2021	(20,200)	20.036	404,727
2021010503489	FWD	USDMXN	02/09/2021	20,200	19.98228	(403,642)
2021010503299	FWD	USDMXN	04/14/2021	2,500,000	20.11282	(50,282,050)
2021010503301	FWD	USDMXN	04/14/2021	32,742	20.10236	(658,199)
2021010503177	FWD	USDMXN	01/07/2022	(500,000)	20.8029	10,401,450
2021010503178	FWD	USDMXN	01/07/2022	500,000	20.7739	(10,386,948)
2021010603009	FWD	USDMXN	01/06/2021	(100,000,000)	19.715	1,971,500,000
2021010603011	FWD	USDMXN	01/06/2021	100,000,000	19.715	(1,971,500,000)
2021010603466	FWD	USDMXN	01/06/2021	1,025,000	19.64	(20,131,000)
2021010603012	FWD	USDMXN	01/07/2021	(100,000,000)	19.71705	1,971,705,000
2021010603044	FWD	USDMXN	01/07/2021	(47,000,000)	19.79	930,130,000
2021010603048	FWD	USDMXN	01/07/2021	(53,000,000)	19.795	1,049,135,000
2021010603010	FWD	USDMXN	01/07/2021	100,000,000	19.71705	(1,971,705,000)
2021010603434	FWD	USDMXN	01/07/2021	100,000,000	19.85	(1,985,000,000)
2021010603435	FWD	USDMXN	01/08/2021	(100,000,000)	19.8523	1,985,230,000
2021010603045	FWD	USDMXN	01/08/2021	47,000,000	19.79203	(930,225,175)
2021010603049	FWD	USDMXN	01/08/2021	53,000,000	19.79705	(1,049,243,650)
2021010603180	FWD	USDMXN	01/08/2021	1,000,000	19.76148	(19,761,480)
2021010603202	FWD	USDMXN	01/14/2021	(250,000)	19.861	4,965,250
2021010603208	FWD	USDMXN	01/14/2021	250,000	19.84606	(4,961,516)
2021010603419	FWD	USDMXN	01/19/2021	(61,000)	19.7969	1,207,611
2021010603431	FWD	USDMXN	01/19/2021	61,000	19.64897	(1,198,588)
2021010603204	FWD	USDMXN	01/21/2021	(250,000)	19.8761	4,969,025
2021010603322	FWD	USDMXN	01/21/2021	(250,000)	19.7621	4,940,525
2021010603209	FWD	USDMXN	01/21/2021	250,000	19.8613	(4,965,324)
2021010603335	FWD	USDMXN	01/21/2021	250,000	19.74631	(4,936,578)
2021010603205	FWD	USDMXN	01/28/2021	(250,000)	19.8929	4,973,225
2021010603323	FWD	USDMXN	01/28/2021	(250,000)	19.7779	4,944,475
2021010603210	FWD	USDMXN	01/28/2021	250,000	19.87712	(4,969,280)
2021010603336	FWD	USDMXN	01/28/2021	250,000	19.76215	(4,940,537)
2021010603275	FWD	USDMXN	02/08/2021	(500,000)	19.79	9,895,000
2021010603298	FWD	USDMXN	02/08/2021	500,000	19.78018	(9,890,088)
2021010603535	FWD	USDMXN	02/09/2021	(21,700)	19.832	430,354
2021010603532	FWD	USDMXN	02/09/2021	21,700	19.74286	(428,420)
2021010603123	FWD	USDMXN	02/10/2021	(150,000)	19.827	2,974,050
2021010603223	FWD	USDMXN	02/10/2021	150,000	19.83233	(2,974,849)
2021010603350	FWD	USDMXN	02/16/2021	(19,856)	19.7889	392,934
2021010603388	FWD	USDMXN	02/16/2021	19,856	19.71374	(391,436)
2021010603181	FWD	USDMXN	02/23/2021	(1,000,000)	19.86292	19,862,924
2021010603042	FWD	USDMXN	02/23/2021	1,000,000	20.9663	(20,966,300)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021010603034	FWD	USDMXN	03/04/2021	(100,000)	19.9161	1,991,610
2021010603059	FWD	USDMXN	03/04/2021	100,000	19.86196	(1,986,197)
2021010603186	FWD	USDMXN	03/05/2021	(100,000)	19.9311	1,993,110
2021010603217	FWD	USDMXN	03/05/2021	100,000	19.88993	(1,988,993)
2021010603126	FWD	USDMXN	03/08/2021	(150,000)	19.905	2,985,750
2021010603224	FWD	USDMXN	03/08/2021	150,000	19.89177	(2,983,766)
2021010603351	FWD	USDMXN	03/09/2021	(19,226)	19.8367	381,379
2021010603387	FWD	USDMXN	03/09/2021	19,226	19.76106	(379,927)
2021010603036	FWD	USDMXN	03/11/2021	(100,000)	19.932	1,993,200
2021010603060	FWD	USDMXN	03/11/2021	100,000	19.87791	(1,987,791)
2021010603188	FWD	USDMXN	03/12/2021	(100,000)	19.9471	1,994,710
2021010603218	FWD	USDMXN	03/12/2021	100,000	19.90575	(1,990,575)
2021010603352	FWD	USDMXN	03/16/2021	(42,011)	19.8525	834,027
2021010603386	FWD	USDMXN	03/16/2021	42,011	19.77651	(830,831)
2021010603047	FWD	USDMXN	03/18/2021	(100,000)	19.9515	1,995,150
2021010603061	FWD	USDMXN	03/18/2021	100,000	19.89377	(1,989,377)
2021010603189	FWD	USDMXN	03/19/2021	(100,000)	19.9632	1,996,320
2021010603219	FWD	USDMXN	03/19/2021	100,000	19.92152	(1,992,152)
2021010603039	FWD	USDMXN	03/25/2021	(100,000)	19.964	1,996,400
2021010603062	FWD	USDMXN	03/25/2021	100,000	19.90963	(1,990,963)
2021010603040	FWD	USDMXN	03/31/2021	(100,000)	19.981	1,998,100
2021010603246	FWD	USDMXN	03/31/2021	(713,000)	19.952	14,225,776
2021010603063	FWD	USDMXN	03/31/2021	100,000	19.92323	(1,992,323)
2021010603252	FWD	USDMXN	03/31/2021	713,000	19.94372	(14,219,873)
2021010603200	FWD	USDMXN	04/06/2021	(100,000)	20.0041	2,000,410
2021010603220	FWD	USDMXN	04/06/2021	100,000	19.96205	(1,996,205)
2021010603128	FWD	USDMXN	04/12/2021	(200,000)	19.9865	3,997,300
2021010603225	FWD	USDMXN	04/12/2021	200,000	19.97079	(3,994,158)
2021010603201	FWD	USDMXN	04/13/2021	(100,000)	20.02	2,002,000
2021010603221	FWD	USDMXN	04/13/2021	100,000	19.97808	(1,997,808)
2021010603346	FWD	USDMXN	05/11/2021	(1,400,000)	19.9215	27,890,100
2021010603381	FWD	USDMXN	05/11/2021	1,400,000	19.89831	(27,857,633)
2021010603347	FWD	USDMXN	05/18/2021	(1,400,000)	19.9361	27,910,540
2021010603382	FWD	USDMXN	05/18/2021	1,400,000	19.91378	(27,879,291)
2021010603527	FWD	USDMXN	06/09/2021	(50,000)	20.01125	1,000,563
2021010603408	FWD	USDMXN	06/09/2021	50,000	19.95838	(997,919)
2021010603106	FWD	USDMXN	06/10/2021	11,084	20.083	(222,603)
2021010603107	FWD	USDMXN	06/24/2021	11,064	20.12	(222,603)
2021010603391	FWD	USDMXN	07/02/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021010603404	FWD	USDMXN	07/02/2021	50,000	20.01036	(1,000,519)
2021010603393	FWD	USDMXN	07/09/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021010603528	FWD	USDMXN	07/09/2021	50,000	20.08149	(1,004,075)
2021010603398	FWD	USDMXN	07/16/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021010603405	FWD	USDMXN	07/16/2021	50,000	20.04164	(1,002,082)
2021010603399	FWD	USDMXN	07/23/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021010603406	FWD	USDMXN	07/23/2021	50,000	20.05713	(1,002,857)
2021010603400	FWD	USDMXN	07/30/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021010603407	FWD	USDMXN	07/30/2021	50,000	20.07263	(1,003,632)
2021010603132	FWD	USDMXN	08/12/2021	59,877	20.243	(1,212,089)
2021010603413	FWD	USDMXN	08/16/2021	(300,000)	20.128	6,038,400
2021010603410	FWD	USDMXN	08/16/2021	300,000	20.10243	(6,030,730)
2021010603568	FWD	USDMXN	08/26/2021	59,791	20.272	(1,212,089)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021010603140	FWD	USDMXN	09/09/2021	54,751	20.31	(1,111,991)
2021010603136	FWD	USDMXN	09/13/2021	(300,000)	20.311	6,093,300
2021010603222	FWD	USDMXN	09/13/2021	300,000	20.30935	(6,092,807)
2021010603148	FWD	USDMXN	09/23/2021	54,616	20.36	(1,111,991)
2021010603166	FWD	USDMXN	10/07/2021	91,162	20.377	(1,857,609)
2021010603175	FWD	USDMXN	10/21/2021	91,073	20.397	(1,857,609)
2021010603183	FWD	USDMXN	11/10/2021	92,986	20.444	(1,901,007)
2021010603187	FWD	USDMXN	11/24/2021	92,868	20.47	(1,901,007)
2021010603152	FWD	USDMXN	12/01/2021	(150,000)	20.525	3,078,750
2021010603144	FWD	USDMXN	12/01/2021	150,000	20.52081	(3,078,121)
2021010603191	FWD	USDMXN	12/09/2021	82,209	20.503	(1,685,539)
2021010603198	FWD	USDMXN	12/23/2021	82,153	20.517	(1,685,539)
2021010703034	FWD	USDMXN	01/08/2021	(47,300,000)	19.83	937,959,000
2021010703383	FWD	USDMXN	01/08/2021	(30,045,068)	19.97	600,000,000
2021010703107	FWD	USDMXN	01/08/2021	47,000,000	19.9	(935,300,000)
2021010703108	FWD	USDMXN	01/11/2021	(47,000,000)	19.90575	935,570,250
2021010703330	FWD	USDMXN	01/11/2021	(59,877)	19.9558	1,194,893
2021010703332	FWD	USDMXN	01/11/2021	(59,791)	19.9558	1,193,183
2021010703334	FWD	USDMXN	01/11/2021	(54,751)	19.9559	1,092,604
2021010703337	FWD	USDMXN	01/11/2021	(54,616)	19.9513	1,089,669
2021010703474	FWD	USDMXN	01/11/2021	(100,000,000)	20.04	2,004,000,000
2021010703536	FWD	USDMXN	01/11/2021	(16,250)	20.01125	325,183
2021010703539	FWD	USDMXN	01/11/2021	(16,250)	20.01415	325,230
2021010703541	FWD	USDMXN	01/11/2021	(16,250)	20.01175	325,191
2021010703543	FWD	USDMXN	01/11/2021	(16,250)	20.01024	325,166
2021010703545	FWD	USDMXN	01/11/2021	(16,250)	20.01075	325,175
2021010703547	FWD	USDMXN	01/11/2021	(16,250)	20.01449	325,235
2021010703549	FWD	USDMXN	01/11/2021	(16,250)	20.0135	325,219
2021010703035	FWD	USDMXN	01/11/2021	47,300,000	19.83565	(938,226,245)
2021010703253	FWD	USDMXN	01/11/2021	47,268	19.9543	(943,192)
2021010703257	FWD	USDMXN	01/11/2021	43,567	19.9617	(869,662)
2021010703260	FWD	USDMXN	01/11/2021	58,056	19.9664	(1,159,175)
2021010703262	FWD	USDMXN	01/11/2021	46,609	19.9724	(930,887)
2021010703264	FWD	USDMXN	01/11/2021	59,877	19.9722	(1,195,875)
2021010703266	FWD	USDMXN	01/11/2021	46,512	19.9726	(928,958)
2021010703271	FWD	USDMXN	01/11/2021	59,791	19.9716	(1,194,128)
2021010703273	FWD	USDMXN	01/11/2021	54,751	19.9661	(1,093,162)
2021010703277	FWD	USDMXN	01/11/2021	54,616	19.968	(1,090,581)
2021010703287	FWD	USDMXN	01/11/2021	59,877	19.9829	(1,196,516)
2021010703290	FWD	USDMXN	01/11/2021	59,791	19.9649	(1,193,727)
2021010703294	FWD	USDMXN	01/11/2021	54,751	19.9637	(1,093,031)
2021010703296	FWD	USDMXN	01/11/2021	54,616	19.9597	(1,090,128)
2021010703301	FWD	USDMXN	01/11/2021	78,818	19.9723	(1,574,168)
2021010703303	FWD	USDMXN	01/11/2021	91,162	19.9641	(1,819,968)
2021010703305	FWD	USDMXN	01/11/2021	70,181	19.9638	(1,401,087)
2021010703308	FWD	USDMXN	01/11/2021	91,073	19.9656	(1,818,320)
2021010703310	FWD	USDMXN	01/11/2021	70,175	19.9602	(1,400,698)
2021010703312	FWD	USDMXN	01/11/2021	149,295	19.9596	(2,979,870)
2021010703315	FWD	USDMXN	01/11/2021	149,095	19.9589	(2,975,772)
2021010703318	FWD	USDMXN	01/11/2021	61,387	19.9568	(1,225,094)
2021010703321	FWD	USDMXN	01/11/2021	82,209	19.9546	(1,640,455)
2021010703325	FWD	USDMXN	01/11/2021	82,153	19.9549	(1,639,361)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021010703384	FWD	USDMXN	01/11/2021	30,036,344	19.9758	(600,000,000)
2021010703477	FWD	USDMXN	01/11/2021	100,000,000	20.04	(2,004,000,000)
2021010703509	FWD	USDMXN	01/11/2021	179,000	20.05625	(3,590,069)
2021010703511	FWD	USDMXN	01/11/2021	380,000	20.0545	(7,620,710)
2021010703514	FWD	USDMXN	01/11/2021	376,000	20.05475	(7,540,586)
2021010703516	FWD	USDMXN	01/11/2021	247,000	20.0585	(4,954,450)
2021010703518	FWD	USDMXN	01/11/2021	53,000	20.0605	(1,063,207)
2021010703478	FWD	USDMXN	01/12/2021	(100,000,000)	20.042	2,004,200,000
2021010703475	FWD	USDMXN	01/12/2021	100,000,000	20.042	(2,004,200,000)
2021010703421	FWD	USDMXN	01/14/2021	(16,250)	19.9632	324,402
2021010703537	FWD	USDMXN	01/14/2021	16,250	20.0186	(325,302)
2021010703453	FWD	USDMXN	01/15/2021	(100,000)	20.01387	2,001,387
2021010703510	FWD	USDMXN	01/15/2021	(179,000)	20.06226	3,591,144
2021010703451	FWD	USDMXN	01/15/2021	119,000	19.8855	(2,366,375)
2021010703506	FWD	USDMXN	01/15/2021	60,000	19.8855	(1,193,130)
2021010703508	FWD	USDMXN	01/15/2021	100,000	19.972	(1,997,200)
2021010703512	FWD	USDMXN	01/19/2021	(380,000)	20.06655	7,625,289
2021010703459	FWD	USDMXN	01/19/2021	31,000	19.892	(616,652)
2021010703462	FWD	USDMXN	01/19/2021	111,000	19.892	(2,208,012)
2021010703463	FWD	USDMXN	01/19/2021	119,000	19.892	(2,367,148)
2021010703470	FWD	USDMXN	01/19/2021	119,000	19.892	(2,367,148)
2021010703422	FWD	USDMXN	01/21/2021	(16,250)	19.9788	324,656
2021010703515	FWD	USDMXN	01/21/2021	(376,000)	20.07174	7,546,975
2021010703476	FWD	USDMXN	01/21/2021	121,000	19.896	(2,407,416)
2021010703479	FWD	USDMXN	01/21/2021	80,000	19.896	(1,591,680)
2021010703480	FWD	USDMXN	01/21/2021	122,000	19.896	(2,427,312)
2021010703482	FWD	USDMXN	01/21/2021	53,000	19.896	(1,054,488)
2021010703540	FWD	USDMXN	01/21/2021	16,250	20.03739	(325,608)
2021010703517	FWD	USDMXN	01/22/2021	(247,000)	20.07796	4,959,256
2021010703502	FWD	USDMXN	01/22/2021	134,000	19.8983	(2,666,372)
2021010703504	FWD	USDMXN	01/22/2021	113,000	19.8983	(2,248,508)
2021010703519	FWD	USDMXN	01/25/2021	(53,000)	20.08737	1,064,631
2021010703505	FWD	USDMXN	01/25/2021	53,000	19.905	(1,054,965)
2021010703226	FWD	USDMXN	01/26/2021	(100,000)	19.99877	1,999,878
2021010703225	FWD	USDMXN	01/26/2021	100,000	19.9348	(1,993,480)
2021010703424	FWD	USDMXN	01/28/2021	(16,250)	19.9936	324,896
2021010703468	FWD	USDMXN	01/28/2021	600,000	20.08958	(12,053,746)
2021010703496	FWD	USDMXN	01/28/2021	7,939	20.09524	(159,536)
2021010703542	FWD	USDMXN	01/28/2021	16,250	20.04899	(325,796)
2021010703360	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,000	20.00763	(8,323,175)
2021010703361	FWD	USDMXN	02/02/2021	250	20.00953	(5,002)
2021010703425	FWD	USDMXN	02/04/2021	(16,250)	20.0088	325,143
2021010703544	FWD	USDMXN	02/04/2021	16,250	20.06275	(326,020)
2021010703426	FWD	USDMXN	02/11/2021	(16,250)	20.0247	325,401
2021010703546	FWD	USDMXN	02/11/2021	16,250	20.07813	(326,270)
2021010703427	FWD	USDMXN	02/18/2021	(16,250)	20.0409	325,665
2021010703548	FWD	USDMXN	02/18/2021	16,250	20.09824	(326,596)
2021010703429	FWD	USDMXN	02/25/2021	(16,250)	20.0571	325,928
2021010703550	FWD	USDMXN	02/25/2021	16,250	20.11336	(326,842)
2021010703254	FWD	USDMXN	04/28/2021	(47,268)	20.1896	954,314
2021010703045	FWD	USDMXN	04/28/2021	47,268	20.123	(951,166)
2021010703258	FWD	USDMXN	05/26/2021	(43,567)	20.25918	882,622

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021010703048	FWD	USDMXN	05/26/2021	43,567	20.199	(880,000)
2021010703261	FWD	USDMXN	06/09/2021	(58,056)	20.29494	1,178,248
2021010703051	FWD	USDMXN	06/09/2021	58,056	20.239	(1,175,000)
2021010703010	FWD	USDMXN	06/10/2021	(11,084)	20.09921	222,783
2021010703011	FWD	USDMXN	06/24/2021	(11,064)	20.1303	222,717
2021010703263	FWD	USDMXN	08/04/2021	(46,609)	20.4249	951,978
2021010703053	FWD	USDMXN	08/04/2021	46,609	20.3825	(950,000)
2021010703265	FWD	USDMXN	08/12/2021	(59,877)	20.44235	1,224,026
2021010703288	FWD	USDMXN	08/12/2021	(59,877)	20.4493	1,224,443
2021010703331	FWD	USDMXN	08/12/2021	59,877	20.42793	(1,223,163)
2021010703267	FWD	USDMXN	08/18/2021	(46,512)	20.45608	951,446
2021010703104	FWD	USDMXN	08/18/2021	46,512	20.425	(950,000)
2021010703272	FWD	USDMXN	08/26/2021	(59,791)	20.47276	1,224,093
2021010703291	FWD	USDMXN	08/26/2021	(59,791)	20.46149	1,223,419
2021010703333	FWD	USDMXN	08/26/2021	59,791	20.45888	(1,223,263)
2021010703274	FWD	USDMXN	09/09/2021	(54,751)	20.49798	1,122,283
2021010703295	FWD	USDMXN	09/09/2021	(54,751)	20.49062	1,121,880
2021010703335	FWD	USDMXN	09/09/2021	54,751	20.48993	(1,121,842)
2021010703278	FWD	USDMXN	09/23/2021	(54,616)	20.53088	1,121,324
2021010703297	FWD	USDMXN	09/23/2021	(54,616)	20.51772	1,120,605
2021010703338	FWD	USDMXN	09/23/2021	54,616	20.51629	(1,120,527)
2021010703302	FWD	USDMXN	09/29/2021	(78,818)	20.54682	1,619,450
2021010703058	FWD	USDMXN	09/29/2021	78,818	20.5115	(1,616,666)
2021010703304	FWD	USDMXN	10/07/2021	(91,162)	20.55632	1,873,956
2021010703306	FWD	USDMXN	10/13/2021	(70,181)	20.569	1,443,560
2021010703089	FWD	USDMXN	10/13/2021	70,181	20.542	(1,441,666)
2021010703309	FWD	USDMXN	10/21/2021	(91,073)	20.58944	1,875,136
2021010703311	FWD	USDMXN	10/27/2021	(70,175)	20.59715	1,445,396
2021010703065	FWD	USDMXN	10/27/2021	70,175	20.544	(1,441,666)
2021010703313	FWD	USDMXN	11/10/2021	(149,295)	20.62761	3,079,601
2021010703069	FWD	USDMXN	11/10/2021	56,309	20.571	(1,158,333)
2021010703316	FWD	USDMXN	11/24/2021	(149,095)	20.65803	3,080,009
2021010703079	FWD	USDMXN	11/24/2021	56,227	20.601	(1,158,333)
2021010703319	FWD	USDMXN	12/08/2021	(61,387)	20.68708	1,269,924
2021010703076	FWD	USDMXN	12/08/2021	61,387	20.634	(1,266,666)
2021010703322	FWD	USDMXN	12/09/2021	(82,209)	20.687	1,700,666
2021010703326	FWD	USDMXN	12/23/2021	(82,153)	20.7186	1,702,101
2021010803097	FWD	USDMXN	01/08/2021	1,500,000	20.02	(30,030,000)
2021010803095	FWD	USDMXN	01/11/2021	(47,000,000)	20.02	940,940,000
2021010803098	FWD	USDMXN	01/11/2021	(1,500,000)	20.026	30,039,000
2021010803124	FWD	USDMXN	01/11/2021	40,000,000	19.942	(797,680,000)
2021010803125	FWD	USDMXN	01/12/2021	(40,000,000)	19.9439	797,756,000
2021010803096	FWD	USDMXN	01/12/2021	47,000,000	20.0218	(941,024,600)
2021010803329	FWD	USDMXN	01/21/2021	(2,459,114)	20.1292	49,500,000
2021010803431	FWD	USDMXN	01/21/2021	2,459,000	20.12552	(49,488,649)
2021010803493	FWD	USDMXN	01/21/2021	114	20.02278	(2,284)
2021010803223	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,000	19.98128	(8,312,214)
2021010803520	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,500	20.01769	(8,337,369)
2021011103008	FWD	USDMXN	01/11/2021	(2,000,000)	20.25	40,500,000
2021011103006	FWD	USDMXN	01/12/2021	(46,300,000)	20.25	937,575,000
2021011103160	FWD	USDMXN	01/12/2021	(11,000,000)	20.10211	221,123,243
2021011103052	FWD	USDMXN	01/12/2021	45,000,000	20.185	(908,325,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011103139	FWD	USDMXN	01/12/2021	6,000,000	20.13	(120,780,000)
2021011103141	FWD	USDMXN	01/12/2021	3,000,000	20.13	(60,390,000)
2021011103143	FWD	USDMXN	01/12/2021	2,000,000	20.13	(40,260,000)
2021011103053	FWD	USDMXN	01/13/2021	(45,000,000)	20.1869	908,410,500
2021011103147	FWD	USDMXN	01/13/2021	(11,000,000)	20.10517	221,156,870
2021011103007	FWD	USDMXN	01/13/2021	46,300,000	20.2518	(937,658,340)
2021011103107	FWD	USDMXN	01/13/2021	530,352	20.12218	(10,671,839)
2021011103161	FWD	USDMXN	01/13/2021	11,000,000	20.1042	(221,146,200)
2021011103009	FWD	USDMXN	01/14/2021	2,000,000	20.2554	(40,510,800)
2021011103108	FWD	USDMXN	01/15/2021	(530,352)	20.12562	10,673,665
2021011103105	FWD	USDMXN	01/19/2021	(300,000)	20.24407	6,073,222
2021011103260	FWD	USDMXN	01/19/2021	(400,000)	20.074	8,029,600
2021011103082	FWD	USDMXN	01/19/2021	300,000	20.21	(6,063,000)
2021011103241	FWD	USDMXN	01/19/2021	400,000	20.05296	(8,021,184)
2021011103317	FWD	USDMXN	01/25/2021	(211,000)	20.05102	4,230,766
2021011103292	FWD	USDMXN	01/25/2021	109,000	19.9665	(2,176,349)
2021011103293	FWD	USDMXN	01/25/2021	102,000	19.9665	(2,036,583)
2021011103318	FWD	USDMXN	01/26/2021	(178,000)	20.05313	3,569,457
2021011103294	FWD	USDMXN	01/26/2021	125,000	19.9683	(2,496,038)
2021011103295	FWD	USDMXN	01/26/2021	53,000	19.9683	(1,058,320)
2021011103163	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,000	20.18326	(8,396,236)
2021011103164	FWD	USDMXN	02/02/2021	250	20.13819	(5,034)
2021011103140	FWD	USDMXN	02/09/2021	(6,000,000)	20.197	121,182,000
2021011103142	FWD	USDMXN	02/09/2021	(3,000,000)	20.197	60,591,000
2021011103144	FWD	USDMXN	02/09/2021	(2,000,000)	20.197	40,394,000
2021011103148	FWD	USDMXN	02/09/2021	11,000,000	20.16376	(221,801,382)
2021011203038	FWD	USDMXN	01/13/2021	(46,500,000)	20.03	931,395,000
2021011203083	FWD	USDMXN	01/13/2021	1,500,000	20.01	(30,015,000)
2021011203218	FWD	USDMXN	01/13/2021	15,000,000	19.93	(298,950,000)
2021011203084	FWD	USDMXN	01/14/2021	(1,500,000)	20.012	30,018,000
2021011203219	FWD	USDMXN	01/14/2021	(15,000,000)	19.932	298,980,000
2021011203471	FWD	USDMXN	01/14/2021	0	19.9373	13,723
2021011203039	FWD	USDMXN	01/14/2021	46,500,000	20.0319	(931,483,350)
2021011203470	FWD	USDMXN	01/14/2021	67,702	20.14	(1,363,523)
2021011203214	FWD	USDMXN	01/21/2021	(1,000,000)	19.9864	19,986,400
2021011203216	FWD	USDMXN	01/21/2021	1,000,000	19.96747	(19,967,469)
2021011203338	FWD	USDMXN	01/29/2021	9,862,871	19.91982	(196,466,649)
2021011203215	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,000	19.99347	(8,317,286)
2021011203217	FWD	USDMXN	02/02/2021	250	19.97678	(4,994)
2021011203503	FWD	USDMXN	02/10/2021	(250,000)	19.887	4,971,750
2021011203496	FWD	USDMXN	02/10/2021	250,000	19.881	(4,970,249)
2021011203506	FWD	USDMXN	03/08/2021	(250,000)	19.944	4,986,000
2021011203498	FWD	USDMXN	03/08/2021	250,000	19.93988	(4,984,969)
2021011203268	FWD	USDMXN	03/30/2021	132,000	20.05457	(2,647,204)
2021011203538	FWD	USDMXN	03/30/2021	152	19.9872	(3,044)
2021011203397	FWD	USDMXN	07/02/2021	(25,000)	20.273	506,825
2021011203439	FWD	USDMXN	07/02/2021	25,000	20.21064	(505,266)
2021011203398	FWD	USDMXN	07/09/2021	(25,000)	20.273	506,825
2021011203440	FWD	USDMXN	07/09/2021	25,000	20.22633	(505,658)
2021011203520	FWD	USDMXN	07/14/2021	(250,000)	20.228	5,057,000
2021011203512	FWD	USDMXN	07/14/2021	250,000	20.22635	(5,056,588)
2021011203399	FWD	USDMXN	07/16/2021	(25,000)	20.273	506,825

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011203442	FWD	USDMXN	07/16/2021	25,000	20.24206	(506,051)
2021011203400	FWD	USDMXN	07/23/2021	(25,000)	20.273	506,825
2021011203441	FWD	USDMXN	07/23/2021	25,000	20.25788	(506,447)
2021011203402	FWD	USDMXN	07/30/2021	(25,000)	20.273	506,825
2021011203443	FWD	USDMXN	07/30/2021	25,000	20.2737	(506,842)
2021011203522	FWD	USDMXN	10/04/2021	(250,000)	20.403	5,100,750
2021011203518	FWD	USDMXN	10/04/2021	250,000	20.39667	(5,099,167)
2021011303058	FWD	USDMXN	01/13/2021	15,000,000	19.82	(297,300,000)
2021011303010	FWD	USDMXN	01/14/2021	(47,300,000)	19.75	934,175,000
2021011303059	FWD	USDMXN	01/14/2021	(15,000,000)	19.8223	297,334,500
2021011303011	FWD	USDMXN	01/15/2021	47,300,000	19.752	(934,269,600)
2021011303219	FWD	USDMXN	01/21/2021	(21,400)	19.8697	425,212
2021011303202	FWD	USDMXN	01/21/2021	21,400	19.80839	(423,900)
2021011303241	FWD	USDMXN	01/22/2021	(25,634)	19.7921	507,350
2021011303285	FWD	USDMXN	01/22/2021	25,634	19.78905	(507,273)
2021011303243	FWD	USDMXN	01/29/2021	(244,773)	19.8079	4,848,440
2021011303286	FWD	USDMXN	01/29/2021	244,773	19.80496	(4,847,720)
2021011303293	FWD	USDMXN	02/02/2021	250,000	19.8249	(4,956,224)
2021011303322	FWD	USDMXN	02/02/2021	166,250	19.83897	(3,298,228)
2021011303401	FWD	USDMXN	02/02/2021	160,000	19.83815	(3,174,104)
2021011303403	FWD	USDMXN	02/02/2021	247,398	19.83878	(4,908,067)
2021011303417	FWD	USDMXN	02/02/2021	8,852	19.82186	(175,471)
2021011303079	FWD	USDMXN	02/04/2021	(500,000)	19.8088	9,904,400
2021011303262	FWD	USDMXN	02/04/2021	(300,000)	19.8578	5,957,340
2021011303106	FWD	USDMXN	02/04/2021	500,000	19.79177	(9,895,887)
2021011303274	FWD	USDMXN	02/04/2021	300,000	19.84134	(5,952,403)
2021011303245	FWD	USDMXN	02/05/2021	(169,046)	19.8234	3,351,073
2021011303287	FWD	USDMXN	02/05/2021	169,046	19.82037	(3,350,554)
2021011303027	FWD	USDMXN	02/10/2021	(250,000)	19.846	4,961,500
2021011303110	FWD	USDMXN	02/10/2021	250,000	19.86826	(4,967,064)
2021011303080	FWD	USDMXN	02/11/2021	(500,000)	19.8247	9,912,350
2021011303266	FWD	USDMXN	02/11/2021	(300,000)	19.8737	5,962,110
2021011303281	FWD	USDMXN	02/11/2021	(460,000)	19.8504	9,131,186
2021011303105	FWD	USDMXN	02/11/2021	500,000	19.80726	(9,903,628)
2021011303273	FWD	USDMXN	02/11/2021	300,000	19.85681	(5,957,043)
2021011303246	FWD	USDMXN	02/12/2021	(69,046)	19.8389	1,369,803
2021011303288	FWD	USDMXN	02/12/2021	69,046	19.83582	(1,369,584)
2021011303445	FWD	USDMXN	02/16/2021	(20,300)	19.936	404,701
2021011303408	FWD	USDMXN	02/16/2021	20,300	19.86893	(403,339)
2021011303081	FWD	USDMXN	02/25/2021	(500,000)	19.8559	9,927,950
2021011303267	FWD	USDMXN	02/25/2021	(300,000)	19.9049	5,971,470
2021011303282	FWD	USDMXN	02/25/2021	(459,000)	19.87424	9,122,277
2021011303315	FWD	USDMXN	02/25/2021	(153)	19.88438	3,047
2021011303104	FWD	USDMXN	02/25/2021	500,000	19.83846	(9,919,229)
2021011303275	FWD	USDMXN	02/25/2021	300,000	19.88823	(5,966,470)
2021011303391	FWD	USDMXN	03/04/2021	(300,000)	19.902	5,970,600
2021011303406	FWD	USDMXN	03/04/2021	300,000	19.87843	(5,963,530)
2021011303030	FWD	USDMXN	03/08/2021	(250,000)	19.903	4,975,750
2021011303111	FWD	USDMXN	03/08/2021	250,000	19.92624	(4,981,560)
2021011303291	FWD	USDMXN	03/11/2021	(237,000)	19.9102	4,718,719
2021011303392	FWD	USDMXN	03/11/2021	(300,000)	19.9177	5,975,310
2021011303325	FWD	USDMXN	03/11/2021	23	19.92171	(468)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011303405	FWD	USDMXN	03/11/2021	300,000	19.89425	(5,968,274)
2021011303247	FWD	USDMXN	03/12/2021	(248,218)	19.9011	4,939,807
2021011303290	FWD	USDMXN	03/12/2021	248,218	19.89856	(4,939,180)
2021011303394	FWD	USDMXN	03/25/2021	(300,000)	19.9493	5,984,790
2021011303407	FWD	USDMXN	03/25/2021	300,000	19.92602	(5,977,806)
2021011303249	FWD	USDMXN	03/26/2021	(45,612)	19.9322	909,148
2021011303289	FWD	USDMXN	03/26/2021	43,283	19.93004	(862,632)
2021011303323	FWD	USDMXN	03/26/2021	2,329	19.95551	(46,476)
2021011303312	FWD	USDMXN	04/08/2021	(62,786)	19.97846	1,254,373
2021011303299	FWD	USDMXN	04/22/2021	(125,500)	20.01526	2,511,916
2021011303313	FWD	USDMXN	04/22/2021	(29,986)	20.00936	599,996
2021011303139	FWD	USDMXN	04/22/2021	62,686	19.992	(1,253,214)
2021011303415	FWD	USDMXN	04/22/2021	92,800	19.99916	(1,855,922)
2021011303037	FWD	USDMXN	08/09/2021	(250,000)	20.277	5,069,250
2021011303114	FWD	USDMXN	08/09/2021	250,000	20.26354	(5,065,885)
2021011303041	FWD	USDMXN	10/04/2021	(250,000)	20.396	5,099,000
2021011303122	FWD	USDMXN	10/04/2021	250,000	20.37006	(5,092,516)
2021011303416	FWD	USDMXN	11/24/2021	(92,800)	20.47139	1,899,745
2021011303367	FWD	USDMXN	11/24/2021	92,800	20.485	(1,901,008)
2021011303314	FWD	USDMXN	12/23/2021	(82,025)	20.54609	1,685,300
2021011303214	FWD	USDMXN	12/23/2021	82,025	20.549	(1,685,539)
2021011403017	FWD	USDMXN	01/14/2021	(1,500,000)	19.86	29,790,000
2021011403011	FWD	USDMXN	01/15/2021	(47,000,000)	19.87	933,890,000
2021011403135	FWD	USDMXN	01/15/2021	50,000,000	19.78	(989,000,000)
2021011403136	FWD	USDMXN	01/19/2021	(50,000,000)	19.78895	989,447,500
2021011403012	FWD	USDMXN	01/19/2021	47,000,000	19.8788	(934,303,600)
2021011403018	FWD	USDMXN	01/20/2021	1,500,000	19.8729	(29,809,350)
2021011403265	FWD	USDMXN	01/28/2021	(85,000)	19.793	1,682,405
2021011403741	FWD	USDMXN	01/28/2021	(16,250)	19.681	319,816
2021011403441	FWD	USDMXN	01/28/2021	85,000	19.78506	(1,681,731)
2021011403746	FWD	USDMXN	01/28/2021	16,250	19.66998	(319,638)
2021011403144	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,000	19.88171	(8,270,790)
2021011403235	FWD	USDMXN	02/02/2021	250	19.77054	(4,943)
2021011403337	FWD	USDMXN	02/04/2021	(85,000)	19.8087	1,683,740
2021011403742	FWD	USDMXN	02/04/2021	(16,250)	19.6969	320,075
2021011403440	FWD	USDMXN	02/04/2021	85,000	19.80095	(1,683,081)
2021011403747	FWD	USDMXN	02/04/2021	16,250	19.6858	(319,894)
2021011403344	FWD	USDMXN	02/11/2021	(85,000)	19.8248	1,685,108
2021011403743	FWD	USDMXN	02/11/2021	(16,250)	19.7126	320,330
2021011403442	FWD	USDMXN	02/11/2021	85,000	19.81673	(1,684,422)
2021011403748	FWD	USDMXN	02/11/2021	16,250	19.70152	(320,150)
2021011403668	FWD	USDMXN	02/16/2021	(23,300)	19.865	462,855
2021011403631	FWD	USDMXN	02/16/2021	23,300	19.78394	(460,966)
2021011403391	FWD	USDMXN	02/18/2021	(85,000)	19.841	1,686,485
2021011403744	FWD	USDMXN	02/18/2021	(16,250)	19.7284	320,587
2021011403443	FWD	USDMXN	02/18/2021	85,000	19.83252	(1,685,764)
2021011403749	FWD	USDMXN	02/18/2021	16,250	19.71725	(320,405)
2021011403383	FWD	USDMXN	02/25/2021	(85,000)	19.857	1,687,845
2021011403745	FWD	USDMXN	02/25/2021	(16,250)	19.7448	320,853
2021011403444	FWD	USDMXN	02/25/2021	85,000	19.84872	(1,687,141)
2021011403750	FWD	USDMXN	02/25/2021	16,250	19.7336	(320,671)
2021011403573	FWD	USDMXN	02/26/2021	(531,300)	19.859	10,551,087

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011403651	FWD	USDMXN	02/26/2021	531,000	19.80217	(10,514,953)
2021011403665	FWD	USDMXN	02/26/2021	300	19.8057	(5,941)
2021011403157	FWD	USDMXN	03/04/2021	(300,000)	19.8845	5,965,350
2021011403220	FWD	USDMXN	03/04/2021	300,000	19.87752	(5,963,257)
2021011403361	FWD	USDMXN	03/10/2021	(250,000)	19.816	4,954,000
2021011403517	FWD	USDMXN	03/10/2021	250,000	19.81479	(4,953,698)
2021011403142	FWD	USDMXN	03/11/2021	(300,000)	19.9005	5,970,150
2021011403221	FWD	USDMXN	03/11/2021	300,000	19.89358	(5,968,073)
2021011403632	FWD	USDMXN	03/17/2021	(50,000)	19.8802	994,010
2021011403652	FWD	USDMXN	03/17/2021	50,000	19.85462	(992,732)
2021011403633	FWD	USDMXN	03/19/2021	(50,000)	19.8848	994,240
2021011403656	FWD	USDMXN	03/19/2021	50,000	19.85927	(992,964)
2021011403645	FWD	USDMXN	03/22/2021	(50,000)	19.8916	994,580
2021011403657	FWD	USDMXN	03/22/2021	50,000	19.86603	(993,302)
2021011403647	FWD	USDMXN	03/24/2021	(50,000)	19.8972	994,860
2021011403653	FWD	USDMXN	03/24/2021	50,000	19.87054	(993,527)
2021011403143	FWD	USDMXN	03/25/2021	(300,000)	19.9328	5,979,840
2021011403222	FWD	USDMXN	03/25/2021	300,000	19.92564	(5,977,693)
2021011403642	FWD	USDMXN	03/26/2021	(50,000)	19.9008	995,040
2021011403654	FWD	USDMXN	03/26/2021	50,000	19.87505	(993,753)
2021011403643	FWD	USDMXN	03/30/2021	(50,000)	19.9109	995,545
2021011403655	FWD	USDMXN	03/30/2021	50,000	19.88407	(994,204)
2021011403549	FWD	USDMXN	03/31/2021	(33,033)	19.86312	656,145
2021011403369	FWD	USDMXN	04/14/2021	(250,000)	19.896	4,974,000
2021011403564	FWD	USDMXN	04/14/2021	120,000	19.9026	(2,388,312)
2021011403658	FWD	USDMXN	04/14/2021	73,682	19.91954	(1,467,714)
2021011403667	FWD	USDMXN	04/14/2021	8,383	19.91328	(166,932)
2021011403372	FWD	USDMXN	05/17/2021	(250,000)	19.972	4,993,000
2021011403353	FWD	USDMXN	05/17/2021	250,000	19.96869	(4,992,172)
2021011403550	FWD	USDMXN	05/26/2021	(44,046)	19.98625	880,319
2021011403510	FWD	USDMXN	05/26/2021	44,046	19.979	(880,000)
2021011403551	FWD	USDMXN	06/09/2021	(24,920)	20.01629	498,814
2021011403554	FWD	USDMXN	06/09/2021	(33,777)	20.03369	676,673
2021011403514	FWD	USDMXN	06/09/2021	58,697	20.018	(1,175,000)
2021011403375	FWD	USDMXN	06/14/2021	(250,000)	20.0415	5,010,375
2021011403357	FWD	USDMXN	06/14/2021	250,000	20.03872	(5,009,680)
2021011403555	FWD	USDMXN	07/07/2021	(94,956)	20.09456	1,908,101
2021011403808	FWD	USDMXN	07/07/2021	94,956	20.097	(1,908,333)
2021011403365	FWD	USDMXN	07/14/2021	(250,000)	20.10319	5,025,797
2021011403366	FWD	USDMXN	07/14/2021	(250,000)	20.11	5,027,500
2021011403539	FWD	USDMXN	07/14/2021	(250,000)	20.12266	5,030,665
2021011403364	FWD	USDMXN	07/14/2021	250,000	20.10817	(5,027,042)
2021011403367	FWD	USDMXN	07/14/2021	250,000	20.10408	(5,026,021)
2021011403556	FWD	USDMXN	08/04/2021	(47,130)	20.15612	949,958
2021011403521	FWD	USDMXN	08/04/2021	47,130	20.157	(950,000)
2021011403435	FWD	USDMXN	08/09/2021	(250,000)	20.166	5,041,500
2021011403540	FWD	USDMXN	08/09/2021	250,000	20.1872	(5,046,801)
2021011403557	FWD	USDMXN	08/18/2021	(47,048)	20.18696	949,763
2021011403523	FWD	USDMXN	08/18/2021	47,048	20.192	(950,000)
2021011403558	FWD	USDMXN	09/01/2021	(32,089)	20.21857	648,789
2021011403596	FWD	USDMXN	09/01/2021	(14,884)	20.21611	300,896
2021011403524	FWD	USDMXN	09/01/2021	46,973	20.2245	(950,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011403437	FWD	USDMXN	09/13/2021	(250,000)	20.241	5,060,250
2021011403518	FWD	USDMXN	09/13/2021	250,000	20.23615	(5,059,038)
2021011403806	FWD	USDMXN	09/15/2021	79,816	20.255	(1,616,666)
2021011403597	FWD	USDMXN	09/29/2021	(5,976)	20.27903	121,192
2021011403659	FWD	USDMXN	09/29/2021	(73,682)	20.28676	1,494,771
2021011403544	FWD	USDMXN	09/29/2021	79,658	20.295	(1,616,666)
2021011403439	FWD	USDMXN	10/04/2021	(250,000)	20.3	5,075,000
2021011403381	FWD	USDMXN	10/04/2021	250,000	20.29754	(5,074,385)
2021011403595	FWD	USDMXN	10/13/2021	(70,934)	20.31028	1,440,693
2021011403810	FWD	USDMXN	10/13/2021	70,934	20.324	(1,441,666)
2021011403594	FWD	USDMXN	10/27/2021	(70,854)	20.34126	1,441,259
2021011403561	FWD	USDMXN	10/27/2021	70,854	20.347	(1,441,666)
2021011403446	FWD	USDMXN	11/01/2021	(250,000)	20.374	5,093,500
2021011403384	FWD	USDMXN	11/01/2021	250,000	20.36994	(5,092,484)
2021011403592	FWD	USDMXN	11/10/2021	(56,834)	20.37203	1,157,823
2021011403568	FWD	USDMXN	11/10/2021	56,834	20.381	(1,158,333)
2021011403593	FWD	USDMXN	11/24/2021	(56,753)	20.40295	1,157,933
2021011403570	FWD	USDMXN	11/24/2021	56,753	20.41	(1,158,333)
2021011403448	FWD	USDMXN	12/01/2021	(250,000)	20.443	5,110,750
2021011403545	FWD	USDMXN	12/01/2021	250,000	20.42237	(5,105,592)
2021011403591	FWD	USDMXN	12/08/2021	(61,958)	20.43413	1,266,054
2021011403578	FWD	USDMXN	12/08/2021	61,958	20.444	(1,266,666)
2021011403590	FWD	USDMXN	12/22/2021	(61,807)	20.46513	1,264,882
2021011403579	FWD	USDMXN	12/22/2021	61,807	20.494	(1,266,666)
2021011503305	FWD	USDMXN	01/15/2021	(15,000,000)	19.72	295,800,000
2021011503447	FWD	USDMXN	01/15/2021	1,163,261	19.772	(23,000,000)
2021011503013	FWD	USDMXN	01/19/2021	(50,000,000)	19.82	991,000,000
2021011503448	FWD	USDMXN	01/19/2021	(1,162,697)	19.7816	23,000,000
2021011503049	FWD	USDMXN	01/19/2021	40,000,000	19.84	(793,600,000)
2021011503306	FWD	USDMXN	01/19/2021	15,000,000	19.72955	(295,943,250)
2021011503050	FWD	USDMXN	01/20/2021	(40,000,000)	19.84225	793,690,000
2021011503101	FWD	USDMXN	01/20/2021	(416,250)	19.802	8,242,583
2021011503247	FWD	USDMXN	01/20/2021	(416,250)	19.757	8,223,851
2021011503382	FWD	USDMXN	01/20/2021	(238,000)	19.772	4,705,736
2021011503534	FWD	USDMXN	01/20/2021	(2,500,000)	19.77152	49,428,800
2021011503561	FWD	USDMXN	01/20/2021	(500,000)	19.772	9,886,000
2021011503562	FWD	USDMXN	01/20/2021	(500,000)	19.772	9,886,000
2021011503014	FWD	USDMXN	01/20/2021	50,000,000	19.8222	(991,110,000)
2021011503068	FWD	USDMXN	01/27/2021	(1,146,346)	20.251	23,214,653
2021011503206	FWD	USDMXN	01/27/2021	1,146,346	19.88688	(22,797,242)
2021011503628	FWD	USDMXN	01/28/2021	(85,000)	19.813	1,684,105
2021011503594	FWD	USDMXN	01/28/2021	85,000	19.80265	(1,683,225)
2021011503120	FWD	USDMXN	02/02/2021	(100,000)	19.81863	1,981,863
2021011503122	FWD	USDMXN	02/02/2021	100,000	19.803	(1,980,300)
2021011503220	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,000	19.82811	(8,248,493)
2021011503225	FWD	USDMXN	02/02/2021	250	19.77721	(4,944)
2021011503363	FWD	USDMXN	02/02/2021	416,000	19.78305	(8,229,749)
2021011503495	FWD	USDMXN	02/02/2021	250	19.80891	(4,952)
2021011503629	FWD	USDMXN	02/04/2021	(85,000)	19.829	1,685,465
2021011503596	FWD	USDMXN	02/04/2021	85,000	19.82212	(1,684,881)
2021011503633	FWD	USDMXN	02/11/2021	(85,000)	19.842	1,686,570
2021011503597	FWD	USDMXN	02/11/2021	85,000	19.8322	(1,685,737)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011503575	FWD	USDMXN	02/16/2021	(50,000)	19.8808	994,040
2021011503583	FWD	USDMXN	02/16/2021	50,000	19.851	(992,550)
2021011503069	FWD	USDMXN	02/17/2021	(1,160,092)	20.251	23,493,023
2021011503634	FWD	USDMXN	02/18/2021	(85,000)	19.864	1,688,440
2021011503600	FWD	USDMXN	02/18/2021	85,000	19.8529	(1,687,496)
2021011503679	FWD	USDMXN	02/25/2021	(85,000)	19.888	1,690,480
2021011503601	FWD	USDMXN	02/25/2021	85,000	19.88043	(1,689,836)
2021011503637	FWD	USDMXN	03/04/2021	(202,500)	19.8995	4,029,649
2021011503602	FWD	USDMXN	03/04/2021	202,500	19.89628	(4,028,997)
2021011503577	FWD	USDMXN	03/09/2021	(50,000)	19.9289	996,445
2021011503584	FWD	USDMXN	03/09/2021	50,000	19.89911	(994,956)
2021011503639	FWD	USDMXN	03/11/2021	(202,500)	19.919	4,033,598
2021011503603	FWD	USDMXN	03/11/2021	202,500	19.91224	(4,032,229)
2021011503071	FWD	USDMXN	03/17/2021	(1,187,975)	20.251	24,057,682
2021011503207	FWD	USDMXN	03/17/2021	1,187,975	19.9998	(23,759,260)
2021011503640	FWD	USDMXN	03/18/2021	(202,500)	19.939	4,037,648
2021011503604	FWD	USDMXN	03/18/2021	202,500	19.933	(4,036,433)
2021011503642	FWD	USDMXN	03/25/2021	(202,500)	19.959	4,041,698
2021011503605	FWD	USDMXN	03/25/2021	202,500	19.94948	(4,039,769)
2021011503450	FWD	USDMXN	03/31/2021	(119,000)	19.9379	2,372,610
2021011503650	FWD	USDMXN	03/31/2021	(202,500)	19.966	4,043,115
2021011503492	FWD	USDMXN	03/31/2021	119,000	19.92893	(2,371,542)
2021011503607	FWD	USDMXN	03/31/2021	202,500	19.96028	(4,041,958)
2021011503654	FWD	USDMXN	04/08/2021	(300,000)	19.987	5,996,100
2021011503610	FWD	USDMXN	04/08/2021	300,000	19.98126	(5,994,378)
2021011503656	FWD	USDMXN	04/15/2021	(300,000)	20.01	6,003,000
2021011503611	FWD	USDMXN	04/15/2021	300,000	19.99825	(5,999,476)
2021011503097	FWD	USDMXN	04/21/2021	(1,193,289)	20.251	24,165,296
2021011503208	FWD	USDMXN	04/21/2021	1,193,289	20.08001	(23,961,255)
2021011503657	FWD	USDMXN	04/22/2021	(300,000)	20.029	6,008,700
2021011503614	FWD	USDMXN	04/22/2021	300,000	20.01457	(6,004,370)
2021011503658	FWD	USDMXN	04/29/2021	(300,000)	20.034	6,010,200
2021011503617	FWD	USDMXN	04/29/2021	300,000	20.02394	(6,007,183)
2021011503675	FWD	USDMXN	05/06/2021	(300,000)	20.057	6,017,100
2021011503619	FWD	USDMXN	05/06/2021	300,000	20.04392	(6,013,175)
2021011503667	FWD	USDMXN	05/13/2021	(300,000)	20.068	6,020,400
2021011503620	FWD	USDMXN	05/13/2021	300,000	20.05479	(6,016,437)
2021011503098	FWD	USDMXN	05/19/2021	(1,208,142)	20.251	24,466,084
2021011503209	FWD	USDMXN	05/19/2021	1,208,142	20.14492	(24,337,925)
2021011503668	FWD	USDMXN	05/20/2021	(300,000)	20.079	6,023,700
2021011503621	FWD	USDMXN	05/20/2021	300,000	20.07336	(6,022,009)
2021011503672	FWD	USDMXN	05/27/2021	(300,000)	20.1	6,030,000
2021011503622	FWD	USDMXN	05/27/2021	300,000	20.08945	(6,026,834)
2021011503099	FWD	USDMXN	06/16/2021	(1,212,908)	20.251	24,562,600
2021011503210	FWD	USDMXN	06/16/2021	1,212,908	20.20718	(24,509,451)
2021011503100	FWD	USDMXN	07/14/2021	(1,227,749)	20.251	24,863,145
2021011503211	FWD	USDMXN	07/14/2021	1,227,749	20.2704	(24,886,957)
2021011503467	FWD	USDMXN	07/30/2021	(119,000)	20.2108	2,405,085
2021011503493	FWD	USDMXN	07/30/2021	119,000	20.20197	(2,404,034)
2021011503102	FWD	USDMXN	08/18/2021	(1,230,274)	20.251	24,914,279
2021011503212	FWD	USDMXN	08/18/2021	1,230,274	20.35008	(25,036,169)
2021011503001	FWD	USDMXN	09/15/2021	(79,816)	20.35146	1,624,365

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011503103	FWD	USDMXN	09/15/2021	(944,414)	20.251	19,125,328
2021011503215	FWD	USDMXN	09/15/2021	944,414	20.41344	(19,278,738)
2021011503357	FWD	USDMXN	10/04/2021	(250,000)	20.341	5,085,250
2021011503393	FWD	USDMXN	10/04/2021	250,000	20.33676	(5,084,191)
2021011503104	FWD	USDMXN	10/13/2021	(938,318)	20.251	19,001,878
2021011503216	FWD	USDMXN	10/13/2021	938,318	20.47705	(19,213,988)
2021011503105	FWD	USDMXN	11/17/2021	(1,248,491)	20.251	25,283,191
2021011503217	FWD	USDMXN	11/17/2021	1,248,491	20.55504	(25,662,786)
2021011503359	FWD	USDMXN	12/01/2021	(250,000)	20.447	5,111,750
2021011503494	FWD	USDMXN	12/01/2021	80,000	20.44074	(1,635,260)
2021011503109	FWD	USDMXN	12/15/2021	(1,248,868)	20.251	25,290,826
2021011503218	FWD	USDMXN	12/15/2021	1,248,868	20.61704	(25,747,962)
2021011803220	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,000	19.9152	(8,284,725)
2021011803221	FWD	USDMXN	02/26/2021	250	19.82695	(4,957)
2021011803499	FWD	USDMXN	03/10/2021	(250,000)	19.8675	4,966,875
2021011803497	FWD	USDMXN	03/10/2021	250,000	19.82312	(4,955,781)
2021011803405	FWD	USDMXN	03/23/2021	(560,000)	19.898	11,142,880
2021011803495	FWD	USDMXN	03/23/2021	456,000	19.8617	(9,056,937)
2021011803504	FWD	USDMXN	03/23/2021	104,000	19.85826	(2,065,257)
2021011803298	FWD	USDMXN	06/01/2021	(100,000)	20.0501	2,005,010
2021011803332	FWD	USDMXN	06/01/2021	100,000	20.01102	(2,001,103)
2021011803301	FWD	USDMXN	06/08/2021	(100,000)	20.0643	2,006,430
2021011803333	FWD	USDMXN	06/08/2021	100,000	20.02648	(2,002,648)
2021011803306	FWD	USDMXN	06/15/2021	(100,000)	20.0793	2,007,930
2021011803334	FWD	USDMXN	06/15/2021	100,000	20.04194	(2,004,194)
2021011803311	FWD	USDMXN	06/22/2021	(100,000)	20.0944	2,009,440
2021011803335	FWD	USDMXN	06/22/2021	100,000	20.05744	(2,005,744)
2021011803314	FWD	USDMXN	06/25/2021	(100,000)	20.1019	2,010,190
2021011803336	FWD	USDMXN	06/25/2021	100,000	20.06422	(2,006,422)
2021011803424	FWD	USDMXN	06/29/2021	(100,000)	20.1125	2,011,250
2021011803436	FWD	USDMXN	06/29/2021	100,000	20.07467	(2,007,467)
2021011803116	FWD	USDMXN	07/02/2021	(25,000)	20.1592	503,980
2021011803215	FWD	USDMXN	07/02/2021	25,000	20.09941	(502,486)
2021011803117	FWD	USDMXN	07/09/2021	(25,000)	20.1592	503,980
2021011803216	FWD	USDMXN	07/09/2021	25,000	20.11523	(502,881)
2021011803118	FWD	USDMXN	07/16/2021	(25,000)	20.1592	503,980
2021011803217	FWD	USDMXN	07/16/2021	25,000	20.13105	(503,276)
2021011803119	FWD	USDMXN	07/23/2021	(25,000)	20.1592	503,980
2021011803218	FWD	USDMXN	07/23/2021	25,000	20.1468	(503,670)
2021011803121	FWD	USDMXN	07/30/2021	(25,000)	20.1592	503,980
2021011803219	FWD	USDMXN	07/30/2021	25,000	20.16245	(504,061)
2021011803358	FWD	USDMXN	12/01/2021	170,000	20.42844	(3,472,835)
2021011903011	FWD	USDMXN	01/19/2021	(38,000,000)	19.625	745,750,000
2021011903154	FWD	USDMXN	01/19/2021	(25,000,000)	19.675	491,875,000
2021011903014	FWD	USDMXN	01/19/2021	38,000,000	19.625	(745,750,000)
2021011903155	FWD	USDMXN	01/20/2021	25,000,000	19.6774	(491,935,000)
2021011903015	FWD	USDMXN	01/21/2021	(38,000,000)	19.62965	745,926,700
2021011903534	FWD	USDMXN	01/21/2021	(1,000,000)	19.68943	19,689,430
2021011903012	FWD	USDMXN	01/21/2021	38,000,000	19.62965	(745,926,700)
2021011903281	FWD	USDMXN	01/21/2021	1,500,000	19.67529	(29,512,935)
2021011903282	FWD	USDMXN	01/28/2021	(1,500,000)	19.69046	29,535,690
2021011903099	FWD	USDMXN	01/28/2021	100,000	22.4288	(2,242,880)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011903100	FWD	USDMXN	01/28/2021	100,000	20.1607	(2,016,070)
2021011903102	FWD	USDMXN	01/28/2021	100,000	20.002	(2,000,200)
2021011903103	FWD	USDMXN	01/28/2021	100,000	19.9153	(1,991,530)
2021011903105	FWD	USDMXN	01/28/2021	200,000	19.908	(3,981,600)
2021011903109	FWD	USDMXN	01/28/2021	200,000	20.123	(4,024,600)
2021011903111	FWD	USDMXN	01/28/2021	200,000	19.9687	(3,993,740)
2021011903112	FWD	USDMXN	01/28/2021	250,000	19.8929	(4,973,225)
2021011903114	FWD	USDMXN	01/28/2021	250,000	19.7779	(4,944,475)
2021011903576	FWD	USDMXN	01/29/2021	13,184,305	19.70833	(259,840,615)
2021011903008	FWD	USDMXN	02/09/2021	(300,000)	19.6795	5,903,850
2021011903145	FWD	USDMXN	02/09/2021	300,000	19.67136	(5,901,408)
2021011903510	FWD	USDMXN	02/11/2021	(50,000)	19.73649	986,825
2021011903497	FWD	USDMXN	02/11/2021	50,000	19.74303	(987,152)
2021011903480	FWD	USDMXN	02/12/2021	(50,000)	19.7908	989,540
2021011903511	FWD	USDMXN	02/12/2021	50,000	19.73957	(986,978)
2021011903356	FWD	USDMXN	02/24/2021	(100,000)	19.734	1,973,400
2021011903252	FWD	USDMXN	02/24/2021	660,000	19.73765	(13,026,848)
2021011903333	FWD	USDMXN	02/24/2021	4,262	19.72289	(84,058)
2021011903334	FWD	USDMXN	02/24/2021	100,000	19.71921	(1,971,921)
2021011903482	FWD	USDMXN	02/26/2021	(50,000)	19.8228	991,140
2021011903498	FWD	USDMXN	02/26/2021	50,000	19.77733	(988,866)
2021011903009	FWD	USDMXN	03/09/2021	(300,000)	19.7412	5,922,360
2021011903146	FWD	USDMXN	03/09/2021	300,000	19.73499	(5,920,496)
2021011903484	FWD	USDMXN	03/12/2021	(50,000)	19.8554	992,770
2021011903499	FWD	USDMXN	03/12/2021	50,000	19.80893	(990,447)
2021011903259	FWD	USDMXN	03/23/2021	660,000	19.78608	(13,058,815)
2021011903360	FWD	USDMXN	03/23/2021	2,634	19.79245	(52,138)
2021011903485	FWD	USDMXN	03/26/2021	(50,000)	19.887	994,350
2021011903500	FWD	USDMXN	03/26/2021	50,000	19.84058	(992,029)
2021011903363	FWD	USDMXN	03/30/2021	(25,720)	19.861	510,834
2021011903389	FWD	USDMXN	03/30/2021	25,720	19.79342	(509,087)
2021011903168	FWD	USDMXN	04/08/2021	15,000,000	19.83566	(297,534,840)
2021011903365	FWD	USDMXN	04/13/2021	(24,700)	19.893	491,360
2021011903390	FWD	USDMXN	04/13/2021	24,700	19.82521	(489,683)
2021011903486	FWD	USDMXN	04/15/2021	(50,000)	19.9325	996,625
2021011903501	FWD	USDMXN	04/15/2021	50,000	19.88605	(994,303)
2021011903269	FWD	USDMXN	04/20/2021	660,000	19.85869	(13,106,733)
2021011903392	FWD	USDMXN	04/20/2021	50	19.8663	(990)
2021011903532	FWD	USDMXN	04/28/2021	(1,000,000)	19.86	19,860,000
2021011903545	FWD	USDMXN	04/28/2021	(117,976)	19.913	2,349,262
2021011903535	FWD	USDMXN	04/28/2021	1,000,000	19.91077	(19,910,765)
2021011903579	FWD	USDMXN	04/28/2021	115,695	19.91144	(2,303,647)
2021011903584	FWD	USDMXN	04/28/2021	2,282	19.89484	(45,393)
2021011903489	FWD	USDMXN	04/29/2021	(50,000)	19.9646	998,230
2021011903502	FWD	USDMXN	04/29/2021	50,000	19.91817	(995,908)
2021011903490	FWD	USDMXN	05/14/2021	(50,000)	19.9992	999,960
2021011903503	FWD	USDMXN	05/14/2021	50,000	19.95281	(997,641)
2021011903491	FWD	USDMXN	05/28/2021	(50,000)	20.031	1,001,550
2021011903504	FWD	USDMXN	05/28/2021	50,000	19.9845	(999,225)
2021011903025	FWD	USDMXN	09/13/2021	(250,000)	20.209	5,052,250
2021011903148	FWD	USDMXN	09/13/2021	250,000	20.21166	(5,052,916)
2021011903028	FWD	USDMXN	10/04/2021	(250,000)	20.257	5,064,250

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011903150	FWD	USDMXN	10/04/2021	250,000	20.23554	(5,058,886)
2021012003585	FWD	USDMXN	01/20/2021	(1,500,000)	19.63	29,445,000
2021012003435	FWD	USDMXN	01/20/2021	330,000	19.547	(6,450,510)
2021012003436	FWD	USDMXN	01/20/2021	50,000	19.547	(977,350)
2021012003536	FWD	USDMXN	01/22/2021	(2,362,441)	19.61637	46,342,517
2021012003586	FWD	USDMXN	01/25/2021	1,500,000	19.6405	(29,460,750)
2021012003189	FWD	USDMXN	01/26/2021	(1,000,000)	19.59926	19,599,261
2021012003196	FWD	USDMXN	01/26/2021	1,000,000	19.59494	(19,594,942)
2021012003185	FWD	USDMXN	01/27/2021	(890,816)	19.9662	17,786,210
2021012003563	FWD	USDMXN	01/27/2021	(260,859)	19.9372	5,200,798
2021012003317	FWD	USDMXN	01/27/2021	890,816	19.60277	(17,462,464)
2021012003622	FWD	USDMXN	01/27/2021	260,859	19.57462	(5,106,217)
2021012003366	FWD	USDMXN	02/08/2021	(67,000)	19.7322	1,322,057
2021012003377	FWD	USDMXN	02/08/2021	67,000	19.60595	(1,313,599)
2021012003091	FWD	USDMXN	02/16/2021	(500,000)	19.637	9,818,500
2021012003371	FWD	USDMXN	02/16/2021	(32,000)	19.7515	632,048
2021012003120	FWD	USDMXN	02/16/2021	500,000	19.63049	(9,815,243)
2021012003376	FWD	USDMXN	02/16/2021	32,000	19.62406	(627,970)
2021012003186	FWD	USDMXN	02/17/2021	(901,499)	19.9662	17,999,509
2021012003564	FWD	USDMXN	02/17/2021	(268,478)	19.9372	5,352,700
2021012003319	FWD	USDMXN	02/17/2021	901,499	19.65091	(17,715,278)
2021012003623	FWD	USDMXN	02/17/2021	268,478	19.6222	(5,268,129)
2021012003527	FWD	USDMXN	02/23/2021	(23,450)	19.7693	463,590
2021012003520	FWD	USDMXN	02/23/2021	23,450	19.68998	(461,730)
2021012003373	FWD	USDMXN	02/25/2021	(464,811)	19.64605	9,131,699
2021012003231	FWD	USDMXN	03/04/2021	(300,000)	19.6869	5,906,070
2021012003249	FWD	USDMXN	03/04/2021	300,000	19.66997	(5,900,990)
2021012003092	FWD	USDMXN	03/09/2021	(2,500,000)	19.6865	49,216,250
2021012003121	FWD	USDMXN	03/09/2021	2,500,000	19.6782	(49,195,498)
2021012003233	FWD	USDMXN	03/11/2021	(300,000)	19.7027	5,910,810
2021012003372	FWD	USDMXN	03/11/2021	(239,795)	19.67754	4,718,576
2021012003250	FWD	USDMXN	03/11/2021	300,000	19.68582	(5,905,745)
2021012003187	FWD	USDMXN	03/17/2021	(923,166)	19.9662	18,432,117
2021012003565	FWD	USDMXN	03/17/2021	(282,096)	19.9372	5,624,204
2021012003318	FWD	USDMXN	03/17/2021	923,166	19.7145	(18,199,757)
2021012003340	FWD	USDMXN	03/17/2021	77,902	19.69326	(1,534,143)
2021012003624	FWD	USDMXN	03/17/2021	282,096	19.68461	(5,552,951)
2021012003235	FWD	USDMXN	03/25/2021	(300,000)	19.7354	5,920,620
2021012003251	FWD	USDMXN	03/25/2021	300,000	19.71743	(5,915,230)
2021012003089	FWD	USDMXN	04/06/2021	(398,580)	19.8157	7,898,149
2021012003222	FWD	USDMXN	04/06/2021	(56,753)	19.8082	1,124,174
2021012003103	FWD	USDMXN	04/06/2021	398,500	19.74505	(7,868,402)
2021012003122	FWD	USDMXN	04/06/2021	80	19.74899	(1,587)
2021012003245	FWD	USDMXN	04/06/2021	56,753	19.74169	(1,120,400)
2021012003288	FWD	USDMXN	04/08/2021	(100,000)	19.7492	1,974,920
2021012003333	FWD	USDMXN	04/08/2021	100,000	19.73346	(1,973,346)
2021012003452	FWD	USDMXN	04/15/2021	(100,000)	19.775	1,977,500
2021012003430	FWD	USDMXN	04/15/2021	100,000	19.75716	(1,975,716)
2021012003223	FWD	USDMXN	04/21/2021	(927,295)	19.9662	18,514,557
2021012003567	FWD	USDMXN	04/21/2021	(292,230)	19.9372	5,826,248
2021012003320	FWD	USDMXN	04/21/2021	927,295	19.79306	(18,354,003)
2021012003341	FWD	USDMXN	04/21/2021	92,598	19.77171	(1,830,819)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012003625	FWD	USDMXN	04/21/2021	292,230	19.76341	(5,775,460)
2021012003302	FWD	USDMXN	04/22/2021	(100,000)	19.781	1,978,100
2021012003465	FWD	USDMXN	04/22/2021	(63,412)	19.78647	1,254,702
2021012003334	FWD	USDMXN	04/22/2021	100,000	19.76478	(1,976,478)
2021012003363	FWD	USDMXN	04/22/2021	63,412	19.763	(1,253,214)
2021012003248	FWD	USDMXN	04/23/2021	(61,607)	19.807	1,220,250
2021012003339	FWD	USDMXN	04/23/2021	61,607	19.77624	(1,218,355)
2021012003139	FWD	USDMXN	04/28/2021	(6,000,000)	19.8599	119,159,400
2021012003152	FWD	USDMXN	04/28/2021	6,000,000	19.81673	(118,900,374)
2021012003304	FWD	USDMXN	04/29/2021	(100,000)	19.7969	1,979,690
2021012003335	FWD	USDMXN	04/29/2021	100,000	19.78078	(1,978,078)
2021012003224	FWD	USDMXN	05/19/2021	(938,837)	19.9662	18,745,007
2021012003568	FWD	USDMXN	05/19/2021	(305,953)	19.9372	6,099,846
2021012003321	FWD	USDMXN	05/19/2021	938,837	19.85712	(18,642,594)
2021012003626	FWD	USDMXN	05/19/2021	305,953	19.82694	(6,066,112)
2021012003252	FWD	USDMXN	05/20/2021	(89,315)	19.865	1,774,233
2021012003342	FWD	USDMXN	05/20/2021	89,315	19.83798	(1,771,820)
2021012003150	FWD	USDMXN	06/09/2021	(1,100,000)	19.9078	21,898,580
2021012003151	FWD	USDMXN	06/09/2021	1,100,000	19.89527	(21,884,797)
2021012003472	FWD	USDMXN	06/10/2021	(11,206)	19.89444	222,933
2021012003367	FWD	USDMXN	06/10/2021	11,206	19.865	(222,603)
2021012003226	FWD	USDMXN	06/16/2021	(942,542)	19.9662	18,818,982
2021012003570	FWD	USDMXN	06/16/2021	(318,005)	19.9372	6,340,129
2021012003322	FWD	USDMXN	06/16/2021	942,542	19.91912	(18,774,605)
2021012003627	FWD	USDMXN	06/16/2021	318,005	19.88841	(6,324,613)
2021012003253	FWD	USDMXN	06/22/2021	(98,410)	19.935	1,961,809
2021012003343	FWD	USDMXN	06/22/2021	98,410	19.91078	(1,959,426)
2021012003428	FWD	USDMXN	06/28/2021	(3,362,441)	19.926	67,000,000
2021012003410	FWD	USDMXN	06/28/2021	1,000,000	19.92462	(19,924,623)
2021012003537	FWD	USDMXN	06/28/2021	2,362,441	19.97057	(47,179,303)
2021012003015	FWD	USDMXN	07/14/2021	(250,000)	20.01	5,002,500
2021012003227	FWD	USDMXN	07/14/2021	(954,074)	19.9662	19,049,232
2021012003571	FWD	USDMXN	07/14/2021	(333,347)	19.9372	6,646,006
2021012003109	FWD	USDMXN	07/14/2021	250,000	20.01564	(5,003,910)
2021012003323	FWD	USDMXN	07/14/2021	954,074	19.98177	(19,064,084)
2021012003628	FWD	USDMXN	07/14/2021	333,347	19.95049	(6,650,437)
2021012003239	FWD	USDMXN	07/19/2021	(1,000,000)	19.976	19,976,000
2021012003207	FWD	USDMXN	07/19/2021	1,000,000	19.97073	(19,970,731)
2021012003019	FWD	USDMXN	08/11/2021	(250,000)	20.071	5,017,750
2021012003241	FWD	USDMXN	08/11/2021	(1,000,000)	20.027	20,027,000
2021012003110	FWD	USDMXN	08/11/2021	250,000	20.07831	(5,019,577)
2021012003257	FWD	USDMXN	08/11/2021	1,000,000	20.02322	(20,023,217)
2021012003482	FWD	USDMXN	08/12/2021	(60,544)	20.03349	1,212,906
2021012003378	FWD	USDMXN	08/12/2021	60,544	20.02	(1,212,089)
2021012003228	FWD	USDMXN	08/18/2021	(956,036)	19.9662	19,088,406
2021012003572	FWD	USDMXN	08/18/2021	(345,815)	19.9372	6,894,583
2021012003324	FWD	USDMXN	08/18/2021	956,036	20.05944	(19,177,551)
2021012003629	FWD	USDMXN	08/18/2021	345,815	20.02739	(6,925,772)
2021012003487	FWD	USDMXN	08/26/2021	(60,462)	20.06448	1,213,146
2021012003381	FWD	USDMXN	08/26/2021	60,462	20.047	(1,212,089)
2021012003512	FWD	USDMXN	09/09/2021	(55,395)	20.10522	1,113,721
2021012003511	FWD	USDMXN	09/09/2021	55,395	20.074	(1,111,991)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012003022	FWD	USDMXN	09/13/2021	(250,000)	20.156	5,039,000
2021012003111	FWD	USDMXN	09/13/2021	250,000	20.15201	(5,038,003)
2021012003229	FWD	USDMXN	09/15/2021	(733,897)	19.9662	14,653,134
2021012003243	FWD	USDMXN	09/15/2021	(1,000,000)	20.099	20,099,000
2021012003573	FWD	USDMXN	09/15/2021	(274,662)	19.9372	5,475,991
2021012003258	FWD	USDMXN	09/15/2021	1,000,000	20.09789	(20,097,885)
2021012003325	FWD	USDMXN	09/15/2021	733,897	20.12106	(14,766,785)
2021012003630	FWD	USDMXN	09/15/2021	274,662	20.08839	(5,517,516)
2021012003523	FWD	USDMXN	09/23/2021	(55,304)	20.15474	1,114,631
2021012003514	FWD	USDMXN	09/23/2021	55,304	20.107	(1,111,991)
2021012003029	FWD	USDMXN	10/04/2021	(250,000)	20.202	5,050,500
2021012003112	FWD	USDMXN	10/04/2021	250,000	20.19903	(5,049,758)
2021012003232	FWD	USDMXN	10/13/2021	(729,160)	19.9662	14,558,554
2021012003576	FWD	USDMXN	10/13/2021	(282,128)	19.9372	5,624,842
2021012003326	FWD	USDMXN	10/13/2021	729,160	20.18289	(14,716,557)
2021012003631	FWD	USDMXN	10/13/2021	282,128	20.1496	(5,684,766)
2021012003492	FWD	USDMXN	10/21/2021	(92,120)	20.19464	1,860,340
2021012003403	FWD	USDMXN	10/21/2021	92,120	20.165	(1,857,609)
2021012003033	FWD	USDMXN	11/01/2021	(250,000)	20.265	5,066,250
2021012003115	FWD	USDMXN	11/01/2021	250,000	20.24683	(5,061,707)
2021012003519	FWD	USDMXN	11/10/2021	(94,026)	20.2531	1,904,308
2021012003516	FWD	USDMXN	11/10/2021	94,026	20.218	(1,901,008)
2021012003234	FWD	USDMXN	11/17/2021	(970,193)	19.9662	19,371,067
2021012003584	FWD	USDMXN	11/17/2021	(387,768)	19.9372	7,731,008
2021012003327	FWD	USDMXN	11/17/2021	970,193	20.25978	(19,655,899)
2021012003632	FWD	USDMXN	11/17/2021	387,768	20.2259	(7,842,956)
2021012003524	FWD	USDMXN	11/24/2021	(93,877)	20.28983	1,904,747
2021012003517	FWD	USDMXN	11/24/2021	93,877	20.25	(1,901,008)
2021012003036	FWD	USDMXN	12/01/2021	(250,000)	20.33	5,082,500
2021012003116	FWD	USDMXN	12/01/2021	250,000	20.3125	(5,078,124)
2021012003521	FWD	USDMXN	12/09/2021	(83,109)	20.32248	1,688,987
2021012003518	FWD	USDMXN	12/09/2021	83,109	20.281	(1,685,539)
2021012003236	FWD	USDMXN	12/15/2021	(970,486)	19.9662	19,376,918
2021012003588	FWD	USDMXN	12/15/2021	(400,323)	19.9372	7,981,320
2021012003330	FWD	USDMXN	12/15/2021	132,485	20.32108	(2,692,239)
2021012003331	FWD	USDMXN	12/15/2021	838,001	20.30948	(17,019,367)
2021012003633	FWD	USDMXN	12/15/2021	348,659	20.28684	(7,073,189)
2021012003637	FWD	USDMXN	12/15/2021	51,664	20.35204	(1,051,467)
2021012003528	FWD	USDMXN	12/23/2021	(82,970)	20.35321	1,688,709
2021012003522	FWD	USDMXN	12/23/2021	82,970	20.315	(1,685,539)
2021012103138	FWD	USDMXN	01/25/2021	(1,200,000)	19.68871	23,626,452
2021012103241	FWD	USDMXN	01/25/2021	0	19.6845	117,571
2021012103638	FWD	USDMXN	01/25/2021	(1,300,000)	19.71337	25,627,381
2021012103640	FWD	USDMXN	01/25/2021	(150,000)	19.71337	2,957,006
2021012103644	FWD	USDMXN	01/25/2021	(100,000)	19.71237	1,971,237
2021012103681	FWD	USDMXN	01/25/2021	(416,500)	19.72112	8,213,846
2021012103240	FWD	USDMXN	01/25/2021	111,074	20.743	(2,304,000)
2021012103683	FWD	USDMXN	01/25/2021	56,692	19.72738	(1,118,387)
2021012103685	FWD	USDMXN	01/25/2021	61,761	19.72888	(1,218,485)
2021012103687	FWD	USDMXN	01/25/2021	61,701	19.72813	(1,217,251)
2021012103679	FWD	USDMXN	01/27/2021	4,345,450	19.72838	(85,728,696)
2021012103680	FWD	USDMXN	01/28/2021	(4,345,450)	19.73026	85,736,861

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012103471	FWD	USDMXN	02/11/2021	(125,000)	19.8338	2,479,225
2021012103511	FWD	USDMXN	02/11/2021	125,000	19.79732	(2,474,665)
2021012103512	FWD	USDMXN	02/12/2021	(125,000)	19.79885	2,474,857
2021012103508	FWD	USDMXN	02/12/2021	125,000	19.80447	(2,475,560)
2021012103150	FWD	USDMXN	02/17/2021	(713,372)	20.0648	14,313,667
2021012103253	FWD	USDMXN	02/17/2021	(200,000)	19.64711	3,929,422
2021012103202	FWD	USDMXN	02/17/2021	713,372	19.74667	(14,086,723)
2021012103206	FWD	USDMXN	02/17/2021	200,000	19.75081	(3,950,162)
2021012103062	FWD	USDMXN	02/25/2021	346,000	19.7964	(6,849,554)
2021012103120	FWD	USDMXN	02/25/2021	237	19.76695	(4,683)
2021012103535	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,000	19.86164	(8,262,442)
2021012103682	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,500	19.79365	(8,244,053)
2021012103399	FWD	USDMXN	03/03/2021	(33,558)	19.82716	665,353
2021012103065	FWD	USDMXN	03/04/2021	176,000	19.79211	(3,483,412)
2021012103123	FWD	USDMXN	03/04/2021	163	19.78508	(3,219)
2021012103068	FWD	USDMXN	03/08/2021	109,000	19.80937	(2,159,221)
2021012103124	FWD	USDMXN	03/08/2021	55	19.79173	(1,079)
2021012103473	FWD	USDMXN	03/12/2021	(125,000)	19.8982	2,487,275
2021012103070	FWD	USDMXN	03/12/2021	120,000	19.80676	(2,376,811)
2021012103131	FWD	USDMXN	03/12/2021	17	19.80355	(332)
2021012103509	FWD	USDMXN	03/12/2021	125,000	19.86764	(2,483,455)
2021012103151	FWD	USDMXN	03/17/2021	(730,518)	20.0648	14,657,698
2021012103398	FWD	USDMXN	03/17/2021	(33,255)	19.85863	660,397
2021012103074	FWD	USDMXN	03/17/2021	576,000	19.80982	(11,410,454)
2021012103133	FWD	USDMXN	03/17/2021	605	19.81402	(11,987)
2021012103203	FWD	USDMXN	03/17/2021	730,518	19.80981	(14,471,424)
2021012103078	FWD	USDMXN	03/18/2021	346,000	19.81017	(6,854,320)
2021012103134	FWD	USDMXN	03/18/2021	747	19.81468	(14,808)
2021012103084	FWD	USDMXN	03/19/2021	420,000	19.8215	(8,325,029)
2021012103135	FWD	USDMXN	03/19/2021	783	19.8151	(15,524)
2021012103400	FWD	USDMXN	03/31/2021	(32,992)	19.88993	656,204
2021012103086	FWD	USDMXN	04/07/2021	155,000	19.85279	(3,077,183)
2021012103136	FWD	USDMXN	04/07/2021	437	19.85711	(8,687)
2021012103406	FWD	USDMXN	04/14/2021	(47,906)	19.92085	954,330
2021012103474	FWD	USDMXN	04/15/2021	(125,000)	19.9743	2,496,788
2021012103510	FWD	USDMXN	04/15/2021	125,000	19.94377	(2,492,971)
2021012103152	FWD	USDMXN	04/21/2021	(733,786)	20.0648	14,723,269
2021012103204	FWD	USDMXN	04/21/2021	733,786	19.88791	(14,593,467)
2021012103267	FWD	USDMXN	04/28/2021	(3,000,000)	19.8387	59,516,100
2021012103407	FWD	USDMXN	04/28/2021	(47,704)	19.95178	951,777
2021012103273	FWD	USDMXN	04/28/2021	3,000,000	19.78489	(59,354,664)
2021012103308	FWD	USDMXN	04/28/2021	47,704	19.939	(951,166)
2021012103154	FWD	USDMXN	05/19/2021	(742,919)	20.0648	14,906,521
2021012103207	FWD	USDMXN	05/19/2021	742,919	19.95232	(14,822,960)
2021012103413	FWD	USDMXN	05/26/2021	(44,002)	20.01378	880,650
2021012103315	FWD	USDMXN	05/26/2021	44,002	19.999	(880,000)
2021012103414	FWD	USDMXN	06/09/2021	(20,584)	20.04506	412,600
2021012103417	FWD	USDMXN	06/09/2021	(38,070)	20.07538	764,262
2021012103320	FWD	USDMXN	06/09/2021	58,653	20.033	(1,175,000)
2021012103157	FWD	USDMXN	06/16/2021	(745,850)	20.0648	14,965,331
2021012103208	FWD	USDMXN	06/16/2021	745,850	20.01503	(14,928,208)
2021012103419	FWD	USDMXN	06/23/2021	(58,574)	20.10674	1,177,738

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012103325	FWD	USDMXN	06/23/2021	58,574	20.06	(1,175,000)
2021012103108	FWD	USDMXN	07/09/2021	(995,000)	20.0961	19,995,620
2021012103105	FWD	USDMXN	07/09/2021	995,000	20.0786	(19,978,208)
2021012103159	FWD	USDMXN	07/14/2021	(754,976)	20.0648	15,148,442
2021012103210	FWD	USDMXN	07/14/2021	754,976	20.07823	(15,158,580)
2021012103627	FWD	USDMXN	07/15/2021	(1,300,000)	20.1244	26,161,720
2021012103639	FWD	USDMXN	07/15/2021	1,300,000	20.098	(26,127,400)
2021012103035	FWD	USDMXN	07/19/2021	(250,000)	20.097	5,024,250
2021012103162	FWD	USDMXN	07/19/2021	250,000	20.07114	(5,017,786)
2021012103418	FWD	USDMXN	07/21/2021	(33,356)	20.16955	672,778
2021012103504	FWD	USDMXN	07/21/2021	(61,411)	20.16928	1,238,623
2021012103360	FWD	USDMXN	07/21/2021	94,767	20.137	(1,908,333)
2021012103043	FWD	USDMXN	08/11/2021	(250,000)	20.1315	5,032,875
2021012103163	FWD	USDMXN	08/11/2021	250,000	20.12189	(5,030,472)
2021012103629	FWD	USDMXN	08/13/2021	(150,000)	20.182	3,027,300
2021012103641	FWD	USDMXN	08/13/2021	150,000	20.16292	(3,024,439)
2021012103160	FWD	USDMXN	08/18/2021	(756,529)	20.0648	15,179,603
2021012103506	FWD	USDMXN	08/18/2021	(46,986)	20.23398	950,704
2021012103211	FWD	USDMXN	08/18/2021	756,529	20.15607	(15,248,652)
2021012103348	FWD	USDMXN	08/18/2021	46,986	20.219	(950,000)
2021012103631	FWD	USDMXN	09/14/2021	(100,000)	20.2523	2,025,230
2021012103645	FWD	USDMXN	09/14/2021	100,000	20.23314	(2,023,314)
2021012103047	FWD	USDMXN	09/15/2021	(250,000)	20.195	5,048,750
2021012103165	FWD	USDMXN	09/15/2021	(580,746)	20.0648	11,652,552
2021012103119	FWD	USDMXN	09/15/2021	250,000	20.1904	(5,047,599)
2021012103213	FWD	USDMXN	09/15/2021	580,746	20.21726	(11,741,093)
2021012103052	FWD	USDMXN	10/04/2021	(250,000)	20.2415	5,060,375
2021012103118	FWD	USDMXN	10/04/2021	250,000	20.2625	(5,065,624)
2021012103168	FWD	USDMXN	10/13/2021	(576,997)	20.0648	11,577,329
2021012103507	FWD	USDMXN	10/13/2021	(70,847)	20.35234	1,441,903
2021012103214	FWD	USDMXN	10/13/2021	576,997	20.27867	(11,700,729)
2021012103371	FWD	USDMXN	10/13/2021	70,847	20.349	(1,441,666)
2021012103057	FWD	USDMXN	11/01/2021	(250,000)	20.312	5,078,000
2021012103117	FWD	USDMXN	11/01/2021	250,000	20.30841	(5,077,103)
2021012103684	FWD	USDMXN	11/10/2021	(56,692)	20.36859	1,154,738
2021012103380	FWD	USDMXN	11/10/2021	56,692	20.432	(1,158,333)
2021012103169	FWD	USDMXN	11/17/2021	(767,731)	20.0648	15,404,369
2021012103215	FWD	USDMXN	11/17/2021	767,731	20.35651	(15,628,324)
2021012103686	FWD	USDMXN	12/08/2021	(61,761)	20.43223	1,261,924
2021012103388	FWD	USDMXN	12/08/2021	61,761	20.509	(1,266,666)
2021012103096	FWD	USDMXN	12/10/2021	(1,200,000)	20.435	24,522,000
2021012103139	FWD	USDMXN	12/10/2021	1,200,000	20.39889	(24,478,662)
2021012103170	FWD	USDMXN	12/15/2021	(767,963)	20.0648	15,409,024
2021012103216	FWD	USDMXN	12/15/2021	767,963	20.41905	(15,681,077)
2021012103688	FWD	USDMXN	12/22/2021	(61,701)	20.46265	1,262,572
2021012103389	FWD	USDMXN	12/22/2021	61,701	20.529	(1,266,666)
2021012103027	FWD	USDMXN	01/21/2022	(500,000)	20.503	10,251,500
2021012103113	FWD	USDMXN	01/21/2022	500,000	20.48458	(10,242,289)
2021012203222	FWD	USDMXN	01/22/2021	(15,030,060)	19.96	300,000,000
2021012203223	FWD	USDMXN	01/25/2021	15,024,866	19.9669	(300,000,000)
2021012203120	FWD	USDMXN	02/02/2021	(49,000)	19.99786	979,895
2021012203123	FWD	USDMXN	02/02/2021	(130,000)	19.99506	2,599,357

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012203145	FWD	USDMXN	02/02/2021	(83,970,000)	20.01805	1,680,915,659
2021012203321	FWD	USDMXN	02/02/2021	(1,368)	20.00644	27,372
2021012203564	FWD	USDMXN	02/02/2021	(559,000)	19.93861	11,145,685
2021012203115	FWD	USDMXN	02/02/2021	130,800	20.005	(2,616,652)
2021012203121	FWD	USDMXN	02/02/2021	49,568	19.985	(990,621)
2021012203485	FWD	USDMXN	02/02/2021	108,000	19.839	(2,142,612)
2021012203487	FWD	USDMXN	02/02/2021	101,000	19.839	(2,003,739)
2021012203495	FWD	USDMXN	02/02/2021	132,000	19.839	(2,618,748)
2021012203497	FWD	USDMXN	02/02/2021	80,000	19.839	(1,587,120)
2021012203500	FWD	USDMXN	02/02/2021	82,000	19.839	(1,626,798)
2021012203504	FWD	USDMXN	02/02/2021	56,000	19.839	(1,110,984)
2021012203108	FWD	USDMXN	02/03/2021	(100,000)	19.96446	1,996,446
2021012203150	FWD	USDMXN	02/03/2021	(149,000)	19.96148	2,974,260
2021012203280	FWD	USDMXN	02/03/2021	(103,000)	20.005	2,060,515
2021012203324	FWD	USDMXN	02/03/2021	(1,140)	19.99657	22,792
2021012203111	FWD	USDMXN	02/03/2021	100,000	19.952	(1,995,200)
2021012203152	FWD	USDMXN	02/03/2021	149,492	19.951	(2,982,516)
2021012203281	FWD	USDMXN	02/03/2021	103,648	19.998	(2,072,748)
2021012203016	FWD	USDMXN	02/05/2021	(50,000)	19.96808	998,404
2021012203565	FWD	USDMXN	02/05/2021	(226,000)	19.94524	4,507,624
2021012203017	FWD	USDMXN	02/05/2021	50,000	19.951	(997,550)
2021012203510	FWD	USDMXN	02/05/2021	125,000	19.845	(2,480,625)
2021012203516	FWD	USDMXN	02/05/2021	101,000	19.845	(2,004,345)
2021012203566	FWD	USDMXN	02/08/2021	(550,000)	19.95186	10,973,525
2021012203522	FWD	USDMXN	02/08/2021	130,000	19.8515	(2,580,695)
2021012203523	FWD	USDMXN	02/08/2021	109,000	19.8515	(2,163,814)
2021012203524	FWD	USDMXN	02/08/2021	109,000	19.8515	(2,163,814)
2021012203534	FWD	USDMXN	02/08/2021	101,000	19.8515	(2,005,002)
2021012203536	FWD	USDMXN	02/08/2021	101,000	19.8515	(2,005,002)
2021012203015	FWD	USDMXN	02/09/2021	(50,000)	19.9799	998,995
2021012203567	FWD	USDMXN	02/09/2021	(403,000)	19.95407	8,041,491
2021012203018	FWD	USDMXN	02/09/2021	50,000	19.961	(998,050)
2021012203537	FWD	USDMXN	02/09/2021	55,000	19.853	(1,091,915)
2021012203538	FWD	USDMXN	02/09/2021	130,000	19.853	(2,580,890)
2021012203540	FWD	USDMXN	02/09/2021	109,000	19.853	(2,163,977)
2021012203544	FWD	USDMXN	02/09/2021	109,000	19.853	(2,163,977)
2021012203410	FWD	USDMXN	02/11/2021	(100,000)	19.95931	1,995,931
2021012203420	FWD	USDMXN	02/11/2021	100,000	19.94	(1,994,000)
2021012203020	FWD	USDMXN	02/12/2021	(100,000)	19.84704	1,984,705
2021012203335	FWD	USDMXN	02/12/2021	(50,000)	19.99171	999,586
2021012203568	FWD	USDMXN	02/12/2021	(341,000)	19.96084	6,806,648
2021012203019	FWD	USDMXN	02/12/2021	100,000	19.8292	(1,982,920)
2021012203282	FWD	USDMXN	02/12/2021	50,000	19.9644	(998,220)
2021012203550	FWD	USDMXN	02/12/2021	101,000	19.8605	(2,005,911)
2021012203556	FWD	USDMXN	02/12/2021	131,000	19.8605	(2,601,726)
2021012203557	FWD	USDMXN	02/12/2021	109,000	19.8605	(2,164,795)
2021012203336	FWD	USDMXN	02/26/2021	(50,000)	20.02315	1,001,158
2021012203287	FWD	USDMXN	02/26/2021	50,000	19.9929	(999,645)
2021012203388	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,000	20.00181	(8,320,753)
2021012203389	FWD	USDMXN	02/26/2021	250	20.00481	(5,001)
2021012203220	FWD	USDMXN	03/01/2021	(29,000)	20.01873	580,543
2021012203262	FWD	USDMXN	03/01/2021	29,000	19.97	(579,130)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012203233	FWD	USDMXN	03/05/2021	(10,000)	20.02089	200,209
2021012203263	FWD	USDMXN	03/05/2021	10,000	19.97	(199,700)
2021012203337	FWD	USDMXN	03/17/2021	(50,000)	20.06582	1,003,291
2021012203288	FWD	USDMXN	03/17/2021	50,000	20.0356	(1,001,780)
2021012203338	FWD	USDMXN	03/30/2021	(50,000)	20.09492	1,004,746
2021012203290	FWD	USDMXN	03/30/2021	50,000	20.0608	(1,003,040)
2021012203339	FWD	USDMXN	04/15/2021	(50,000)	20.13013	1,006,506
2021012203327	FWD	USDMXN	04/15/2021	50,000	20.096	(1,004,800)
2021012203340	FWD	USDMXN	04/29/2021	(50,000)	20.16096	1,008,048
2021012203293	FWD	USDMXN	04/29/2021	50,000	20.1269	(1,006,345)
2021012203131	FWD	USDMXN	05/21/2021	(5,000,000)	20.23432	101,171,585
2021012203129	FWD	USDMXN	05/21/2021	5,000,000	20.21	(101,050,000)
2021012203038	FWD	USDMXN	07/19/2021	(5,000,000)	20.19431	100,971,550
2021012203039	FWD	USDMXN	07/19/2021	(3,000,000)	20.29317	60,879,522
2021012203036	FWD	USDMXN	07/19/2021	5,000,000	20.1705	(100,852,500)
2021012203037	FWD	USDMXN	07/19/2021	3,000,000	20.2655	(60,796,500)
2021012503344	FWD	USDMXN	01/25/2021	(3,500,000)	20.1	70,350,000
2021012503345	FWD	USDMXN	01/27/2021	3,500,000	20.1042	(70,364,700)
2021012503044	FWD	USDMXN	02/02/2021	(370,000)	20.17283	7,463,947
2021012503245	FWD	USDMXN	02/02/2021	(491)	20.12907	9,878
2021012503050	FWD	USDMXN	02/03/2021	(52,000)	20.21209	1,051,029
2021012503124	FWD	USDMXN	02/03/2021	(262,000)	20.20318	5,293,234
2021012503172	FWD	USDMXN	02/03/2021	(40,000)	20.20361	808,144
2021012503247	FWD	USDMXN	02/03/2021	(1,382)	20.12999	27,822
2021012503060	FWD	USDMXN	02/04/2021	(220,000)	20.20275	4,444,606
2021012503161	FWD	USDMXN	02/04/2021	(15,000)	20.19726	302,959
2021012503248	FWD	USDMXN	02/04/2021	(2,772)	20.14476	55,848
2021012503317	FWD	USDMXN	02/04/2021	(233,000)	20.0819	4,679,082
2021012503320	FWD	USDMXN	02/04/2021	(30,000)	20.08782	602,635
2021012503451	FWD	USDMXN	02/04/2021	(128)	20.12176	2,571
2021012503226	FWD	USDMXN	02/10/2021	(60,000)	20.17376	1,210,426
2021012603456	FWD	USDMXN	01/28/2021	125,000	19.99812	(2,499,765)
2021012603458	FWD	USDMXN	01/28/2021	125,000	19.99812	(2,499,765)
2021012603463	FWD	USDMXN	02/04/2021	(132)	20.00628	2,645
2021012603294	FWD	USDMXN	02/04/2021	87,000	20.02358	(1,742,051)
2021012603464	FWD	USDMXN	02/04/2021	264	20.00861	(5,291)
2021012603457	FWD	USDMXN	02/11/2021	(125,000)	20.02952	2,503,690
2021012603303	FWD	USDMXN	02/16/2021	797,000	20.04677	(15,977,274)
2021012603465	FWD	USDMXN	02/16/2021	535	20.03862	(10,728)
2021012603309	FWD	USDMXN	02/17/2021	416,000	20.04382	(8,338,228)
2021012603466	FWD	USDMXN	02/17/2021	74	20.04268	(1,486)
2021012603496	FWD	USDMXN	02/17/2021	87,845	20.03525	(1,759,997)
2021012603311	FWD	USDMXN	02/19/2021	568,000	20.03929	(11,382,317)
2021012603467	FWD	USDMXN	02/19/2021	949	20.04622	(19,027)
2021012603086	FWD	USDMXN	02/23/2021	32,000	20.03101	(640,992)
2021012603313	FWD	USDMXN	02/24/2021	11,000	20.05382	(220,592)
2021012603468	FWD	USDMXN	02/24/2021	225	20.05711	(4,505)
2021012603232	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,000	20.03511	(8,334,606)
2021012603469	FWD	USDMXN	02/26/2021	250	20.06275	(5,014)
2021012603459	FWD	USDMXN	03/12/2021	(125,000)	20.09505	2,511,881
2021012603085	FWD	USDMXN	03/16/2021	50,000	20.07857	(1,003,928)
2021012603322	FWD	USDMXN	03/16/2021	229,000	20.10355	(4,603,712)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012603470	FWD	USDMXN	03/16/2021	38	20.10371	(773)
2021012603493	FWD	USDMXN	03/17/2021	88,898	20.09851	(1,786,717)
2021012603087	FWD	USDMXN	03/23/2021	50,000	20.09446	(1,004,724)
2021012603326	FWD	USDMXN	03/29/2021	11,000	20.13671	(221,504)
2021012603471	FWD	USDMXN	03/29/2021	224	20.13227	(4,505)
2021012603492	FWD	USDMXN	04/21/2021	91,035	20.17711	(1,836,823)
2021012603330	FWD	USDMXN	04/27/2021	11,000	20.20611	(222,267)
2021012603475	FWD	USDMXN	04/27/2021	227	20.19657	(4,577)
2021012603495	FWD	USDMXN	05/19/2021	91,442	20.24115	(1,850,891)
2021012603335	FWD	USDMXN	05/25/2021	103,000	20.26528	(2,087,324)
2021012603476	FWD	USDMXN	05/25/2021	83	20.25493	(1,687)
2021012603494	FWD	USDMXN	06/16/2021	92,580	20.30542	(1,879,876)
2021012603497	FWD	USDMXN	07/14/2021	92,945	20.36971	(1,893,262)
2021012603498	FWD	USDMXN	08/18/2021	94,082	20.44906	(1,923,888)
2021012603499	FWD	USDMXN	09/15/2021	94,276	20.5117	(1,933,761)
2021012603500	FWD	USDMXN	10/13/2021	72,730	20.57433	(1,496,371)
2021012603501	FWD	USDMXN	11/17/2021	71,903	20.65336	(1,485,039)
2021012603502	FWD	USDMXN	12/15/2021	95,672	20.71685	(1,982,022)
2021012603503	FWD	USDMXN	01/19/2022	26,592	20.7972	(553,039)
2021012603504	FWD	USDMXN	01/19/2022	69,109	20.80692	(1,437,945)
2021012703378	FWD	USDMXN	01/27/2021	(5,500,000)	20.22	111,210,000
2021012703383	FWD	USDMXN	01/28/2021	(1,500,000)	20.22	30,330,000
2021012703379	FWD	USDMXN	01/28/2021	5,500,000	20.2222	(111,222,100)
2021012703390	FWD	USDMXN	01/29/2021	(416,250)	20.1739	8,397,386
2021012703384	FWD	USDMXN	02/02/2021	1,500,000	20.231	(30,346,500)
2021012703729	FWD	USDMXN	02/03/2021	(100,000)	20.27666	2,027,666
2021012703548	FWD	USDMXN	02/05/2021	(66,000)	20.22147	1,334,617
2021012703652	FWD	USDMXN	02/05/2021	(137,000)	20.30237	2,781,424
2021012703800	FWD	USDMXN	02/05/2021	(1,532)	20.31695	31,122
2021012703728	FWD	USDMXN	02/10/2021	(100,000)	20.29285	2,029,285
2021012703040	FWD	USDMXN	02/11/2021	(9)	20.25408	190
2021012703084	FWD	USDMXN	02/16/2021	(100,000)	20.2488	2,024,880
2021012703467	FWD	USDMXN	02/16/2021	(60,000)	20.22885	1,213,731
2021012703727	FWD	USDMXN	02/17/2021	(100,000)	20.30909	2,030,909
2021012703786	FWD	USDMXN	02/17/2021	150,832	20.31585	(3,064,280)
2021012703442	FWD	USDMXN	02/24/2021	(100,000)	20.25868	2,025,868
2021012703726	FWD	USDMXN	02/24/2021	(100,000)	20.32545	2,032,545
2021012703391	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,250	20.2403	(8,425,025)
2021012703595	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,000	20.26431	(8,429,952)
2021012703801	FWD	USDMXN	02/26/2021	250	20.37309	(5,093)
2021012703779	FWD	USDMXN	03/02/2021	24,300	20.38702	(495,405)
2021012703725	FWD	USDMXN	03/03/2021	(100,000)	20.34116	2,034,116
2021012703724	FWD	USDMXN	03/10/2021	(100,000)	20.35659	2,035,659
2021012703723	FWD	USDMXN	03/17/2021	(100,000)	20.37195	2,037,195
2021012703787	FWD	USDMXN	03/17/2021	160,126	20.37884	(3,263,183)
2021012703722	FWD	USDMXN	03/24/2021	(100,000)	20.38729	2,038,729
2021012703158	FWD	USDMXN	03/25/2021	(230,000)	20.34574	4,679,520
2021012703403	FWD	USDMXN	03/25/2021	(1,875)	20.34603	38,139
2021012703778	FWD	USDMXN	03/29/2021	(100,000)	20.43369	2,043,369
2021012703721	FWD	USDMXN	03/31/2021	(100,000)	20.40264	2,040,264
2021012703401	FWD	USDMXN	04/08/2021	(61,492)	20.37799	1,253,091
2021012703788	FWD	USDMXN	04/21/2021	155,985	20.45873	(3,191,255)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012703789	FWD	USDMXN	05/19/2021	86,427	20.52345	(1,773,780)
2021012703790	FWD	USDMXN	06/16/2021	77,423	20.58755	(1,593,950)
2021012703402	FWD	USDMXN	06/24/2021	(10,816)	20.55385	222,320
2021012703400	FWD	USDMXN	07/08/2021	(55,477)	20.58589	1,142,051
2021012703791	FWD	USDMXN	07/14/2021	86,637	20.65147	(1,789,181)
2021012703397	FWD	USDMXN	07/22/2021	(55,445)	20.61792	1,143,162
2021012703799	FWD	USDMXN	07/30/2021	(5,000)	20.71479	103,574
2021012703665	FWD	USDMXN	07/30/2021	5,000	20.68567	(103,428)
2021012703792	FWD	USDMXN	08/18/2021	88,444	20.73223	(1,833,641)
2021012703398	FWD	USDMXN	08/26/2021	(58,600)	20.69757	1,212,884
2021012703399	FWD	USDMXN	09/09/2021	(53,675)	20.72958	1,112,666
2021012703793	FWD	USDMXN	09/15/2021	62,960	20.79705	(1,309,382)
2021012703338	FWD	USDMXN	09/21/2021	(53,644)	20.72367	1,111,701
2021012703410	FWD	USDMXN	09/21/2021	53,644	20.75068	(1,113,150)
2021012703411	FWD	USDMXN	09/23/2021	(53,644)	20.75152	1,113,194
2021012703186	FWD	USDMXN	10/05/2021	(89,523)	20.74559	1,857,214
2021012703412	FWD	USDMXN	10/05/2021	89,523	20.78749	(1,860,965)
2021012703413	FWD	USDMXN	10/07/2021	(89,523)	20.78823	1,861,032
2021012703006	FWD	USDMXN	10/13/2021	(360)	20.7842	7,482
2021012703794	FWD	USDMXN	10/13/2021	62,848	20.86173	(1,311,118)
2021012703169	FWD	USDMXN	11/08/2021	(91,224)	20.84149	1,901,235
2021012703416	FWD	USDMXN	11/08/2021	91,224	20.86285	(1,903,184)
2021012703417	FWD	USDMXN	11/10/2021	(91,224)	20.86316	1,903,212
2021012703795	FWD	USDMXN	11/17/2021	90,330	20.94241	(1,891,728)
2021012703349	FWD	USDMXN	11/22/2021	(91,044)	20.86784	1,899,901
2021012703509	FWD	USDMXN	11/22/2021	91,044	20.86265	(1,899,429)
2021012703510	FWD	USDMXN	11/24/2021	(91,044)	20.8628	1,899,442
2021012703344	FWD	USDMXN	12/07/2021	(80,609)	20.90252	1,684,936
2021012703598	FWD	USDMXN	12/07/2021	80,609	20.94287	(1,688,189)
2021012703599	FWD	USDMXN	12/09/2021	(80,609)	20.94295	1,688,195
2021012703796	FWD	USDMXN	12/15/2021	100,189	21.0065	(2,104,620)
2021012703184	FWD	USDMXN	12/21/2021	(80,513)	20.93338	1,685,408
2021012703600	FWD	USDMXN	12/21/2021	80,513	20.97188	(1,688,509)
2021012703601	FWD	USDMXN	12/23/2021	(80,513)	20.97196	1,688,515
2021012703004	FWD	USDMXN	01/21/2022	(500,000)	21.00747	10,503,736
2021012803023	FWD	USDMXN	02/05/2021	(177,000)	20.38302	3,607,794
2021012803104	FWD	USDMXN	02/05/2021	(222,000)	20.3336	4,514,058
2021012803168	FWD	USDMXN	02/05/2021	(733)	20.32102	14,894
2021012803330	FWD	USDMXN	02/08/2021	(163,000)	20.22193	3,296,175
2021012803575	FWD	USDMXN	02/08/2021	(1,010)	20.18694	20,382
2021012803587	FWD	USDMXN	02/09/2021	(6,900,000)	20.18878	139,302,582
2021012803593	FWD	USDMXN	02/09/2021	(56,233)	20.19106	1,135,409
2021012803162	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,000	20.40988	(8,490,512)
2021012803167	FWD	USDMXN	02/26/2021	250	20.37527	(5,093)
2021012803634	FWD	USDMXN	03/03/2021	(32,637)	20.25941	661,200
2021012803461	FWD	USDMXN	03/04/2021	(60,000)	20.24902	1,214,941
2021012803462	FWD	USDMXN	03/09/2021	(60,000)	20.2574	1,215,444
2021012803635	FWD	USDMXN	03/17/2021	(32,345)	20.28894	656,249
2021012803637	FWD	USDMXN	04/14/2021	(46,645)	20.34972	949,222
2021012803643	FWD	USDMXN	04/28/2021	(46,439)	20.38114	946,482
2021012803642	FWD	USDMXN	05/12/2021	(43,036)	20.41255	878,478
2021012803640	FWD	USDMXN	05/28/2021	(46,439)	20.44635	949,510

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012803644	FWD	USDMXN	05/28/2021	46,439	20.45084	(949,718)
2021012903173	FWD	USDMXN	01/29/2021	(200,000,000)	20.1	4,020,000,000
2021012903236	FWD	USDMXN	01/29/2021	100,000,000	20.26	(2,026,000,000)
2021012903238	FWD	USDMXN	01/29/2021	95,000,000	20.26	(1,924,700,000)
2021012903060	FWD	USDMXN	02/02/2021	(49,554,014)	20.18	1,000,000,000
2021012903177	FWD	USDMXN	02/02/2021	(50,000,000)	20.243	1,012,150,000
2021012903237	FWD	USDMXN	02/02/2021	(100,000,000)	20.26925	2,026,925,000
2021012903239	FWD	USDMXN	02/02/2021	(95,000,000)	20.26925	1,925,578,750
2021012903500	FWD	USDMXN	02/02/2021	(1,672,500)	20.38928	34,101,065
2021012903174	FWD	USDMXN	02/02/2021	200,000,000	20.1084	(4,021,680,000)
2021012903061	FWD	USDMXN	02/03/2021	49,548,674	20.18218	(1,000,000,000)
2021012903178	FWD	USDMXN	02/03/2021	50,000,000	20.24523	(1,012,261,250)
2021012903289	FWD	USDMXN	02/08/2021	(232,000)	20.34422	4,719,858
2021012903323	FWD	USDMXN	02/08/2021	(392,000)	20.3777	7,988,060
2021012903364	FWD	USDMXN	02/08/2021	(1,390)	20.38631	28,335
2021012903615	FWD	USDMXN	02/10/2021	(250,000)	20.50442	5,126,105
2021012903614	FWD	USDMXN	02/17/2021	(250,000)	20.51961	5,129,902
2021012903225	FWD	USDMXN	02/19/2021	2,500,000	20.30969	(50,774,228)
2021012903234	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,000	20.29335	(8,442,034)
2021012903328	FWD	USDMXN	02/26/2021	2,000,000	20.31369	(40,627,388)
2021012903519	FWD	USDMXN	02/26/2021	250	20.45677	(5,113)
2021012903571	FWD	USDMXN	02/26/2021	416,000	20.39333	(8,483,627)
2021012903616	FWD	USDMXN	02/26/2021	250	20.51985	(5,130)
2021012903478	FWD	USDMXN	03/04/2021	(50,000)	20.44193	1,022,097
2021012903501	FWD	USDMXN	03/09/2021	1,672,500	20.46797	(34,232,682)
2021012903590	FWD	USDMXN	03/16/2021	1,400,000	20.59784	(28,836,974)
2021012903572	FWD	USDMXN	03/29/2021	(100,000)	20.53143	2,053,143
2021020203009	FWD	USDMXN	02/02/2021	(15,000,000)	20.24	303,600,000
2021020203017	FWD	USDMXN	02/02/2021	3,500,000	20.2	(70,700,000)
2021020203018	FWD	USDMXN	02/03/2021	(3,500,000)	20.2022	70,707,700
2021020203019	FWD	USDMXN	02/03/2021	(2,000,000)	20.2	40,400,000
2021020203067	FWD	USDMXN	02/03/2021	(55,000,000)	20.19	1,110,450,000
2021020203010	FWD	USDMXN	02/04/2021	15,000,000	20.2442	(303,663,000)
2021020203020	FWD	USDMXN	02/04/2021	2,000,000	20.2021	(40,404,200)
2021020203068	FWD	USDMXN	02/04/2021	55,000,000	20.19215	(1,110,568,250)
2021020203027	FWD	USDMXN	02/09/2021	(281,000)	20.18333	5,671,517
2021020203079	FWD	USDMXN	02/09/2021	(460,000)	20.25558	9,317,569
2021020203332	FWD	USDMXN	02/09/2021	(1,553)	20.18627	31,349
2021020203112	FWD	USDMXN	02/26/2021	(70,000)	20.23176	1,416,223
2021020203292	FWD	USDMXN	02/26/2021	(13,500,000)	20.20554	272,774,804
2021020203331	FWD	USDMXN	02/26/2021	(68,050)	20.22396	1,376,236
2021020203255	FWD	USDMXN	03/02/2021	(50,000)	20.23674	1,011,837
2021020203103	FWD	USDMXN	03/05/2021	(40,000)	20.24542	809,817
2021020203468	FWD	USDMXN	03/09/2021	50,000	20.21592	(1,010,796)
2021020203290	FWD	USDMXN	03/11/2021	(280,000)	20.23141	5,664,795
2021020203335	FWD	USDMXN	03/11/2021	(319)	20.2523	6,469
2021020203467	FWD	USDMXN	03/30/2021	50,000	20.26158	(1,013,079)
2021020203291	FWD	USDMXN	04/14/2021	118,026	20.30654	(2,396,696)
2021020303082	FWD	USDMXN	02/03/2021	100,000	20.22618	(2,022,618)
2021020303003	FWD	USDMXN	02/04/2021	(560,000)	20.13405	11,275,065
2021020303045	FWD	USDMXN	02/04/2021	(36,000,000)	20.13	724,680,000
2021020303134	FWD	USDMXN	02/04/2021	(14,700,000)	20.21	297,087,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021020303047	FWD	USDMXN	02/04/2021	36,000,000	20.13	(724,680,000)
2021020303048	FWD	USDMXN	02/05/2021	(36,000,000)	20.13228	724,761,900
2021020303046	FWD	USDMXN	02/05/2021	36,000,000	20.13228	(724,761,900)
2021020303135	FWD	USDMXN	02/05/2021	14,700,000	20.21225	(297,120,075)
2021020303185	FWD	USDMXN	02/10/2021	(247,000)	20.23997	4,999,273
2021020303253	FWD	USDMXN	02/10/2021	(566)	20.228	11,454
2021020303015	FWD	USDMXN	02/16/2021	(50,000)	20.15609	1,007,805
2021020303216	FWD	USDMXN	02/16/2021	50,000	20.22679	(1,011,339)
2021020303017	FWD	USDMXN	02/17/2021	(50,000)	20.15656	1,007,828
2021020303219	FWD	USDMXN	02/17/2021	50,000	20.22544	(1,011,272)
2021020303084	FWD	USDMXN	03/02/2021	(1,667)	20.28606	33,819
2021020303004	FWD	USDMXN	03/02/2021	560,000	20.19216	(11,307,608)
2021020303170	FWD	USDMXN	03/02/2021	518,000	20.24444	(10,486,622)
2021020303472	FWD	USDMXN	03/02/2021	598,000	20.26547	(12,118,752)
2021020303473	FWD	USDMXN	03/02/2021	666	20.28004	(13,506)
2021020303181	FWD	USDMXN	03/03/2021	100,000	20.29178	(2,029,178)
2021020303371	FWD	USDMXN	03/10/2021	(50,000)	20.30186	1,015,093
2021020303227	FWD	USDMXN	03/11/2021	(232,537)	20.28437	4,716,876
2021020303217	FWD	USDMXN	03/16/2021	(50,000)	20.28887	1,014,444
2021020303220	FWD	USDMXN	03/17/2021	(50,000)	20.2875	1,014,375
2021020303229	FWD	USDMXN	03/25/2021	(232,160)	20.31548	4,716,438
2021020303182	FWD	USDMXN	04/06/2021	100,000	20.36671	(2,036,671)
2021020303228	FWD	USDMXN	04/08/2021	(61,616)	20.34635	1,253,667
2021020303230	FWD	USDMXN	04/22/2021	(61,510)	20.37684	1,253,388
2021020303083	FWD	USDMXN	06/15/2021	(100,000)	20.51415	2,051,415
2021020303231	FWD	USDMXN	06/24/2021	(10,852)	20.5154	222,640
2021020303232	FWD	USDMXN	07/08/2021	(55,596)	20.54712	1,142,341
2021020303233	FWD	USDMXN	08/12/2021	(58,791)	20.62614	1,212,626
2021020303234	FWD	USDMXN	08/26/2021	(58,725)	20.65688	1,213,080
2021020303235	FWD	USDMXN	09/09/2021	(53,803)	20.68774	1,113,053
2021020303236	FWD	USDMXN	09/23/2021	(53,714)	20.71925	1,112,922
2021020303237	FWD	USDMXN	10/07/2021	(89,601)	20.75081	1,859,294
2021020303238	FWD	USDMXN	10/21/2021	(89,450)	20.78269	1,859,012
2021020303239	FWD	USDMXN	11/10/2021	(91,359)	20.82777	1,902,814
2021020303240	FWD	USDMXN	11/24/2021	(91,224)	20.85834	1,902,772
2021020303241	FWD	USDMXN	12/09/2021	(70,612)	20.89122	1,475,172
2021020303249	FWD	USDMXN	12/09/2021	(10,074)	20.90122	210,566
2021020303250	FWD	USDMXN	12/23/2021	(80,551)	20.93093	1,686,017
2021020403145	FWD	USDMXN	02/04/2021	(1,500,000)	20.34	30,510,000
2021020403344	FWD	USDMXN	02/04/2021	(300,000)	20.265	6,079,500
2021020403361	FWD	USDMXN	02/04/2021	300,000	20.265	(6,079,500)
2021020403362	FWD	USDMXN	02/04/2021	0	20.55215	(86,145)
2021020403604	FWD	USDMXN	02/08/2021	(1,777,473)	20.38732	36,237,911
2021020403606	FWD	USDMXN	02/08/2021	(1,669,875)	20.38732	34,044,276
2021020403608	FWD	USDMXN	02/08/2021	(2,318,141)	20.38692	47,259,755
2021020403610	FWD	USDMXN	02/08/2021	(1,884,821)	20.38692	38,425,695
2021020403612	FWD	USDMXN	02/08/2021	(1,848,467)	20.3832	37,677,673
2021020403614	FWD	USDMXN	02/08/2021	(2,637,610)	20.38055	53,755,942
2021020403616	FWD	USDMXN	02/08/2021	(2,041,768)	20.38037	41,611,987
2021020403618	FWD	USDMXN	02/08/2021	(1,873,622)	20.38002	38,184,454
2021020403620	FWD	USDMXN	02/08/2021	(1,740,962)	20.38002	35,480,840
2021020403622	FWD	USDMXN	02/08/2021	(2,402,371)	20.37976	48,959,744

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021020403624	FWD	USDMXN	02/08/2021	(4,226,887)	20.37976	86,142,943
2021020403626	FWD	USDMXN	02/08/2021	(2,046,327)	20.37828	41,700,625
2021020403146	FWD	USDMXN	02/09/2021	1,500,000	20.351	(30,526,500)
2021020403147	FWD	USDMXN	02/11/2021	(11,000)	20.48033	225,284
2021020403605	FWD	USDMXN	02/17/2021	1,777,473	20.40877	(36,276,039)
2021020403449	FWD	USDMXN	02/25/2021	(1,189,877)	20.46654	24,352,671
2021020403254	FWD	USDMXN	03/02/2021	558,333	20.51455	(11,453,949)
2021020403160	FWD	USDMXN	03/03/2021	(32,555)	20.42192	664,840
2021020403412	FWD	USDMXN	03/10/2021	(1,000,000)	20.50302	20,503,020
2021020403413	FWD	USDMXN	03/10/2021	(151,000)	20.50222	3,095,835
2021020403457	FWD	USDMXN	03/10/2021	(676)	20.52712	13,875
2021020403432	FWD	USDMXN	03/11/2021	(50,000)	20.49431	1,024,715
2021020403607	FWD	USDMXN	03/17/2021	1,669,875	20.47286	(34,187,124)
2021020403565	FWD	USDMXN	03/24/2021	(50,000)	20.48316	1,024,158
2021020403335	FWD	USDMXN	03/25/2021	(50,000)	20.4982	1,024,910
2021020403337	FWD	USDMXN	03/25/2021	(50,000)	20.49043	1,024,522
2021020403566	FWD	USDMXN	03/25/2021	50,000	20.48628	(1,024,314)
2021020403450	FWD	USDMXN	03/29/2021	(1,000,000)	20.54968	20,549,681
2021020403451	FWD	USDMXN	03/29/2021	(10,123)	20.5396	207,921
2021020403453	FWD	USDMXN	03/29/2021	(2,969)	20.48121	60,801
2021020403161	FWD	USDMXN	03/31/2021	(32,028)	20.48492	656,094
2021020403433	FWD	USDMXN	04/05/2021	(30,000)	20.5554	616,662
2021020403016	FWD	USDMXN	04/06/2021	(30,000)	20.44695	613,408
2021020403162	FWD	USDMXN	04/14/2021	(46,534)	20.51573	954,677
2021020403609	FWD	USDMXN	04/21/2021	2,318,141	20.55253	(47,643,669)
2021020403363	FWD	USDMXN	05/05/2021	(100,000)	20.62627	2,062,627
2021020403163	FWD	USDMXN	05/12/2021	(42,938)	20.57615	883,494
2021020403364	FWD	USDMXN	05/12/2021	(100,000)	20.64176	2,064,176
2021020403365	FWD	USDMXN	05/19/2021	(100,000)	20.65752	2,065,752
2021020403611	FWD	USDMXN	05/19/2021	1,884,821	20.61577	(38,857,042)
2021020403164	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,760)	20.60724	881,165
2021020403366	FWD	USDMXN	05/26/2021	(100,000)	20.67328	2,067,328
2021020403165	FWD	USDMXN	06/09/2021	(56,959)	20.63827	1,175,528
2021020403613	FWD	USDMXN	06/16/2021	1,848,467	20.67545	(38,217,887)
2021020403166	FWD	USDMXN	06/23/2021	(56,879)	20.66929	1,175,642
2021020403615	FWD	USDMXN	07/14/2021	2,637,610	20.73757	(54,697,633)
2021020403617	FWD	USDMXN	08/18/2021	2,041,768	20.81781	(42,505,128)
2021020403619	FWD	USDMXN	09/15/2021	1,873,622	20.88205	(39,125,063)
2021020403621	FWD	USDMXN	10/13/2021	1,740,962	20.94652	(36,467,101)
2021020403623	FWD	USDMXN	11/17/2021	2,402,371	21.02701	(50,514,686)
2021020403188	FWD	USDMXN	11/24/2021	(54,994)	21.06937	1,158,683
2021020403119	FWD	USDMXN	12/06/2021	(59,924)	21.13322	1,266,379
2021020403197	FWD	USDMXN	12/06/2021	59,924	21.11958	(1,265,562)
2021020403198	FWD	USDMXN	12/08/2021	(59,924)	21.12028	1,265,604
2021020403625	FWD	USDMXN	12/15/2021	4,226,887	21.0913	(89,150,525)
2021020403141	FWD	USDMXN	12/20/2021	(59,844)	21.19751	1,268,551
2021020403202	FWD	USDMXN	12/20/2021	59,844	21.14964	(1,265,687)
2021020403203	FWD	USDMXN	12/22/2021	(59,844)	21.15034	1,265,729
2021020403627	FWD	USDMXN	01/19/2022	2,046,327	21.17052	(43,321,796)
2021020503177	FWD	USDMXN	02/09/2021	0	20.1292	6,080
2021020503178	FWD	USDMXN	02/09/2021	(226,680)	19.921	4,515,689
2021020503180	FWD	USDMXN	02/09/2021	0	20.1292	47,195

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021020503179	FWD	USDMXN	02/09/2021	(204,361)	20.14	4,115,833
2021020503183	FWD	USDMXN	02/09/2021	0	20.1292	83,706
2021020503176	FWD	USDMXN	02/09/2021	40,318	20.28	(817,650)
2021020503182	FWD	USDMXN	02/09/2021	0	20.1292	(2,207)
2021020503181	FWD	USDMXN	02/09/2021	30,000	22.9194	(687,582)
2021020503264	FWD	USDMXN	03/02/2021	558,333	20.17045	(11,261,828)
2021020503466	FWD	USDMXN	03/08/2021	200,000	20.19662	(4,039,324)
2021020503565	FWD	USDMXN	03/09/2021	21,950	20.20064	(443,404)
2021020503040	FWD	USDMXN	03/24/2021	(50,000)	20.2846	1,014,230
2021020503475	FWD	USDMXN	03/29/2021	200,000	20.20996	(4,041,993)
2021020503002	FWD	USDMXN	05/14/2021	(300,000)	20.63304	6,189,912
2021020503117	FWD	USDMXN	05/14/2021	300,000	20.37318	(6,111,956)
2021020503003	FWD	USDMXN	06/15/2021	(300,000)	20.7042	6,211,259
2021020503118	FWD	USDMXN	06/15/2021	300,000	20.44506	(6,133,517)
2021020503004	FWD	USDMXN	08/16/2021	(300,000)	20.84496	6,253,488
2021020503119	FWD	USDMXN	08/16/2021	300,000	20.58618	(6,175,853)
2021020803373	FWD	USDMXN	02/09/2021	(16,600,000)	20.08736	333,450,093
2021020803072	FWD	USDMXN	02/10/2021	(558,000)	20.09696	11,214,104
2021020803102	FWD	USDMXN	02/16/2021	(48,000)	20.10328	964,958
2021020803278	FWD	USDMXN	02/16/2021	(930)	20.13519	18,717
2021020803427	FWD	USDMXN	02/23/2021	(50,000)	20.1352	1,006,760
2021020803073	FWD	USDMXN	03/02/2021	558,000	20.14275	(11,239,653)
2021020803098	FWD	USDMXN	03/02/2021	333	20.14286	(6,707)
2021020803374	FWD	USDMXN	03/09/2021	16,600,000	20.1514	(334,513,157)
2021020903058	FWD	USDMXN	02/09/2021	(1,500,000)	20.075	30,112,500
2021020903059	FWD	USDMXN	02/12/2021	1,500,000	20.0813	(30,121,950)
2021020903455	FWD	USDMXN	02/19/2021	(50,000)	20.0963	1,004,815
2021020903096	FWD	USDMXN	03/05/2021	(50,000)	20.13821	1,006,910
2021020903098	FWD	USDMXN	03/11/2021	(20,000)	20.1559	403,118
2021020903343	FWD	USDMXN	03/12/2021	(50,000)	20.18997	1,009,499
2021020903200	FWD	USDMXN	03/30/2021	798,000	20.20719	(16,125,340)
2021020903380	FWD	USDMXN	03/30/2021	626	20.19835	(12,653)
2021020903228	FWD	USDMXN	04/29/2021	10,000,000	20.26592	(202,659,220)
2021020903229	FWD	USDMXN	10/07/2021	5,000,000	20.63474	(103,173,720)
2021021003109	FWD	USDMXN	02/12/2021	(558,333)	20.05065	11,194,940
2021021003100	FWD	USDMXN	02/23/2021	970,000	20.07485	(19,472,607)
2021021003364	FWD	USDMXN	02/23/2021	123	20.05201	(2,466)
2021021003110	FWD	USDMXN	03/02/2021	558,333	20.0913	(11,217,635)
2021021003284	FWD	USDMXN	03/09/2021	27,700	20.09893	(556,740)
2021021003288	FWD	USDMXN	03/16/2021	24,000	20.11348	(482,724)
2021021003365	FWD	USDMXN	03/23/2021	(606)	20.10834	12,186
2021021003095	FWD	USDMXN	03/23/2021	945,000	20.14587	(19,037,846)
2021021003098	FWD	USDMXN	03/23/2021	150,000	20.14295	(3,021,443)
2021021003019	FWD	USDMXN	04/06/2021	(60,000)	20.14278	1,208,567
2021021003287	FWD	USDMXN	04/06/2021	50,000	20.16088	(1,008,044)
2021021003392	FWD	USDMXN	04/08/2021	(62,031)	20.13542	1,249,022
2021021003300	FWD	USDMXN	04/12/2021	200,000	20.16146	(4,032,292)
2021021003391	FWD	USDMXN	06/24/2021	(10,931)	20.30625	221,961
2021021003393	FWD	USDMXN	07/08/2021	(56,021)	20.3386	1,139,395
2021021003394	FWD	USDMXN	07/22/2021	(55,940)	20.37056	1,139,538
2021021003395	FWD	USDMXN	08/26/2021	(59,109)	20.45001	1,208,779
2021021003396	FWD	USDMXN	09/09/2021	(54,151)	20.48175	1,109,107

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021021003397	FWD	USDMXN	10/07/2021	(90,210)	20.54581	1,853,443
2021021003398	FWD	USDMXN	10/21/2021	(90,092)	20.57787	1,853,904
2021021003399	FWD	USDMXN	11/10/2021	(92,005)	20.62366	1,897,481
2021021003400	FWD	USDMXN	11/24/2021	(91,872)	20.6551	1,897,618
2021021003401	FWD	USDMXN	12/23/2021	(81,243)	20.7201	1,683,354
2021021103194	FWD	USDMXN	02/11/2021	(10,000,000)	19.95	199,500,000
2021021103341	FWD	USDMXN	02/12/2021	(4,000,000)	19.95352	79,814,087
2021021103195	FWD	USDMXN	02/12/2021	10,000,000	19.95222	(199,522,200)
2021021103569	FWD	USDMXN	02/16/2021	(558,333)	19.94474	11,135,807
2021021103113	FWD	USDMXN	02/22/2021	(646,000)	19.93444	12,877,649
2021021103202	FWD	USDMXN	02/22/2021	(280)	19.97071	5,585
2021021103131	FWD	USDMXN	02/24/2021	250,000	19.94457	(4,986,144)
2021021103104	FWD	USDMXN	02/26/2021	30,000	19.95581	(598,674)
2021021103380	FWD	USDMXN	03/01/2021	62,000	19.99353	(1,239,600)
2021021103570	FWD	USDMXN	03/02/2021	558,333	19.97612	(11,153,325)
2021021103133	FWD	USDMXN	03/03/2021	250,000	19.96071	(4,990,177)
2021021103132	FWD	USDMXN	03/10/2021	250,000	19.97678	(4,994,194)
2021021103550	FWD	USDMXN	03/12/2021	500,000	19.98574	(9,992,870)
2021021103435	FWD	USDMXN	03/16/2021	34,713	20.01213	(694,679)
2021021103436	FWD	USDMXN	03/23/2021	17,855	20.02756	(357,600)
2021021103369	FWD	USDMXN	03/31/2021	(32,686)	20.06019	655,685
2021021103370	FWD	USDMXN	04/28/2021	(47,249)	20.12253	950,766
2021021103198	FWD	USDMXN	06/04/2021	250,000	20.21978	(5,054,946)
2021021103199	FWD	USDMXN	06/11/2021	250,000	20.23534	(5,058,834)
2021021103200	FWD	USDMXN	06/18/2021	250,000	20.251	(5,062,751)
2021021103201	FWD	USDMXN	06/25/2021	250,000	20.26696	(5,066,739)
2021021103286	FWD	USDMXN	07/12/2021	306,000	20.29315	(6,209,705)
2021021103287	FWD	USDMXN	07/13/2021	94,000	20.29545	(1,907,772)
2021021103288	FWD	USDMXN	07/16/2021	95,000	20.30235	(1,928,723)
2021021103289	FWD	USDMXN	07/23/2021	233,000	20.31823	(4,734,148)
2021021103342	FWD	USDMXN	08/16/2021	4,000,000	20.3729	(81,491,584)
2021021103371	FWD	USDMXN	09/01/2021	(46,549)	20.40303	949,742
2021021103372	FWD	USDMXN	09/15/2021	(79,117)	20.43464	1,616,718
2021021103373	FWD	USDMXN	09/29/2021	(79,039)	20.46674	1,617,673
2021021103374	FWD	USDMXN	10/13/2021	(70,377)	20.49891	1,442,645
2021021103375	FWD	USDMXN	10/27/2021	(70,219)	20.53104	1,441,669
2021021103376	FWD	USDMXN	11/10/2021	(56,323)	20.56315	1,158,172
2021021103377	FWD	USDMXN	11/24/2021	(56,253)	20.59474	1,158,506
2021021103555	FWD	USDMXN	11/24/2021	(10)	20.54697	205
2021021103378	FWD	USDMXN	12/08/2021	(61,420)	20.62596	1,266,848
2021021103379	FWD	USDMXN	12/22/2021	(60,770)	20.65732	1,255,337
2021021103381	FWD	USDMXN	12/22/2021	(561)	20.64375	11,586
2021021203043	FWD	USDMXN	02/12/2021	(1,500,000)	20.06	30,090,000
2021021203091	FWD	USDMXN	02/12/2021	(15)	20	298
2021021203111	FWD	USDMXN	02/12/2021	(14,900,000)	20	298,000,000
2021021203041	FWD	USDMXN	02/16/2021	(15,000,000)	20.065	300,975,000
2021021203583	FWD	USDMXN	02/16/2021	(500,000)	19.9712	9,985,600
2021021203092	FWD	USDMXN	02/16/2021	15	20.0082	(298)
2021021203112	FWD	USDMXN	02/16/2021	14,900,000	20.0082	(298,122,180)
2021021203368	FWD	USDMXN	02/16/2021	3,500,000	19.95935	(69,857,725)
2021021203042	FWD	USDMXN	02/17/2021	15,000,000	20.067	(301,005,000)
2021021203044	FWD	USDMXN	02/18/2021	1,500,000	20.0718	(30,107,700)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021021203122	FWD	USDMXN	03/02/2021	500,000	20.06537	(10,032,686)
2021021203123	FWD	USDMXN	03/02/2021	58,333	19.99282	(1,166,241)
2021021203262	FWD	USDMXN	03/02/2021	550,000	19.93616	(10,964,890)
2021021203501	FWD	USDMXN	03/02/2021	8,333	19.9969	(166,634)
2021021203369	FWD	USDMXN	03/09/2021	(3,500,000)	20.00223	70,007,812
2021021203584	FWD	USDMXN	03/16/2021	500,000	20.03205	(10,016,026)
2021021203536	FWD	USDMXN	03/17/2021	106,749	20.0171	(2,136,806)
2021021203033	FWD	USDMXN	03/18/2021	(50,000)	20.10489	1,005,245
2021021203161	FWD	USDMXN	04/05/2021	(50,000)	20.04158	1,002,079
2021021203598	FWD	USDMXN	04/06/2021	6,500,000	20.06002	(130,390,150)
2021021203365	FWD	USDMXN	04/13/2021	(1,000,000)	20.07734	20,077,344
2021021203366	FWD	USDMXN	04/13/2021	(287,155)	20.08157	5,766,523
2021021203447	FWD	USDMXN	04/15/2021	500,000	20.05452	(10,027,262)
2021021203535	FWD	USDMXN	04/21/2021	109,315	20.091	(2,196,247)
2021021203391	FWD	USDMXN	04/26/2021	7,215,366	20.09034	(144,959,178)
2021021203537	FWD	USDMXN	05/19/2021	109,803	20.15002	(2,212,532)
2021021203538	FWD	USDMXN	06/16/2021	111,170	20.21257	(2,247,031)
2021021203539	FWD	USDMXN	07/14/2021	111,607	20.27469	(2,262,797)
2021021203540	FWD	USDMXN	08/18/2021	112,974	20.35245	(2,299,298)
2021021203542	FWD	USDMXN	09/15/2021	113,207	20.41389	(2,310,995)
2021021203541	FWD	USDMXN	10/13/2021	86,903	20.47458	(1,779,303)
2021021203543	FWD	USDMXN	11/17/2021	86,342	20.55089	(1,774,405)
2021021203544	FWD	USDMXN	12/15/2021	114,883	20.61303	(2,368,087)
2021021203545	FWD	USDMXN	01/19/2022	114,918	20.69017	(2,377,673)
2021021503346	FWD	USDMXN	03/31/2021	80,000	20.04007	(1,603,205)
2021021503347	FWD	USDMXN	03/31/2021	100,000	20.04007	(2,004,007)
2021021503153	FWD	USDMXN	07/19/2021	200,000	20.22432	(4,044,865)
2021021503154	FWD	USDMXN	08/11/2021	150,000	20.27558	(3,041,337)
2021021503155	FWD	USDMXN	09/15/2021	200,000	20.3523	(4,070,460)
2021021503156	FWD	USDMXN	10/06/2021	150,000	20.39769	(3,059,653)
2021021503157	FWD	USDMXN	11/03/2021	150,000	20.45843	(3,068,765)
2021021503158	FWD	USDMXN	12/06/2021	150,000	20.53098	(3,079,647)
2021021603010	FWD	USDMXN	02/16/2021	(14,800,000)	20.13	297,924,000
2021021603212	FWD	USDMXN	02/16/2021	(10,000,000)	20.18	201,800,000
2021021603577	FWD	USDMXN	02/17/2021	(15,000,000)	20.1549	302,323,559
2021021603011	FWD	USDMXN	02/17/2021	14,800,000	20.13202	(297,953,896)
2021021603213	FWD	USDMXN	02/17/2021	10,000,000	20.18235	(201,823,500)
2021021603516	FWD	USDMXN	02/18/2021	250,000	20.16865	(5,042,163)
2021021603519	FWD	USDMXN	02/18/2021	250,000	20.16865	(5,042,163)
2021021603521	FWD	USDMXN	02/18/2021	250,000	20.16865	(5,042,163)
2021021603578	FWD	USDMXN	02/18/2021	15,000,000	20.1573	(302,359,500)
2021021603124	FWD	USDMXN	02/23/2021	(50,000)	20.17139	1,008,569
2021021603016	FWD	USDMXN	02/24/2021	(50,000)	20.18286	1,009,143
2021021603125	FWD	USDMXN	02/24/2021	(50,000)	20.17333	1,008,666
2021021603517	FWD	USDMXN	02/24/2021	(250,000)	20.18125	5,045,312
2021021603145	FWD	USDMXN	02/26/2021	(454,000)	20.24395	9,190,754
2021021603079	FWD	USDMXN	03/03/2021	(50,000)	20.25935	1,012,967
2021021603520	FWD	USDMXN	03/03/2021	(250,000)	20.19635	5,049,088
2021021603121	FWD	USDMXN	03/05/2021	(50,000)	20.19107	1,009,553
2021021603080	FWD	USDMXN	03/10/2021	(30,000)	20.26544	607,963
2021021603522	FWD	USDMXN	03/10/2021	(250,000)	20.21154	5,052,885
2021021603112	FWD	USDMXN	03/11/2021	(50,000)	20.2063	1,010,315

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021021603114	FWD	USDMXN	03/11/2021	20,000	20.20632	(404,126)
2021021603551	FWD	USDMXN	03/16/2021	41,600	20.22891	(841,522)
2021021603113	FWD	USDMXN	03/19/2021	(30,000)	20.2162	606,486
2021021603243	FWD	USDMXN	03/30/2021	(50,000)	20.31162	1,015,581
2021021603005	FWD	USDMXN	03/31/2021	378,333	20.03752	(7,580,855)
2021021603350	FWD	USDMXN	03/31/2021	558,333	20.30117	(11,334,812)
2021021703290	FWD	USDMXN	02/17/2021	(25,000,000)	20.18	504,500,000
2021021703500	FWD	USDMXN	02/18/2021	(20,000,000)	20.21	404,200,000
2021021703291	FWD	USDMXN	02/18/2021	25,000,000	20.18225	(504,556,250)
2021021703501	FWD	USDMXN	02/19/2021	20,000,000	20.21215	(404,243,000)
2021021703246	FWD	USDMXN	02/24/2021	(200,000)	20.36359	4,072,718
2021021703450	FWD	USDMXN	02/24/2021	(233,000)	20.21044	4,709,032
2021021703451	FWD	USDMXN	02/24/2021	(87,000)	20.21842	1,759,003
2021021703575	FWD	USDMXN	02/24/2021	(325,000)	20.23532	6,576,479
2021021703586	FWD	USDMXN	02/24/2021	(49,617)	20.23745	1,004,117
2021021703412	FWD	USDMXN	02/26/2021	(260,000)	20.27998	5,272,794
2021021703047	FWD	USDMXN	03/10/2021	85,000	20.35007	(1,729,756)
2021021703248	FWD	USDMXN	03/10/2021	733	20.23794	(14,826)
2021021703292	FWD	USDMXN	03/31/2021	558,333	20.26345	(11,313,754)
2021021703459	FWD	USDMXN	04/08/2021	(61,744)	20.30274	1,253,568
2021021703049	FWD	USDMXN	04/13/2021	116,000	20.4304	(2,369,926)
2021021703249	FWD	USDMXN	04/13/2021	570	20.31254	(11,578)
2021021703177	FWD	USDMXN	04/16/2021	(14,000)	20.34148	284,781
2021021703054	FWD	USDMXN	05/11/2021	49,000	20.49327	(1,004,170)
2021021703250	FWD	USDMXN	05/11/2021	831	20.37163	(16,928)
2021021703057	FWD	USDMXN	05/13/2021	101,000	20.47459	(2,067,934)
2021021703251	FWD	USDMXN	05/13/2021	63	20.37191	(1,293)
2021021703060	FWD	USDMXN	06/15/2021	35,000	20.54653	(719,129)
2021021703252	FWD	USDMXN	06/15/2021	66	20.44575	(1,353)
2021021703063	FWD	USDMXN	07/07/2021	110,000	20.56773	(2,262,451)
2021021703253	FWD	USDMXN	07/07/2021	392	20.49473	(8,039)
2021021703460	FWD	USDMXN	07/08/2021	(55,778)	20.49469	1,143,152
2021021703066	FWD	USDMXN	07/14/2021	70,000	20.59203	(1,441,442)
2021021703254	FWD	USDMXN	07/14/2021	743	20.50609	(15,239)
2021021703461	FWD	USDMXN	07/22/2021	(55,688)	20.52473	1,142,986
2021021703462	FWD	USDMXN	08/26/2021	(58,868)	20.60056	1,212,710
2021021703470	FWD	USDMXN	09/09/2021	(53,928)	20.63173	1,112,623
2021021703471	FWD	USDMXN	10/07/2021	(89,731)	20.69479	1,856,962
2021021703472	FWD	USDMXN	10/21/2021	(89,631)	20.72646	1,857,740
2021021703473	FWD	USDMXN	11/10/2021	(91,500)	20.77157	1,900,603
2021021703424	FWD	USDMXN	11/24/2021	(91,390)	20.80103	1,901,010
2021021703474	FWD	USDMXN	12/09/2021	(80,888)	20.83466	1,685,269
2021021703475	FWD	USDMXN	12/23/2021	(72,244)	20.86468	1,507,353
2021021703479	FWD	USDMXN	12/23/2021	(8,550)	20.88096	178,542
2021021803014	FWD	USDMXN	02/18/2021	(20,000,000)	20.27	405,400,000
2021021803047	FWD	USDMXN	02/18/2021	(5,000,000)	20.33014	101,650,675
2021021803100	FWD	USDMXN	02/18/2021	(1,500,000)	20.335	30,502,500
2021021803015	FWD	USDMXN	02/19/2021	20,000,000	20.2721	(405,442,000)
2021021803101	FWD	USDMXN	02/19/2021	1,500,000	20.337	(30,505,500)
2021021803443	FWD	USDMXN	02/22/2021	4,657,768	20.3695	(94,876,397)
2021021803698	FWD	USDMXN	02/22/2021	6,400,000	20.3118	(129,995,520)
2021021803210	FWD	USDMXN	02/25/2021	(200,000)	20.45142	4,090,285

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021021803224	FWD	USDMXN	02/25/2021	(425,000)	20.43818	8,686,226
2021021803260	FWD	USDMXN	02/25/2021	(120,000)	20.43494	2,452,193
2021021803617	FWD	USDMXN	02/25/2021	4,000,000	20.35995	(81,439,792)
2021021803621	FWD	USDMXN	02/25/2021	2,198,474	20.34226	(44,721,924)
2021021803606	FWD	USDMXN	02/26/2021	(86,000)	20.35243	1,750,309
2021021803626	FWD	USDMXN	02/26/2021	(120,000)	20.3381	2,440,571
2021021803645	FWD	USDMXN	02/26/2021	(42,000)	20.3479	854,612
2021021803663	FWD	USDMXN	02/26/2021	(818)	20.32914	16,637
2021021803053	FWD	USDMXN	03/03/2021	(221,000)	20.3617	4,499,937
2021021803571	FWD	USDMXN	03/03/2021	(141)	20.37279	2,874
2021021803653	FWD	USDMXN	03/04/2021	(100,000)	20.39315	2,039,315
2021021803601	FWD	USDMXN	03/10/2021	103,245	20.37911	(2,104,042)
2021021803618	FWD	USDMXN	03/11/2021	(3,000,000)	20.45546	61,366,365
2021021803622	FWD	USDMXN	03/11/2021	(2,198,474)	20.37177	44,786,796
2021021803699	FWD	USDMXN	03/11/2021	(6,400,000)	20.34793	130,226,765
2021021803444	FWD	USDMXN	03/30/2021	(4,657,768)	20.4468	95,236,451
2021021803247	FWD	USDMXN	03/31/2021	(31,952)	20.52303	655,747
2021021803285	FWD	USDMXN	03/31/2021	558,000	20.48348	(11,429,781)
2021021803526	FWD	USDMXN	03/31/2021	558,000	20.44971	(11,410,941)
2021021803572	FWD	USDMXN	03/31/2021	666	20.43919	(13,612)
2021021803246	FWD	USDMXN	04/14/2021	(46,407)	20.55318	953,814
2021021803330	FWD	USDMXN	04/14/2021	817,715	20.54162	(16,797,195)
2021021803331	FWD	USDMXN	04/14/2021	15,226	20.52159	(312,471)
2021021803157	FWD	USDMXN	04/22/2021	(100,000)	20.48674	2,048,674
2021021803640	FWD	USDMXN	04/23/2021	(70,000)	20.46087	1,432,261
2021021803248	FWD	USDMXN	04/28/2021	(46,222)	20.58257	951,377
2021021803575	FWD	USDMXN	04/28/2021	(24)	20.49131	498
2021021803360	FWD	USDMXN	05/14/2021	(300,000)	20.60512	6,181,536
2021021803329	FWD	USDMXN	05/17/2021	2,682,285	20.61079	(55,284,003)
2021021803234	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,658)	20.63185	880,122
2021021803362	FWD	USDMXN	06/15/2021	(300,000)	20.67071	6,201,212
2021021803361	FWD	USDMXN	08/16/2021	(300,000)	20.80692	6,242,076
2021021803510	FWD	USDMXN	08/18/2021	(45,728)	20.76148	949,382
2021021803512	FWD	USDMXN	09/01/2021	(45,665)	20.79273	949,510
2021021803511	FWD	USDMXN	09/15/2021	(77,638)	20.82445	1,616,779
2021021803513	FWD	USDMXN	09/29/2021	(77,519)	20.85638	1,616,773
2021021803514	FWD	USDMXN	10/13/2021	(69,072)	20.88851	1,442,807
2021021803452	FWD	USDMXN	10/27/2021	(68,976)	20.90233	1,441,757
2021021803515	FWD	USDMXN	11/10/2021	(55,322)	20.9527	1,159,146
2021021803518	FWD	USDMXN	11/24/2021	(55,232)	20.9846	1,159,029
2021021803517	FWD	USDMXN	12/08/2021	(60,303)	21.01551	1,267,299
2021021803516	FWD	USDMXN	12/22/2021	(53,519)	21.04641	1,126,391
2021021803521	FWD	USDMXN	12/22/2021	(6,689)	21.02814	140,659
2021021903328	FWD	USDMXN	02/19/2021	(100,000,000)	20.485	2,048,500,000
2021021903353	FWD	USDMXN	02/19/2021	(65,000,000)	20.51	1,333,150,000
2021021903380	FWD	USDMXN	02/19/2021	150,000,000	20.52	(3,078,000,000)
2021021903382	FWD	USDMXN	02/19/2021	500,000	20.5	(10,250,000)
2021021903170	FWD	USDMXN	02/22/2021	(15,000,000)	20.371	305,565,000
2021021903381	FWD	USDMXN	02/22/2021	(150,000,000)	20.5269	3,079,035,000
2021021903383	FWD	USDMXN	02/22/2021	(500,000)	20.5069	10,253,450
2021021903329	FWD	USDMXN	02/22/2021	100,000,000	20.4916	(2,049,160,000)
2021021903354	FWD	USDMXN	02/22/2021	65,000,000	20.5168	(1,333,592,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021021903393	FWD	USDMXN	02/23/2021	(558,333)	20.51427	11,453,794
2021021903171	FWD	USDMXN	02/23/2021	15,000,000	20.3732	(305,598,000)
2021021903402	FWD	USDMXN	02/23/2021	200,000	20.51889	(4,103,778)
2021021903019	FWD	USDMXN	02/26/2021	(156,000)	20.39373	3,181,422
2021021903021	FWD	USDMXN	02/26/2021	(47,000)	20.39812	958,712
2021021903046	FWD	USDMXN	02/26/2021	(81,000)	20.43617	1,655,329
2021021903087	FWD	USDMXN	02/26/2021	(36,000)	20.41009	734,763
2021021903429	FWD	USDMXN	02/26/2021	(1,505)	20.50589	30,854
2021021903094	FWD	USDMXN	03/01/2021	(11,000)	20.39615	224,358
2021021903187	FWD	USDMXN	03/01/2021	(143,000)	20.37854	2,914,131
2021021903288	FWD	USDMXN	03/01/2021	(209,000)	20.45495	4,275,085
2021021903293	FWD	USDMXN	03/01/2021	(14,000)	20.46615	286,526
2021021903350	FWD	USDMXN	03/01/2021	(230,000)	20.4914	4,713,022
2021021903432	FWD	USDMXN	03/01/2021	(8,497)	20.51227	174,289
2021021903497	FWD	USDMXN	03/01/2021	(86,000)	20.51705	1,764,466
2021021903513	FWD	USDMXN	03/01/2021	(881)	20.51316	18,081
2021021903403	FWD	USDMXN	03/08/2021	(200,000)	20.54618	4,109,236
2021021903433	FWD	USDMXN	03/11/2021	(35)	20.53393	718
2021021903587	FWD	USDMXN	03/18/2021	(60,000)	20.50972	1,230,583
2021021903588	FWD	USDMXN	03/19/2021	(50,000)	20.50887	1,025,443
2021021903153	FWD	USDMXN	03/23/2021	(25,000)	20.4271	510,678
2021021903394	FWD	USDMXN	03/31/2021	558,333	20.59385	(11,498,227)
2021021903477	FWD	USDMXN	04/07/2021	(100,000)	20.59515	2,059,515
2021021903478	FWD	USDMXN	04/14/2021	(100,000)	20.61039	2,061,039
2021021903479	FWD	USDMXN	04/21/2021	(100,000)	20.62562	2,062,562
2021021903480	FWD	USDMXN	04/28/2021	(100,000)	20.64032	2,064,032
2021021903445	FWD	USDMXN	04/28/2021	24	20.63959	(502)
2021021903169	FWD	USDMXN	04/30/2021	(29,000)	20.50461	594,634
2021021903003	FWD	USDMXN	07/21/2021	(90,000)	20.76157	1,868,542
2021021903443	FWD	USDMXN	07/21/2021	(1,924)	20.81198	40,032
2021021903509	FWD	USDMXN	02/04/2022	(32,813)	21.23766	696,861
2021021903511	FWD	USDMXN	02/11/2022	(32,813)	21.25318	697,370
2021021903512	FWD	USDMXN	02/18/2022	(32,813)	21.2687	697,880
2021021903510	FWD	USDMXN	02/25/2022	(32,813)	21.28445	698,396
2021022203042	FWD	USDMXN	02/22/2021	(10,000,000)	20.71	207,100,000
2021022203053	FWD	USDMXN	02/22/2021	(5,000,000)	20.71	103,550,000
2021022203202	FWD	USDMXN	02/22/2021	(41,126,379)	20.668	850,000,000
2021022203247	FWD	USDMXN	02/22/2021	(55,690,073)	20.65	1,150,000,000
2021022203463	FWD	USDMXN	02/22/2021	(2,500,000)	20.745	51,862,500
2021022203270	FWD	USDMXN	02/22/2021	100,000,000	20.8	(2,080,000,000)
2021022203271	FWD	USDMXN	02/23/2021	(100,000,000)	20.8023	2,080,230,000
2021022203043	FWD	USDMXN	02/23/2021	10,000,000	20.71235	(207,123,500)
2021022203054	FWD	USDMXN	02/23/2021	5,000,000	20.71235	(103,561,750)
2021022203203	FWD	USDMXN	02/23/2021	41,122,002	20.6702	(850,000,000)
2021022203248	FWD	USDMXN	02/23/2021	55,684,140	20.6522	(1,150,000,000)
2021022203464	FWD	USDMXN	02/23/2021	2,500,000	20.7471	(51,867,750)
2021022203320	FWD	USDMXN	02/24/2021	200,000	20.64962	(4,129,924)
2021022203080	FWD	USDMXN	03/01/2021	(140,000)	20.73842	2,903,379
2021022203113	FWD	USDMXN	03/01/2021	(6,681)	20.76022	138,707
2021022203191	FWD	USDMXN	03/02/2021	(241,000)	20.65621	4,978,147
2021022203351	FWD	USDMXN	03/02/2021	(51,011)	20.65397	1,053,581
2021022203414	FWD	USDMXN	03/02/2021	(50,000)	20.77027	1,038,513

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021022203110	FWD	USDMXN	03/03/2021	(300,000)	20.66733	6,200,200
2021022203364	FWD	USDMXN	03/12/2021	(500,000)	20.70459	10,352,297
2021022203063	FWD	USDMXN	03/25/2021	(50,000)	20.85246	1,042,623
2021022203335	FWD	USDMXN	03/31/2021	558,000	20.7467	(11,576,661)
2021022203348	FWD	USDMXN	03/31/2021	333	20.7245	(6,901)
2021022203321	FWD	USDMXN	04/12/2021	(200,000)	20.7512	4,150,241
2021022203064	FWD	USDMXN	04/28/2021	(50,000)	20.92768	1,046,384
2021022203065	FWD	USDMXN	05/26/2021	(50,000)	20.98708	1,049,354
2021022203066	FWD	USDMXN	06/29/2021	(50,000)	21.06054	1,053,027
2021022203067	FWD	USDMXN	07/28/2021	(50,000)	21.12593	1,056,296
2021022203068	FWD	USDMXN	08/19/2021	(50,000)	21.17471	1,058,736
2021022203049	FWD	USDMXN	09/27/2021	(300,000)	21.02749	6,308,248
2021022203069	FWD	USDMXN	09/28/2021	(50,000)	21.26692	1,063,346
2021022203051	FWD	USDMXN	10/25/2021	(300,000)	21.09258	6,327,775
2021022203050	FWD	USDMXN	11/24/2021	(300,000)	21.16196	6,348,588
2021022303071	FWD	USDMXN	02/23/2021	(15,000,000)	20.56	308,400,000
2021022303204	FWD	USDMXN	02/23/2021	(3,000,000)	20.57	61,710,000
2021022303427	FWD	USDMXN	02/23/2021	(10,000,000)	20.54	205,400,000
2021022303072	FWD	USDMXN	02/24/2021	15,000,000	20.56235	(308,435,250)
2021022303428	FWD	USDMXN	02/24/2021	10,000,000	20.54235	(205,423,500)
2021022303205	FWD	USDMXN	02/26/2021	3,000,000	20.5764	(61,729,200)
2021022303015	FWD	USDMXN	03/02/2021	(210)	20.68818	4,337
2021022303041	FWD	USDMXN	03/02/2021	(126,000)	20.69591	2,607,685
2021022303187	FWD	USDMXN	03/02/2021	(646)	20.5776	13,303
2021022303220	FWD	USDMXN	03/02/2021	(108,000)	20.58939	2,223,654
2021022303249	FWD	USDMXN	03/02/2021	(981)	20.62425	20,235
2021022303255	FWD	USDMXN	03/03/2021	(157,000)	20.62778	3,238,562
2021022303295	FWD	USDMXN	03/03/2021	(968)	20.58118	19,919
2021022303460	FWD	USDMXN	03/03/2021	(50,000)	20.52837	1,026,418
2021022303463	FWD	USDMXN	03/03/2021	(2,832)	20.53786	58,173
2021022303452	FWD	USDMXN	03/23/2021	58,500	20.6022	(1,205,229)
2021022303093	FWD	USDMXN	03/31/2021	(60,000)	20.61541	1,236,924
2021022303181	FWD	USDMXN	03/31/2021	558,000	20.68468	(11,542,052)
2021022303188	FWD	USDMXN	03/31/2021	333	20.65032	(6,876)
2021022303304	FWD	USDMXN	03/31/2021	558,000	20.63052	(11,511,828)
2021022303305	FWD	USDMXN	03/31/2021	333	20.63898	(6,872)
2021022303453	FWD	USDMXN	04/13/2021	44,000	20.64702	(908,469)
2021022303102	FWD	USDMXN	04/16/2021	(60,000)	20.64587	1,238,752
2021022303454	FWD	USDMXN	04/20/2021	24,000	20.66216	(495,892)
2021022303103	FWD	USDMXN	04/22/2021	(30,000)	20.65891	619,767
2021022303263	FWD	USDMXN	05/28/2021	2,565,976	20.80021	(53,372,829)
2021022303446	FWD	USDMXN	05/28/2021	450,000	20.73362	(9,330,127)
2021022403005	FWD	USDMXN	02/24/2021	(25,000,000)	20.41	510,250,000
2021022403014	FWD	USDMXN	02/24/2021	(48,887,802)	20.455	1,000,000,000
2021022403414	FWD	USDMXN	02/24/2021	50,000,000	20.55	(1,027,500,000)
2021022403415	FWD	USDMXN	02/25/2021	(50,000,000)	20.5523	1,027,615,000
2021022403006	FWD	USDMXN	02/25/2021	25,000,000	20.41235	(510,308,750)
2021022403015	FWD	USDMXN	02/25/2021	48,882,485	20.45723	(1,000,000,000)
2021022403035	FWD	USDMXN	03/03/2021	(12,800)	20.47038	262,021
2021022403036	FWD	USDMXN	03/03/2021	(115,200)	20.47378	2,358,579
2021022403149	FWD	USDMXN	03/03/2021	(992)	20.53861	20,379
2021022403276	FWD	USDMXN	03/04/2021	(110,503)	20.46481	2,261,425

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021022403443	FWD	USDMXN	03/05/2021	(217,000)	20.44494	4,436,552
2021022403444	FWD	USDMXN	03/05/2021	(32)	20.44138	663
2021022403446	FWD	USDMXN	03/05/2021	(171,000)	20.43863	3,495,005
2021022403451	FWD	USDMXN	03/05/2021	(737)	20.4331	15,055
2021022403453	FWD	USDMXN	03/05/2021	(100,000)	20.43332	2,043,332
2021022403461	FWD	USDMXN	03/05/2021	(3,478)	20.4232	71,025
2021022403633	FWD	USDMXN	03/30/2021	42,600	20.45265	(871,283)
2021022403615	FWD	USDMXN	04/09/2021	(40,000)	20.46313	818,525
2021022403616	FWD	USDMXN	04/13/2021	(25,000)	20.46955	511,739
2021022403159	FWD	USDMXN	04/22/2021	(87,777)	20.63319	1,811,130
2021022403421	FWD	USDMXN	05/04/2021	100,000	20.56455	(2,056,456)
2021022403422	FWD	USDMXN	05/28/2021	100,000	20.61539	(2,061,539)
2021022403423	FWD	USDMXN	06/01/2021	100,000	20.62362	(2,062,362)
2021022403160	FWD	USDMXN	06/10/2021	(40,399)	20.73634	837,731
2021022403161	FWD	USDMXN	07/08/2021	(80,574)	20.79639	1,675,646
2021022403162	FWD	USDMXN	08/26/2021	(81,918)	20.90434	1,712,434
2021022403163	FWD	USDMXN	09/09/2021	(65,554)	20.93576	1,372,425
2021022403164	FWD	USDMXN	10/07/2021	(95,950)	20.99976	2,014,924
2021022403165	FWD	USDMXN	10/21/2021	(95,790)	21.03214	2,014,669
2021022403166	FWD	USDMXN	11/10/2021	(86,372)	21.07829	1,820,572
2021022403167	FWD	USDMXN	11/24/2021	(86,159)	21.11055	1,818,870
2021022403168	FWD	USDMXN	12/09/2021	(85,939)	21.14457	1,817,133
2021022403169	FWD	USDMXN	12/23/2021	(85,817)	21.17597	1,817,255
2021022503007	FWD	USDMXN	02/25/2021	(40,000,000)	20.68	827,200,000
2021022503690	FWD	USDMXN	02/25/2021	(20,000,000)	20.82	416,400,000
2021022503009	FWD	USDMXN	02/26/2021	(30,000,000)	20.68	620,400,000
2021022503008	FWD	USDMXN	02/26/2021	40,000,000	20.68229	(827,291,600)
2021022503691	FWD	USDMXN	02/26/2021	20,000,000	20.82245	(416,449,000)
2021022503010	FWD	USDMXN	03/01/2021	30,000,000	20.6866	(620,598,000)
2021022503034	FWD	USDMXN	03/04/2021	(629,000)	20.67483	13,004,471
2021022503575	FWD	USDMXN	03/04/2021	8	20.8874	(174)
2021022503035	FWD	USDMXN	03/05/2021	(250,000)	20.66845	5,167,111
2021022503558	FWD	USDMXN	03/05/2021	8,045	20.87689	(167,955)
2021022503036	FWD	USDMXN	03/08/2021	(500,000)	20.67708	10,338,539
2021022503421	FWD	USDMXN	03/08/2021	(286,970)	20.86955	5,988,927
2021022503029	FWD	USDMXN	03/09/2021	(50,000)	20.65337	1,032,669
2021022503031	FWD	USDMXN	03/09/2021	(55,000)	20.66043	1,136,324
2021022503037	FWD	USDMXN	03/09/2021	(130,000)	20.67305	2,687,497
2021022503110	FWD	USDMXN	03/09/2021	(50,000)	20.8404	1,042,020
2021022503313	FWD	USDMXN	03/09/2021	(50,000)	20.91378	1,045,689
2021022503314	FWD	USDMXN	03/09/2021	(5,700)	20.91448	119,213
2021022503475	FWD	USDMXN	03/09/2021	(65,856)	20.91625	1,377,454
2021022503501	FWD	USDMXN	03/10/2021	(633,000)	21.02509	13,308,881
2021022503579	FWD	USDMXN	03/10/2021	(30,000)	20.88707	626,612
2021022503721	FWD	USDMXN	03/10/2021	(34,000)	20.91866	711,234
2021022503744	FWD	USDMXN	03/10/2021	(831)	20.97913	17,428
2021022503560	FWD	USDMXN	03/10/2021	3,132	20.87535	(65,389)
2021022503658	FWD	USDMXN	03/10/2021	171	20.7832	(3,552)
2021022503360	FWD	USDMXN	03/12/2021	(11,000)	20.88658	229,752
2021022503767	FWD	USDMXN	03/31/2021	(100,000)	21.06759	2,106,760
2021022503479	FWD	USDMXN	04/05/2021	(588)	20.9748	12,324
2021022503042	FWD	USDMXN	04/05/2021	550,000	20.75731	(11,416,522)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021022503480	FWD	USDMXN	04/06/2021	(641)	20.98698	13,448
2021022503043	FWD	USDMXN	04/06/2021	40,000	20.76729	(830,692)
2021022503039	FWD	USDMXN	04/07/2021	330,000	20.7524	(6,848,292)
2021022503564	FWD	USDMXN	04/07/2021	211	20.93136	(4,416)
2021022503484	FWD	USDMXN	04/08/2021	(658)	20.92411	13,763
2021022503044	FWD	USDMXN	04/08/2021	40,000	20.77338	(830,935)
2021022503047	FWD	USDMXN	04/14/2021	60,000	20.78495	(1,247,097)
2021022503565	FWD	USDMXN	04/14/2021	6,365	20.94802	(133,340)
2021022503485	FWD	USDMXN	04/15/2021	(658)	20.93903	13,774
2021022503571	FWD	USDMXN	04/15/2021	(43)	20.97446	912
2021022503049	FWD	USDMXN	04/15/2021	40,000	20.79694	(831,877)
2021022503051	FWD	USDMXN	04/19/2021	400,000	20.81861	(8,327,446)
2021022503567	FWD	USDMXN	04/19/2021	587	20.97191	(12,320)
2021022503052	FWD	USDMXN	04/23/2021	55,000	20.82783	(1,145,531)
2021022503568	FWD	USDMXN	04/23/2021	11,206	20.97101	(235,003)
2021022503476	FWD	USDMXN	04/26/2021	(11,253)	21.01969	236,537
2021022503053	FWD	USDMXN	04/26/2021	450,000	20.84844	(9,381,798)
2021022503054	FWD	USDMXN	05/04/2021	50,000	20.88616	(1,044,308)
2021022503569	FWD	USDMXN	05/04/2021	6,774	21.01794	(142,372)
2021022503477	FWD	USDMXN	05/05/2021	(12,445)	21.03345	261,751
2021022503055	FWD	USDMXN	05/05/2021	340,000	20.89145	(7,103,092)
2021022503698	FWD	USDMXN	05/06/2021	(70,000)	20.97954	1,468,568
2021022503058	FWD	USDMXN	05/18/2021	100,000	20.9215	(2,092,150)
2021022503570	FWD	USDMXN	05/18/2021	10,092	21.04387	(212,369)
2021022503478	FWD	USDMXN	05/19/2021	(23,423)	21.05983	493,274
2021022503059	FWD	USDMXN	05/19/2021	650,000	20.9257	(13,601,705)
2021022503447	FWD	USDMXN	05/26/2021	(41,905)	21.02638	881,105
2021022503653	FWD	USDMXN	06/02/2021	(100,000)	21.16349	2,116,350
2021022503654	FWD	USDMXN	06/09/2021	(100,000)	21.17831	2,117,831
2021022503655	FWD	USDMXN	06/16/2021	(100,000)	21.19314	2,119,314
2021022503449	FWD	USDMXN	06/23/2021	(55,819)	21.08602	1,177,011
2021022503656	FWD	USDMXN	06/23/2021	(100,000)	21.20884	2,120,884
2021022503657	FWD	USDMXN	06/30/2021	(100,000)	21.22453	2,122,453
2021022503448	FWD	USDMXN	07/07/2021	(90,511)	21.11765	1,911,379
2021022503762	FWD	USDMXN	07/07/2021	1,000,000	21.17825	(21,178,252)
2021022503450	FWD	USDMXN	08/04/2021	(44,875)	21.18236	950,554
2021022503464	FWD	USDMXN	09/01/2021	(44,716)	21.24537	950,017
2021022503465	FWD	USDMXN	09/29/2021	(75,982)	21.31353	1,619,442
2021022503161	FWD	USDMXN	10/27/2021	(67,554)	21.3723	1,443,781
2021022503163	FWD	USDMXN	11/10/2021	(54,128)	21.40508	1,158,608
2021022503172	FWD	USDMXN	11/24/2021	(54,034)	21.45533	1,159,323
2021022503467	FWD	USDMXN	01/05/2022	(139,082)	21.5469	2,996,787
2021022503466	FWD	USDMXN	01/19/2022	(138,754)	21.57847	2,994,100
2021022503468	FWD	USDMXN	02/02/2022	(125,780)	21.60999	2,718,112
2021022503469	FWD	USDMXN	02/16/2022	(125,600)	21.64072	2,718,081
2021022503556	FWD	USDMXN	04/08/2022	(100,000)	21.80615	2,180,615
2021022603017	FWD	USDMXN	02/26/2021	(30,000,000)	20.88	626,400,000
2021022603646	FWD	USDMXN	02/26/2021	22,000,000	20.95	(460,900,000)
2021022603647	FWD	USDMXN	03/01/2021	(22,000,000)	20.95663	461,045,750
2021022603018	FWD	USDMXN	03/01/2021	30,000,000	20.8869	(626,607,000)
2021022603401	FWD	USDMXN	03/02/2021	1,537,500	20.95314	(32,215,453)
2021022603403	FWD	USDMXN	03/02/2021	444,000	20.9583	(9,305,485)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021022603028	FWD	USDMXN	03/09/2021	(430,000)	20.90195	8,987,838
2021022603382	FWD	USDMXN	03/09/2021	(30,957)	20.98698	649,700
2021022603029	FWD	USDMXN	03/10/2021	(220,000)	20.90706	4,599,552
2021022603445	FWD	USDMXN	03/10/2021	101,324	20.92908	(2,120,619)
2021022603041	FWD	USDMXN	03/11/2021	(776,000)	20.85435	16,182,973
2021022603384	FWD	USDMXN	03/11/2021	(978)	20.98718	20,534
2021022603039	FWD	USDMXN	03/12/2021	(73,000)	20.86034	1,522,805
2021022603048	FWD	USDMXN	03/12/2021	(30,000)	20.81106	624,332
2021022603051	FWD	USDMXN	03/12/2021	(71,000)	20.82318	1,478,446
2021022603106	FWD	USDMXN	03/12/2021	(160,000)	20.99212	3,358,739
2021022603136	FWD	USDMXN	03/12/2021	(75,000)	20.97721	1,573,290
2021022603262	FWD	USDMXN	03/12/2021	(130,000)	20.96265	2,725,144
2021022603263	FWD	USDMXN	03/12/2021	(2,500)	20.96035	52,401
2021022603275	FWD	USDMXN	03/12/2021	(430,000)	20.90882	8,990,791
2021022603276	FWD	USDMXN	03/12/2021	(34,000)	20.92633	711,495
2021022603444	FWD	USDMXN	03/12/2021	7,952	20.95292	(166,613)
2021022603307	FWD	USDMXN	04/12/2021	(50,000)	21.02422	1,051,211
2021022603245	FWD	USDMXN	04/14/2021	(60,000)	21.04502	1,262,701
2021022603198	FWD	USDMXN	04/16/2021	(50,000)	21.00845	1,050,422
2021022603241	FWD	USDMXN	04/16/2021	(30,000)	21.05363	631,609
2021022603404	FWD	USDMXN	04/16/2021	(444,000)	21.057	9,349,306
2021022603328	FWD	USDMXN	04/27/2021	(50,000)	21.05758	1,052,879
2021022603199	FWD	USDMXN	04/28/2021	(25,000)	21.03613	525,903
2021022603402	FWD	USDMXN	04/29/2021	(1,537,500)	21.07998	32,410,469
2021022603450	FWD	USDMXN	04/30/2021	29,000	21.04101	(610,189)
2021022603452	FWD	USDMXN	06/30/2021	35,000	21.17222	(741,028)
2021022603369	FWD	USDMXN	09/27/2021	300,000	21.39881	(6,419,643)
2021022603370	FWD	USDMXN	10/25/2021	300,000	21.46729	(6,440,188)
2021022603371	FWD	USDMXN	11/24/2021	300,000	21.54099	(6,462,298)
2021022603372	FWD	USDMXN	12/20/2021	300,000	21.60372	(6,481,115)
2021022603373	FWD	USDMXN	01/20/2022	300,000	21.67778	(6,503,333)
2021022603374	FWD	USDMXN	02/16/2022	300,000	21.74332	(6,522,996)
2021030103243	FWD	USDMXN	03/01/2021	(200,000)	20.61244	4,122,488
2021030103427	FWD	USDMXN	03/01/2021	(3,000,000)	20.62	61,860,000
2021030103480	FWD	USDMXN	03/01/2021	(500,000)	20.64	10,320,000
2021030103453	FWD	USDMXN	03/01/2021	20,000,000	20.64	(412,800,000)
2021030103454	FWD	USDMXN	03/02/2021	(20,000,000)	20.6422	412,844,000
2021030103428	FWD	USDMXN	03/02/2021	3,000,000	20.6221	(61,866,300)
2021030103481	FWD	USDMXN	03/02/2021	500,000	20.6421	(10,321,050)
2021030103502	FWD	USDMXN	03/08/2021	(712,000)	20.64996	14,702,773
2021030103505	FWD	USDMXN	03/09/2021	(275,000)	20.65216	5,679,343
2021030103504	FWD	USDMXN	03/12/2021	(327,000)	20.65869	6,755,392
2021030103107	FWD	USDMXN	03/16/2021	(50,000)	20.63434	1,031,717
2021030103138	FWD	USDMXN	03/16/2021	(25,000)	20.63363	515,841
2021030103151	FWD	USDMXN	03/16/2021	(50,000)	20.64405	1,032,202
2021030103153	FWD	USDMXN	03/16/2021	(6,000)	20.65576	123,935
2021030103172	FWD	USDMXN	03/16/2021	(73,000)	20.63693	1,506,496
2021030103362	FWD	USDMXN	03/16/2021	(333)	20.63871	6,882
2021030103506	FWD	USDMXN	03/16/2021	(885,000)	20.66736	18,290,610
2021030103167	FWD	USDMXN	03/16/2021	1,937	20.63906	(39,984)
2021030103117	FWD	USDMXN	03/17/2021	(540,000)	20.60769	11,128,151
2021030103165	FWD	USDMXN	03/17/2021	232,019	20.75693	(4,816,002)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021030103168	FWD	USDMXN	03/17/2021	558	20.64041	(11,515)
2021030103116	FWD	USDMXN	03/18/2021	(600,000)	20.62811	12,376,864
2021030103227	FWD	USDMXN	03/18/2021	(17,000)	20.64003	350,880
2021030103229	FWD	USDMXN	03/18/2021	(1,400)	20.63933	28,895
2021030103364	FWD	USDMXN	03/18/2021	(48)	20.64258	985
2021030103169	FWD	USDMXN	03/18/2021	3,124	20.64448	(64,492)
2021030103332	FWD	USDMXN	03/30/2021	(35,000)	20.68533	723,987
2021030103224	FWD	USDMXN	03/30/2021	33,000	20.65848	(681,730)
2021030103330	FWD	USDMXN	03/31/2021	(70,000)	20.68607	1,448,025
2021030103147	FWD	USDMXN	03/31/2021	3,000,000	20.6684	(62,005,209)
2021030103241	FWD	USDMXN	03/31/2021	200,000	20.91529	(4,183,058)
2021030103244	FWD	USDMXN	03/31/2021	200,000	20.68005	(4,136,010)
2021030103163	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.69079	(8,276,318)
2021030103170	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	20.68426	(122,244)
2021030103284	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.68841	(8,275,364)
2021030103361	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	20.69524	(122,308)
2021030103242	FWD	USDMXN	04/08/2021	300,000	20.91297	(6,273,892)
2021030103225	FWD	USDMXN	04/20/2021	43,500	20.70445	(900,643)
2021030103166	FWD	USDMXN	04/21/2021	234,801	20.83428	(4,891,910)
2021030103030	FWD	USDMXN	05/07/2021	(50,000)	20.78912	1,039,456
2021030103174	FWD	USDMXN	10/13/2021	200,000	21.14261	(4,228,521)
2021030103175	FWD	USDMXN	11/17/2021	200,000	21.22661	(4,245,322)
2021030203543	FWD	USDMXN	09/30/2020	2,502,618	22.23	(55,633,196)
2021030203374	FWD	USDMXN	03/02/2021	(2,666,020)	20.63	55,000,000
2021030203507	FWD	USDMXN	03/02/2021	1,000,000	20.57	(20,570,000)
2021030203508	FWD	USDMXN	03/03/2021	(1,000,000)	20.5723	20,572,300
2021030203375	FWD	USDMXN	03/03/2021	2,665,749	20.6321	(55,000,000)
2021030203532	FWD	USDMXN	03/04/2021	(1,104,500)	20.6042	22,757,337
2021030203279	FWD	USDMXN	04/05/2021	405,910	20.70071	(8,402,626)
2021030203533	FWD	USDMXN	05/17/2021	1,104,500	20.77293	(22,943,694)
2021030303646	FWD	USDMXN	03/01/2021	200,000	20.89	(4,178,000)
2021030303608	FWD	USDMXN	03/03/2021	(3,000,000)	20.87	62,610,000
2021030303609	FWD	USDMXN	03/04/2021	3,000,000	20.872	(62,616,000)
2021030303649	FWD	USDMXN	03/05/2021	300,000	20.95285	(6,285,855)
2021030303651	FWD	USDMXN	03/05/2021	400,000	20.95247	(8,380,988)
2021030303041	FWD	USDMXN	03/16/2021	(17,000)	20.81095	353,786
2021030303049	FWD	USDMXN	03/16/2021	(69,000)	20.82687	1,437,054
2021030303071	FWD	USDMXN	03/16/2021	(20,000)	20.91583	418,317
2021030303135	FWD	USDMXN	03/16/2021	(88,000)	20.88991	1,838,312
2021030303154	FWD	USDMXN	03/16/2021	(70,000)	20.93834	1,465,684
2021030303197	FWD	USDMXN	03/16/2021	(60,000)	20.90717	1,254,430
2021030303237	FWD	USDMXN	03/16/2021	(10,000)	20.96063	209,606
2021030303286	FWD	USDMXN	03/16/2021	(25,000)	20.94682	523,670
2021030303343	FWD	USDMXN	03/16/2021	(80,000)	20.9336	1,674,688
2021030303381	FWD	USDMXN	03/16/2021	(15,000)	20.96924	314,539
2021030303530	FWD	USDMXN	03/16/2021	(35,000)	21.00199	735,070
2021030303627	FWD	USDMXN	03/16/2021	(56,421)	20.92225	1,180,444
2021030303604	FWD	USDMXN	03/17/2021	(15,000)	20.89642	313,446
2021030303619	FWD	USDMXN	03/17/2021	(315)	20.90698	6,578
2021030303611	FWD	USDMXN	03/22/2021	(177,000)	20.91526	3,702,002
2021030303620	FWD	USDMXN	03/22/2021	(581)	20.91816	12,163
2021030303652	FWD	USDMXN	03/31/2021	(400,000)	21.00929	8,403,716

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021030303248	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.94446	(8,377,786)
2021030303250	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	21.00134	(124,117)
2021030303204	FWD	USDMXN	04/08/2021	(86,533)	20.95091	1,812,947
2021030303650	FWD	USDMXN	04/08/2021	(300,000)	21.02731	6,308,194
2021030303431	FWD	USDMXN	04/21/2021	19,335	21.00983	(406,225)
2021030303215	FWD	USDMXN	04/22/2021	(86,364)	20.99213	1,812,965
2021030303213	FWD	USDMXN	05/06/2021	(15,727)	21.02142	330,593
2021030303432	FWD	USDMXN	05/19/2021	19,567	21.07142	(412,304)
2021030303214	FWD	USDMXN	05/20/2021	(15,710)	21.0508	330,709
2021030303553	FWD	USDMXN	05/25/2021	600,000	21.13885	(12,683,310)
2021030303433	FWD	USDMXN	06/16/2021	20,037	21.13179	(423,418)
2021030303434	FWD	USDMXN	07/14/2021	20,127	21.19592	(426,610)
2021030303311	FWD	USDMXN	07/22/2021	(79,021)	21.2275	1,677,423
2021030303435	FWD	USDMXN	08/18/2021	20,377	21.27631	(433,547)
2021030303238	FWD	USDMXN	08/26/2021	(80,348)	21.31573	1,712,685
2021030303310	FWD	USDMXN	09/09/2021	(64,166)	21.34686	1,369,752
2021030303436	FWD	USDMXN	09/15/2021	20,458	21.34167	(436,608)
2021030303317	FWD	USDMXN	09/23/2021	(64,085)	21.38525	1,370,482
2021030303318	FWD	USDMXN	10/07/2021	(93,915)	21.41943	2,011,597
2021030303319	FWD	USDMXN	10/07/2021	(68)	21.40305	1,465
2021030303437	FWD	USDMXN	10/13/2021	20,708	21.41203	(443,400)
2021030303272	FWD	USDMXN	10/21/2021	(93,904)	21.44047	2,013,348
2021030303282	FWD	USDMXN	11/10/2021	(84,668)	21.50018	1,820,379
2021030303438	FWD	USDMXN	11/17/2021	20,751	21.49952	(446,137)
2021030303287	FWD	USDMXN	11/24/2021	(84,558)	21.52746	1,820,318
2021030303314	FWD	USDMXN	12/09/2021	(84,309)	21.55865	1,817,582
2021030303440	FWD	USDMXN	12/15/2021	15,929	21.56869	(343,568)
2021030303320	FWD	USDMXN	12/23/2021	(834)	21.60473	18,009
2021030303321	FWD	USDMXN	12/23/2021	(979)	21.59647	21,138
2021030303323	FWD	USDMXN	12/23/2021	(623)	21.59243	13,449
2021030303324	FWD	USDMXN	12/23/2021	(636)	21.56053	13,712
2021030303328	FWD	USDMXN	12/23/2021	(81,000)	21.59904	1,749,523
2021030303329	FWD	USDMXN	12/23/2021	(144)	21.5923	3,105
2021030303439	FWD	USDMXN	01/19/2022	15,826	21.65225	(342,669)
2021030303441	FWD	USDMXN	02/16/2022	21,058	21.71943	(457,368)
2021030303442	FWD	USDMXN	03/16/2022	20,827	21.78921	(453,804)
2021030303621	FWD	USDMXN	03/16/2022	237	21.76939	(5,159)
2021030403133	FWD	USDMXN	03/04/2021	(10,000,000)	20.82	208,200,000
2021030403583	FWD	USDMXN	03/04/2021	(3,000,000)	21.16	63,480,000
2021030403134	FWD	USDMXN	03/05/2021	10,000,000	20.82225	(208,222,500)
2021030403584	FWD	USDMXN	03/05/2021	3,000,000	21.1621	(63,486,300)
2021030403004	FWD	USDMXN	03/08/2021	1,000,000	20.82691	(20,826,910)
2021030403006	FWD	USDMXN	03/08/2021	1,000,000	20.83556	(20,835,560)
2021030403008	FWD	USDMXN	03/08/2021	1,000,000	20.83918	(20,839,180)
2021030403432	FWD	USDMXN	03/08/2021	1,000,000	21.03432	(21,034,320)
2021030403494	FWD	USDMXN	03/10/2021	(300,000)	21.02609	6,307,829
2021030403293	FWD	USDMXN	03/17/2021	(4,191)	20.9707	87,882
2021030403335	FWD	USDMXN	03/17/2021	(19,000)	20.97747	398,572
2021030403435	FWD	USDMXN	03/17/2021	(290)	21.05458	6,109
2021030403487	FWD	USDMXN	03/17/2021	(300,000)	21.04147	6,312,441
2021030403246	FWD	USDMXN	03/19/2021	(26,000)	20.82365	541,415
2021030403263	FWD	USDMXN	03/19/2021	(57,000)	20.85262	1,188,600

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021030403294	FWD	USDMXN	03/19/2021	(443)	20.96689	9,295
2021030403105	FWD	USDMXN	03/22/2021	(55,000)	20.79377	1,143,657
2021030403114	FWD	USDMXN	03/22/2021	(31,000)	20.8062	644,992
2021030403151	FWD	USDMXN	03/22/2021	(100,000)	20.84183	2,084,183
2021030403166	FWD	USDMXN	03/22/2021	(200,000)	20.81148	4,162,295
2021030403291	FWD	USDMXN	03/22/2021	(148,402)	20.97414	3,112,612
2021030403510	FWD	USDMXN	03/22/2021	(32,000)	21.15208	676,867
2021030403519	FWD	USDMXN	03/22/2021	(255)	21.12995	5,395
2021030403486	FWD	USDMXN	03/23/2021	(100,000)	21.06029	2,106,029
2021030403149	FWD	USDMXN	03/23/2021	17,855	20.83387	(371,989)
2021030403324	FWD	USDMXN	03/23/2021	1,000,000	20.94873	(20,948,727)
2021030403488	FWD	USDMXN	03/24/2021	(300,000)	21.05765	6,317,296
2021030403489	FWD	USDMXN	03/31/2021	(300,000)	21.07299	6,321,898
2021030403533	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,000	21.13877	(6,574,159)
2021030403535	FWD	USDMXN	04/05/2021	820	21.13467	(17,330)
2021030403269	FWD	USDMXN	04/06/2021	1,000,000	20.92396	(20,923,962)
2021030403570	FWD	USDMXN	04/13/2021	(306,977)	21.1837	6,502,915
2021030403560	FWD	USDMXN	04/13/2021	153,489	21.16756	(3,248,981)
2021030403005	FWD	USDMXN	04/22/2021	(1,000,000)	20.9256	20,925,602
2021030403433	FWD	USDMXN	04/23/2021	(1,000,000)	21.13524	21,135,243
2021030403319	FWD	USDMXN	04/28/2021	(45,478)	20.9022	950,584
2021030403007	FWD	USDMXN	05/27/2021	(1,000,000)	21.01005	21,010,054
2021030403317	FWD	USDMXN	06/09/2021	(55,984)	20.99217	1,175,234
2021030403318	FWD	USDMXN	06/23/2021	(55,907)	21.02264	1,175,315
2021030403009	FWD	USDMXN	06/24/2021	(1,000,000)	21.07377	21,073,774
2021030403320	FWD	USDMXN	07/07/2021	(90,636)	21.05423	1,908,263
2021030403594	FWD	USDMXN	07/07/2021	(100,000)	21.40267	2,140,267
2021030403596	FWD	USDMXN	07/14/2021	(100,000)	21.41856	2,141,856
2021030403321	FWD	USDMXN	07/21/2021	(90,537)	21.08564	1,909,025
2021030403595	FWD	USDMXN	07/21/2021	(100,000)	21.43448	2,143,448
2021030403194	FWD	USDMXN	08/04/2021	(45,002)	21.11248	950,112
2021030403454	FWD	USDMXN	08/16/2021	200,000	21.40528	(4,281,056)
2021030403536	FWD	USDMXN	08/16/2021	2,798	21.43313	(59,970)
2021030403322	FWD	USDMXN	09/01/2021	(44,830)	21.18007	949,510
2021030403233	FWD	USDMXN	11/24/2021	(54,123)	21.40233	1,158,351
2021030403241	FWD	USDMXN	12/22/2021	(58,972)	21.47907	1,266,670
2021030403689	FWD	USDMXN	01/07/2022	(500,000)	21.74334	10,871,670
2021030403706	FWD	USDMXN	02/04/2022	(32,813)	21.92836	719,524
2021030403707	FWD	USDMXN	02/11/2022	(32,813)	21.94508	720,073
2021030403708	FWD	USDMXN	02/18/2022	(32,813)	21.96137	720,607
2021030403709	FWD	USDMXN	02/25/2022	(32,813)	21.97765	721,142
2021030503563	FWD	USDMXN	03/05/2021	(3,000,000)	21.29	63,870,000
2021030503564	FWD	USDMXN	03/08/2021	3,000,000	21.2963	(63,888,900)
2021030503156	FWD	USDMXN	03/09/2021	236,685	21.24989	(5,029,521)
2021030503032	FWD	USDMXN	03/12/2021	(50,000)	21.2818	1,064,090
2021030503030	FWD	USDMXN	03/17/2021	(110,000)	21.29966	2,342,963
2021030503107	FWD	USDMXN	03/17/2021	(70,000)	21.27005	1,488,904
2021030503159	FWD	USDMXN	03/17/2021	6,247	21.26775	(132,854)
2021030503387	FWD	USDMXN	03/18/2021	(56,000)	21.2995	1,192,772
2021030503389	FWD	USDMXN	03/18/2021	(615)	21.30613	13,097
2021030503528	FWD	USDMXN	03/18/2021	(57,000)	21.31405	1,214,901
2021030503588	FWD	USDMXN	03/18/2021	(869)	21.31844	18,532

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021030503118	FWD	USDMXN	03/19/2021	(150,000)	21.28569	3,192,853
2021030503190	FWD	USDMXN	03/19/2021	(25,000)	21.30866	532,717
2021030503280	FWD	USDMXN	03/19/2021	(8,000)	21.33871	170,710
2021030503314	FWD	USDMXN	03/19/2021	(93,000)	21.29742	1,980,660
2021030503376	FWD	USDMXN	03/19/2021	(70,098)	21.2854	1,492,053
2021030503412	FWD	USDMXN	03/19/2021	(205,000)	21.33958	4,374,615
2021030503420	FWD	USDMXN	03/19/2021	(774)	21.35529	16,524
2021030503587	FWD	USDMXN	03/19/2021	(7,575)	21.32564	161,552
2021030503160	FWD	USDMXN	03/19/2021	8,877	21.28601	(188,965)
2021030503236	FWD	USDMXN	03/22/2021	1,000,000	21.31279	(21,312,790)
2021030503372	FWD	USDMXN	03/22/2021	92,973	21.3075	(1,981,024)
2021030503153	FWD	USDMXN	03/25/2021	(500,000)	21.25187	10,625,934
2021030503300	FWD	USDMXN	04/05/2021	405,000	21.3452	(8,644,807)
2021030503378	FWD	USDMXN	04/05/2021	910	21.32993	(19,410)
2021030503208	FWD	USDMXN	04/16/2021	(15,000)	21.35872	320,381
2021030503154	FWD	USDMXN	04/22/2021	(500,000)	21.31492	10,657,459
2021030503409	FWD	USDMXN	04/30/2021	(200,000)	21.39274	4,278,549
2021030503518	FWD	USDMXN	05/07/2021	(20,000)	21.40678	428,136
2021030503155	FWD	USDMXN	05/27/2021	(500,000)	21.39235	10,696,177
2021030503157	FWD	USDMXN	06/25/2021	(236,685)	21.4909	5,086,565
2021030503571	FWD	USDMXN	08/20/2021	1,000,000	21.6692	(21,669,197)
2021030803050	FWD	USDMXN	03/08/2021	(20,000,000)	21.43	428,600,000
2021030803196	FWD	USDMXN	03/08/2021	(1,000,000)	21.39	21,390,000
2021030803272	FWD	USDMXN	03/09/2021	(12,600,000)	21.35217	269,037,355
2021030803051	FWD	USDMXN	03/09/2021	20,000,000	21.43252	(428,650,400)
2021030803197	FWD	USDMXN	03/09/2021	1,000,000	21.3922	(21,392,200)
2021030803160	FWD	USDMXN	03/19/2021	(65,094)	21.47167	1,397,684
2021030803175	FWD	USDMXN	03/23/2021	(60,000)	21.44214	1,286,528
2021030803233	FWD	USDMXN	03/23/2021	(46,000)	21.43094	985,823
2021030803251	FWD	USDMXN	03/23/2021	(50,000)	21.42213	1,071,106
2021030803411	FWD	USDMXN	03/23/2021	(3,261)	21.47528	70,035
2021030803431	FWD	USDMXN	03/23/2021	(55,000)	21.47815	1,181,298
2021030803439	FWD	USDMXN	03/23/2021	(654)	21.4839	14,059
2021030803018	FWD	USDMXN	03/24/2021	(35,000)	21.58572	755,500
2021030803033	FWD	USDMXN	03/24/2021	(140,000)	21.46838	3,005,574
2021030803075	FWD	USDMXN	03/24/2021	(57,000)	21.48327	1,224,546
2021030803161	FWD	USDMXN	03/24/2021	(16,192)	21.47201	347,685
2021030803082	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	21.48667	(8,594,670)
2021030803114	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	21.47777	(126,933)
2021030803255	FWD	USDMXN	04/05/2021	405,910	21.44573	(8,705,036)
2021030803162	FWD	USDMXN	04/07/2021	(300,000)	21.61788	6,485,365
2021030803273	FWD	USDMXN	04/13/2021	12,600,000	21.43527	(270,084,462)
2021030803163	FWD	USDMXN	04/14/2021	(300,000)	21.63407	6,490,221
2021030803181	FWD	USDMXN	04/23/2021	(25,000)	21.48609	537,152
2021030903090	FWD	USDMXN	03/09/2021	(7,444,052)	21.225	158,000,000
2021030903386	FWD	USDMXN	03/09/2021	(10,000,000)	21.23	212,300,000
2021030903091	FWD	USDMXN	03/10/2021	7,443,263	21.22725	(158,000,000)
2021030903387	FWD	USDMXN	03/10/2021	10,000,000	21.23235	(212,323,500)
2021030903263	FWD	USDMXN	03/11/2021	250,000	21.2694	(5,317,350)
2021030903453	FWD	USDMXN	03/11/2021	13,315	21.2048	(282,351)
2021030903486	FWD	USDMXN	03/19/2021	100,000	21.23751	(2,123,751)
2021030903187	FWD	USDMXN	03/23/2021	(70,000)	21.29852	1,490,896

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021030903498	FWD	USDMXN	03/23/2021	(80,000)	21.24348	1,699,478
2021030903500	FWD	USDMXN	03/23/2021	(5,000)	21.24348	106,217
2021030903594	FWD	USDMXN	03/23/2021	(1,101)	21.15892	23,303
2021030903392	FWD	USDMXN	03/25/2021	(120,000)	21.28002	2,553,603
2021030903410	FWD	USDMXN	03/25/2021	(325,000)	21.2621	6,910,181
2021030903456	FWD	USDMXN	03/25/2021	15,548	21.23643	(330,178)
2021030903487	FWD	USDMXN	03/30/2021	(100,000)	21.26187	2,126,187
2021030903459	FWD	USDMXN	03/30/2021	100,000	21.25987	(2,125,988)
2021030903295	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,820	21.28327	(6,636,548)
2021030903044	FWD	USDMXN	04/06/2021	20,300	21.34078	(433,218)
2021030903329	FWD	USDMXN	04/09/2021	200,000	21.30291	(4,260,582)
2021030903613	FWD	USDMXN	04/14/2021	(9,713,585)	21.29827	206,882,560
2021030903055	FWD	USDMXN	04/23/2021	(10,000)	21.35566	213,557
2021030903330	FWD	USDMXN	04/23/2021	200,000	21.33459	(4,266,919)
2021030903467	FWD	USDMXN	04/28/2021	1,400,000	21.32781	(29,858,937)
2021030903468	FWD	USDMXN	04/28/2021	6,841	21.31745	(145,836)
2021030903331	FWD	USDMXN	05/10/2021	200,000	21.37311	(4,274,622)
2021030903264	FWD	USDMXN	06/18/2021	(250,000)	21.49433	5,373,582
2021030903454	FWD	USDMXN	06/25/2021	(13,315)	21.44635	285,568
2021030903271	FWD	USDMXN	08/06/2021	25,000	21.5769	(539,423)
2021030903272	FWD	USDMXN	08/13/2021	25,000	21.59353	(539,838)
2021030903273	FWD	USDMXN	08/20/2021	25,000	21.61022	(540,255)
2021030903274	FWD	USDMXN	08/27/2021	25,000	21.6269	(540,673)
2021031003067	FWD	USDMXN	03/10/2021	(3,000,000)	21.11	63,330,000
2021031003069	FWD	USDMXN	03/11/2021	(2,500,000)	21.11	52,775,000
2021031003068	FWD	USDMXN	03/11/2021	3,000,000	21.1122	(63,336,600)
2021031003070	FWD	USDMXN	03/12/2021	2,500,000	21.1122	(52,780,500)
2021031003430	FWD	USDMXN	03/12/2021	54,000	20.93796	(1,130,650)
2021031003432	FWD	USDMXN	03/12/2021	152,000	20.94229	(3,183,228)
2021031003435	FWD	USDMXN	03/12/2021	321,000	20.93415	(6,719,862)
2021031003437	FWD	USDMXN	03/12/2021	44,000	20.93459	(921,122)
2021031003450	FWD	USDMXN	03/17/2021	55,000	20.95987	(1,152,793)
2021031003431	FWD	USDMXN	03/18/2021	(54,000)	20.95137	1,131,374
2021031003023	FWD	USDMXN	03/19/2021	(15,000)	21.06821	316,023
2021031003136	FWD	USDMXN	03/19/2021	(7,000)	21.05818	147,407
2021031003212	FWD	USDMXN	03/19/2021	(801)	21.06804	16,873
2021031003433	FWD	USDMXN	03/19/2021	(152,000)	20.95794	3,185,606
2021031003190	FWD	USDMXN	03/19/2021	400	21.06721	(8,436)
2021031003099	FWD	USDMXN	03/23/2021	(76,000)	21.02512	1,597,909
2021031003125	FWD	USDMXN	03/23/2021	(789)	21.05532	16,609
2021031003436	FWD	USDMXN	03/23/2021	(321,000)	20.95859	6,727,708
2021031003461	FWD	USDMXN	03/23/2021	(15,000)	20.94077	314,112
2021031003536	FWD	USDMXN	03/23/2021	(10,000)	20.91937	209,194
2021031003592	FWD	USDMXN	03/23/2021	(1,608)	20.91194	33,633
2021031003124	FWD	USDMXN	03/25/2021	(52,354)	21.0656	1,102,876
2021031003438	FWD	USDMXN	03/25/2021	(44,000)	20.96343	922,391
2021031003638	FWD	USDMXN	03/31/2021	200,000	20.92911	(4,185,823)
2021031003396	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,000	21.038	(6,542,818)
2021031003460	FWD	USDMXN	04/05/2021	820	20.98495	(17,206)
2021031003331	FWD	USDMXN	04/08/2021	(86,200)	21.03175	1,812,932
2021031003123	FWD	USDMXN	04/12/2021	200,000	21.075	(4,215,000)
2021031003021	FWD	USDMXN	04/21/2021	(20,000)	21.14302	422,860

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031003333	FWD	USDMXN	04/22/2021	(86,110)	21.06026	1,813,492
2021031003164	FWD	USDMXN	05/04/2021	(1,000,000)	21.17705	21,177,053
2021031003159	FWD	USDMXN	05/04/2021	2,800,000	21.17662	(59,294,530)
2021031003022	FWD	USDMXN	05/06/2021	(25,000)	21.18159	529,540
2021031003013	FWD	USDMXN	05/14/2021	(30,000)	21.22495	636,749
2021031003477	FWD	USDMXN	05/20/2021	(15,648)	21.13108	330,658
2021031003478	FWD	USDMXN	06/10/2021	(39,621)	21.17827	839,097
2021031003479	FWD	USDMXN	06/24/2021	(39,555)	21.21068	838,994
2021031003480	FWD	USDMXN	07/08/2021	(78,965)	21.24345	1,677,499
2021031003483	FWD	USDMXN	07/22/2021	(78,847)	21.2763	1,677,565
2021031003484	FWD	USDMXN	08/12/2021	(80,273)	21.3261	1,711,910
2021031003485	FWD	USDMXN	08/26/2021	(80,167)	21.35935	1,712,320
2021031003367	FWD	USDMXN	09/09/2021	(64,091)	21.38331	1,370,486
2021031003486	FWD	USDMXN	09/23/2021	(63,933)	21.42641	1,369,852
2021031003488	FWD	USDMXN	10/07/2021	(93,734)	21.46039	2,011,559
2021031003487	FWD	USDMXN	10/21/2021	(93,633)	21.49466	2,012,615
2021031003489	FWD	USDMXN	11/10/2021	(79,624)	21.54396	1,715,419
2021031003600	FWD	USDMXN	11/10/2021	(4,863)	21.44018	104,266
2021031003602	FWD	USDMXN	12/09/2021	(84,059)	21.51251	1,808,326
2021031003603	FWD	USDMXN	12/23/2021	(84,036)	21.54872	1,810,867
2021031003440	FWD	USDMXN	01/27/2022	(116,188)	21.69159	2,520,304
2021031003604	FWD	USDMXN	02/24/2022	(122,095)	21.70375	2,649,914
2021031103114	FWD	USDMXN	03/11/2021	(10,000,000)	20.77	207,700,000
2021031103115	FWD	USDMXN	03/16/2021	10,000,000	20.7811	(207,811,000)
2021031103516	FWD	USDMXN	03/16/2021	2,906,901	20.6627	(60,064,417)
2021031103015	FWD	USDMXN	03/22/2021	400,000	20.74807	(8,299,227)
2021031103041	FWD	USDMXN	03/24/2021	(50,000)	20.76981	1,038,491
2021031103148	FWD	USDMXN	03/24/2021	(52,000)	20.75864	1,079,449
2021031103150	FWD	USDMXN	03/24/2021	(33,000)	20.75534	684,926
2021031103522	FWD	USDMXN	03/24/2021	(126,000)	20.67801	2,605,429
2021031103592	FWD	USDMXN	03/26/2021	200,000	20.62463	(4,124,926)
2021031103517	FWD	USDMXN	03/29/2021	(2,906,901)	20.69096	60,146,555
2021031103236	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,820	20.78468	(6,481,080)
2021031103075	FWD	USDMXN	04/07/2021	100,000	20.7975	(2,079,750)
2021031103155	FWD	USDMXN	04/09/2021	500,000	20.79091	(10,395,457)
2021031103548	FWD	USDMXN	04/20/2021	23,500	20.71983	(486,916)
2021031103599	FWD	USDMXN	04/26/2021	200,000	20.70197	(4,140,395)
2021031103502	FWD	USDMXN	04/27/2021	(1,900,000)	20.73627	39,398,909
2021031103529	FWD	USDMXN	04/30/2021	336,538	20.76295	(6,987,523)
2021031103547	FWD	USDMXN	05/04/2021	50,000	20.75124	(1,037,562)
2021031103068	FWD	USDMXN	05/17/2021	(40,000)	20.87007	834,803
2021031103530	FWD	USDMXN	05/28/2021	336,462	20.82514	(7,006,868)
2021031203124	FWD	USDMXN	03/12/2021	(1,000,000)	20.75	20,750,000
2021031203198	FWD	USDMXN	03/12/2021	(25,000,000)	20.73	518,250,000
2021031203433	FWD	USDMXN	03/12/2021	(10,000,000)	20.75	207,500,000
2021031203598	FWD	USDMXN	03/12/2021	(100,000,000)	20.71	2,071,000,000
2021031203600	FWD	USDMXN	03/12/2021	100,000,000	20.71	(2,071,000,000)
2021031203127	FWD	USDMXN	03/16/2021	(500,000)	20.75	10,375,000
2021031203385	FWD	USDMXN	03/16/2021	(5,000,000)	20.76834	103,841,680
2021031203391	FWD	USDMXN	03/16/2021	(30,000,000)	20.7519	622,557,045
2021031203455	FWD	USDMXN	03/16/2021	(500,000)	20.73242	10,366,212
2021031203601	FWD	USDMXN	03/16/2021	(100,000,000)	20.719	2,071,900,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031203199	FWD	USDMXN	03/16/2021	25,000,000	20.7381	(518,452,500)
2021031203409	FWD	USDMXN	03/16/2021	600,000	20.75781	(12,454,687)
2021031203599	FWD	USDMXN	03/16/2021	100,000,000	20.7184	(2,071,840,000)
2021031203125	FWD	USDMXN	03/17/2021	1,000,000	20.7601	(20,760,100)
2021031203128	FWD	USDMXN	03/17/2021	500,000	20.7522	(10,376,100)
2021031203392	FWD	USDMXN	03/17/2021	30,000,000	20.7542	(622,626,000)
2021031203434	FWD	USDMXN	03/17/2021	10,000,000	20.7607	(207,607,000)
2021031203041	FWD	USDMXN	03/26/2021	(40,000)	20.83464	833,386
2021031203045	FWD	USDMXN	03/26/2021	(75,000)	20.82323	1,561,742
2021031203148	FWD	USDMXN	03/26/2021	(25,000)	20.77211	519,303
2021031203230	FWD	USDMXN	03/26/2021	(56,944)	20.75668	1,181,974
2021031203352	FWD	USDMXN	03/26/2021	(60,000)	20.7748	1,246,488
2021031203357	FWD	USDMXN	03/26/2021	(83,000)	20.7762	1,724,424
2021031203535	FWD	USDMXN	03/26/2021	(16,247)	20.73737	336,927
2021031203547	FWD	USDMXN	03/26/2021	(21,000)	20.73888	435,516
2021031203618	FWD	USDMXN	03/26/2021	(20,000)	20.72958	414,592
2021031203205	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.78403	(8,313,611)
2021031203224	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	20.78961	(122,866)
2021031203533	FWD	USDMXN	04/05/2021	405,000	20.7751	(8,413,916)
2021031203410	FWD	USDMXN	04/13/2021	(600,000)	20.81761	12,490,566
2021031203637	FWD	USDMXN	04/13/2021	21,650	20.803	(450,385)
2021031203456	FWD	USDMXN	04/20/2021	500,000	20.80869	(10,404,345)
2021031203002	FWD	USDMXN	04/27/2021	(30,898)	20.76287	641,522
2021031203003	FWD	USDMXN	04/28/2021	(45,619)	20.76508	947,292
2021031203004	FWD	USDMXN	05/12/2021	(42,271)	20.79569	879,063
2021031203044	FWD	USDMXN	05/18/2021	(50,000)	20.94288	1,047,144
2021031203240	FWD	USDMXN	05/19/2021	(35,000)	20.85604	729,962
2021031203005	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,091)	20.8266	876,616
2021031203006	FWD	USDMXN	06/09/2021	(56,115)	20.8577	1,170,438
2021031203007	FWD	USDMXN	06/23/2021	(56,048)	20.88921	1,170,808
2021031203215	FWD	USDMXN	06/24/2021	(500,000)	21.05474	10,527,372
2021031203207	FWD	USDMXN	06/30/2021	67,000	20.99125	(1,406,414)
2021031203216	FWD	USDMXN	07/28/2021	(500,000)	21.13351	10,566,753
2021031203180	FWD	USDMXN	08/03/2021	6,000,000	21.09503	(126,570,150)
2021031203241	FWD	USDMXN	08/03/2021	500,000	21.0273	(10,513,650)
2021031203008	FWD	USDMXN	08/04/2021	(45,260)	20.98571	949,806
2021031203009	FWD	USDMXN	08/18/2021	(45,169)	21.01803	949,369
2021031203217	FWD	USDMXN	08/25/2021	(500,000)	21.19876	10,599,381
2021031203010	FWD	USDMXN	09/01/2021	(45,111)	21.05051	949,617
2021031203011	FWD	USDMXN	09/29/2021	(76,547)	21.11585	1,616,349
2021031203012	FWD	USDMXN	10/13/2021	(68,161)	21.14896	1,441,527
2021031203298	FWD	USDMXN	10/15/2021	1,898,000	21.23985	(40,313,232)
2021031203013	FWD	USDMXN	11/10/2021	(54,625)	21.21555	1,158,910
2021031203014	FWD	USDMXN	11/24/2021	(54,528)	21.24885	1,158,652
2021031203015	FWD	USDMXN	12/08/2021	(59,501)	21.28211	1,266,315
2021031203017	FWD	USDMXN	12/22/2021	(59,429)	21.31567	1,266,765
2021031203016	FWD	USDMXN	01/05/2022	(140,509)	21.34984	2,999,837
2021031203019	FWD	USDMXN	01/19/2022	(140,318)	21.38405	3,000,567
2021031203018	FWD	USDMXN	02/02/2022	(127,043)	21.41857	2,721,089
2021031203020	FWD	USDMXN	02/16/2022	(125,755)	21.4531	2,697,841
2021031203021	FWD	USDMXN	02/16/2022	(1,134)	21.55591	24,445
2021031603384	FWD	USDMXN	03/16/2021	(10,000,000)	20.55	205,500,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031603417	FWD	USDMXN	03/16/2021	(9,000,000)	20.57	185,130,000
2021031603536	FWD	USDMXN	03/18/2021	(2,953,000)	20.60727	60,853,267
2021031603558	FWD	USDMXN	03/18/2021	(50,000)	20.61877	1,030,939
2021031603562	FWD	USDMXN	03/18/2021	(156,000)	20.61957	3,216,653
2021031603564	FWD	USDMXN	03/18/2021	(146,000)	20.61957	3,010,457
2021031603566	FWD	USDMXN	03/18/2021	(460,000)	20.61957	9,485,002
2021031603385	FWD	USDMXN	03/18/2021	10,000,000	20.5546	(205,546,000)
2021031603418	FWD	USDMXN	03/18/2021	9,000,000	20.57465	(185,171,850)
2021031603022	FWD	USDMXN	03/24/2021	(15)	20.62603	309
2021031603036	FWD	USDMXN	03/26/2021	(30,869)	20.62178	636,570
2021031603041	FWD	USDMXN	03/26/2021	(40,000)	20.58571	823,428
2021031603489	FWD	USDMXN	03/26/2021	99,642	20.58042	(2,050,678)
2021031603328	FWD	USDMXN	03/29/2021	126,000	20.55628	(2,590,091)
2021031603534	FWD	USDMXN	03/30/2021	8,047,000	20.5634	(165,473,688)
2021031603537	FWD	USDMXN	03/30/2021	2,953,000	20.63387	(60,931,829)
2021031603020	FWD	USDMXN	04/05/2021	910	20.65488	(18,796)
2021031603224	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,000	20.61468	(6,411,165)
2021031603225	FWD	USDMXN	04/05/2021	820	20.61154	(16,901)
2021031603488	FWD	USDMXN	04/05/2021	59,120	20.60235	(1,218,015)
2021031603271	FWD	USDMXN	04/07/2021	(385,000)	20.57252	7,920,421
2021031603416	FWD	USDMXN	04/07/2021	(2,174)	20.60575	44,798
2021031603429	FWD	USDMXN	04/07/2021	(21,339)	20.62565	440,140
2021031603490	FWD	USDMXN	04/09/2021	312,720	20.61119	(6,445,540)
2021031603364	FWD	USDMXN	04/14/2021	(12,000,000)	20.60443	247,253,208
2021031603574	FWD	USDMXN	04/15/2021	4,283	20.6879	(88,606)
2021031603522	FWD	USDMXN	04/20/2021	(55,000)	20.65029	1,135,766
2021031603028	FWD	USDMXN	04/21/2021	(50,000)	20.67885	1,033,943
2021031603492	FWD	USDMXN	04/23/2021	87,966	20.64184	(1,815,780)
2021031603342	FWD	USDMXN	04/28/2021	80,088	20.63975	(1,652,996)
2021031603343	FWD	USDMXN	04/28/2021	1,300,000	20.64501	(26,838,515)
2021031603493	FWD	USDMXN	05/07/2021	501,491	20.67304	(10,367,337)
2021031603559	FWD	USDMXN	05/11/2021	50,000	20.73827	(1,036,913)
2021031603221	FWD	USDMXN	05/14/2021	350,000	20.69832	(7,244,411)
2021031603494	FWD	USDMXN	05/14/2021	193,937	20.68865	(4,012,290)
2021031603139	FWD	USDMXN	05/19/2021	(40,000)	20.70519	828,207
2021031603222	FWD	USDMXN	05/21/2021	350,000	20.71389	(7,249,863)
2021031603495	FWD	USDMXN	05/21/2021	51,730	20.70426	(1,071,024)
2021031603023	FWD	USDMXN	05/28/2021	76	20.77215	(1,578)
2021031603223	FWD	USDMXN	05/28/2021	350,000	20.72965	(7,255,376)
2021031603496	FWD	USDMXN	05/28/2021	106,324	20.71988	(2,203,020)
2021031603497	FWD	USDMXN	06/04/2021	165,598	20.7355	(3,433,754)
2021031603024	FWD	USDMXN	06/30/2021	850	20.8461	(17,719)
2021031603491	FWD	USDMXN	07/02/2021	60,126	20.79991	(1,250,613)
2021031603563	FWD	USDMXN	08/03/2021	156,000	20.93296	(3,265,541)
2021031603565	FWD	USDMXN	08/13/2021	146,000	20.95658	(3,059,661)
2021031603567	FWD	USDMXN	08/17/2021	460,000	20.96603	(9,644,375)
2021031703094	FWD	USDMXN	03/17/2021	(1,500,000)	20.66	30,990,000
2021031703233	FWD	USDMXN	03/17/2021	(30,000,000)	20.7	621,000,000
2021031703245	FWD	USDMXN	03/18/2021	(11,060,000)	20.6618	228,519,497
2021031703234	FWD	USDMXN	03/18/2021	30,000,000	20.7024	(621,072,000)
2021031703519	FWD	USDMXN	03/19/2021	(500,000)	20.38095	10,190,475
2021031703095	FWD	USDMXN	03/19/2021	1,500,000	20.6642	(30,996,300)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031703126	FWD	USDMXN	04/05/2021	(65,000)	20.73537	1,347,799
2021031703184	FWD	USDMXN	04/05/2021	(55,000)	20.74696	1,141,083
2021031703265	FWD	USDMXN	04/05/2021	2,169	20.7201	(44,952)
2021031703003	FWD	USDMXN	04/06/2021	(366,000)	20.76989	7,601,781
2021031703183	FWD	USDMXN	04/06/2021	(70,000)	20.74995	1,452,497
2021031703266	FWD	USDMXN	04/06/2021	(224)	20.71873	4,645
2021031703443	FWD	USDMXN	04/06/2021	(60,000)	20.41008	1,224,605
2021031703300	FWD	USDMXN	04/06/2021	60,000	20.5631	(1,233,786)
2021031703435	FWD	USDMXN	04/08/2021	200,000	20.56427	(4,112,855)
2021031703515	FWD	USDMXN	04/08/2021	500,000	20.53061	(10,265,305)
2021031703118	FWD	USDMXN	04/14/2021	(20,000)	20.73794	414,759
2021031703441	FWD	USDMXN	04/15/2021	6,299	20.43624	(128,726)
2021031703444	FWD	USDMXN	04/15/2021	60,000	20.43269	(1,225,961)
2021031703516	FWD	USDMXN	04/15/2021	500,000	20.50947	(10,254,735)
2021031703482	FWD	USDMXN	04/20/2021	39,900	20.43454	(815,338)
2021031703535	FWD	USDMXN	04/20/2021	25,300	20.4506	(517,400)
2021031703436	FWD	USDMXN	04/22/2021	200,000	20.59513	(4,119,026)
2021031703518	FWD	USDMXN	04/22/2021	500,000	20.50473	(10,252,363)
2021031703437	FWD	USDMXN	04/29/2021	200,000	20.61057	(4,122,113)
2021031703520	FWD	USDMXN	04/29/2021	500,000	20.47386	(10,236,930)
2021031703489	FWD	USDMXN	04/30/2021	250,000	20.43326	(5,108,316)
2021031703359	FWD	USDMXN	05/04/2021	(35,000)	20.54133	718,947
2021031703302	FWD	USDMXN	05/06/2021	95,000	20.61309	(1,958,244)
2021031703447	FWD	USDMXN	05/06/2021	1,042	20.4812	(21,334)
2021031703360	FWD	USDMXN	05/07/2021	(20,000)	20.54332	410,866
2021031703488	FWD	USDMXN	05/07/2021	250,000	20.44876	(5,112,190)
2021031703528	FWD	USDMXN	05/07/2021	500,000	20.45711	(10,228,554)
2021031703291	FWD	USDMXN	05/11/2021	(40,000)	20.65534	826,214
2021031703529	FWD	USDMXN	05/14/2021	500,000	20.59882	(10,299,412)
2021031703306	FWD	USDMXN	08/11/2021	140,000	20.81262	(2,913,767)
2021031703448	FWD	USDMXN	08/11/2021	111	20.70645	(2,299)
2021031703450	FWD	USDMXN	08/18/2021	(1,301)	20.6933	26,915
2021031703312	FWD	USDMXN	08/18/2021	80,000	20.84954	(1,667,963)
2021031703425	FWD	USDMXN	09/07/2021	4,300,000	20.93509	(90,020,883)
2021031703369	FWD	USDMXN	10/07/2021	(96,500)	20.77135	2,004,435
2021031703453	FWD	USDMXN	10/07/2021	(248)	20.80705	5,156
2021031803001	FWD	USDMXN	03/18/2021	(30,000,000)	20.55	616,500,000
2021031803027	FWD	USDMXN	03/18/2021	(9,000,000)	20.46233	184,160,983
2021031803637	FWD	USDMXN	03/18/2021	(17,000,000)	20.455	347,735,000
2021031803002	FWD	USDMXN	03/19/2021	30,000,000	20.55235	(616,570,500)
2021031803638	FWD	USDMXN	03/19/2021	17,000,000	20.4574	(347,775,800)
2021031803028	FWD	USDMXN	03/22/2021	9,000,000	20.4714	(184,242,600)
2021031803621	FWD	USDMXN	03/25/2021	500,000	20.43336	(10,216,682)
2021031803321	FWD	USDMXN	03/26/2021	(110,000)	20.44742	2,249,216
2021031803471	FWD	USDMXN	03/26/2021	(55,000)	20.3809	1,120,949
2021031803004	FWD	USDMXN	04/05/2021	(25,000)	20.57776	514,444
2021031803557	FWD	USDMXN	04/05/2021	(4,356)	20.43343	89,014
2021031803675	FWD	USDMXN	04/05/2021	(3,074)	20.50138	63,017
2021031803587	FWD	USDMXN	04/13/2021	174,000	20.51303	(3,569,268)
2021031803676	FWD	USDMXN	04/13/2021	259	20.52757	(5,323)
2021031803415	FWD	USDMXN	04/22/2021	64,155	20.44287	(1,311,514)
2021031803622	FWD	USDMXN	04/22/2021	1,500,000	20.49531	(30,742,967)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031803547	FWD	USDMXN	04/28/2021	(46,294)	20.48414	948,303
2021031803487	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.44901	(8,281,849)
2021031803677	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.55906	(18,708)
2021031803548	FWD	USDMXN	05/12/2021	(42,948)	20.51481	881,074
2021031803549	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,760)	20.54554	878,526
2021031803623	FWD	USDMXN	05/27/2021	1,500,000	20.57273	(30,859,095)
2021031803550	FWD	USDMXN	06/09/2021	(57,039)	20.57695	1,173,685
2021031803042	FWD	USDMXN	06/22/2021	115,000	20.63856	(2,373,434)
2021031803678	FWD	USDMXN	06/22/2021	535	20.67748	(11,060)
2021031803624	FWD	USDMXN	06/24/2021	1,500,000	20.63639	(30,954,585)
2021031803625	FWD	USDMXN	07/28/2021	500,000	20.71755	(10,358,777)
2021031803551	FWD	USDMXN	08/04/2021	(45,854)	20.70603	949,451
2021031803113	FWD	USDMXN	08/11/2021	150,000	20.78244	(3,117,365)
2021031803385	FWD	USDMXN	08/18/2021	(45,781)	20.75433	950,152
2021031803614	FWD	USDMXN	08/20/2021	4,422,000	20.79626	(91,961,071)
2021031803679	FWD	USDMXN	08/20/2021	652	20.81873	(13,567)
2021031803626	FWD	USDMXN	08/25/2021	500,000	20.78405	(10,392,026)
2021031803552	FWD	USDMXN	09/01/2021	(45,746)	20.7718	950,219
2021031803114	FWD	USDMXN	09/15/2021	150,000	20.86558	(3,129,837)
2021031803115	FWD	USDMXN	10/06/2021	150,000	20.91682	(3,137,523)
2021031803553	FWD	USDMXN	10/13/2021	(69,088)	20.87205	1,442,015
2021031803116	FWD	USDMXN	11/03/2021	150,000	20.9858	(3,147,871)
2021031803554	FWD	USDMXN	11/24/2021	(55,251)	20.9751	1,158,891
2021031803555	FWD	USDMXN	12/08/2021	(60,386)	21.00949	1,268,688
2021031803556	FWD	USDMXN	12/22/2021	(60,277)	21.04388	1,268,467
2021031803462	FWD	USDMXN	01/05/2022	(142,599)	21.04098	3,000,425
2021031803483	FWD	USDMXN	01/19/2022	(142,254)	21.09051	3,000,214
2021031903008	FWD	USDMXN	03/19/2021	(20,000,000)	20.33	406,600,000
2021031903252	FWD	USDMXN	03/19/2021	(30,000,000)	20.48	614,400,000
2021031903543	FWD	USDMXN	03/19/2021	500,000	20.52	(10,260,000)
2021031903009	FWD	USDMXN	03/22/2021	20,000,000	20.33688	(406,737,600)
2021031903246	FWD	USDMXN	03/23/2021	(10,000,000)	20.48016	204,801,600
2021031903544	FWD	USDMXN	03/23/2021	(500,000)	20.5296	10,264,800
2021031903183	FWD	USDMXN	03/23/2021	374,000	20.49054	(7,663,462)
2021031903253	FWD	USDMXN	03/23/2021	30,000,000	20.4892	(614,676,000)
2021031903184	FWD	USDMXN	03/26/2021	(374,000)	20.49683	7,665,815
2021031903441	FWD	USDMXN	04/05/2021	(2,955)	20.53614	60,676
2021031903152	FWD	USDMXN	04/08/2021	150,000	20.37536	(3,056,305)
2021031903079	FWD	USDMXN	04/09/2021	50,000	20.46504	(1,023,252)
2021031903258	FWD	USDMXN	04/09/2021	3,919	20.54951	(80,542)
2021031903081	FWD	USDMXN	04/12/2021	400,000	20.47447	(8,189,787)
2021031903259	FWD	USDMXN	04/12/2021	7,392	20.55623	(151,951)
2021031903082	FWD	USDMXN	04/21/2021	220,000	20.50413	(4,510,909)
2021031903260	FWD	USDMXN	04/21/2021	2,726	20.57438	(56,088)
2021031903083	FWD	USDMXN	04/22/2021	500,000	20.50834	(10,254,168)
2021031903084	FWD	USDMXN	04/22/2021	23,000	20.50896	(471,706)
2021031903153	FWD	USDMXN	04/22/2021	150,000	20.40544	(3,060,817)
2021031903261	FWD	USDMXN	04/22/2021	86	20.57591	(1,771)
2021031903154	FWD	USDMXN	04/29/2021	150,000	20.42081	(3,063,121)
2021031903165	FWD	USDMXN	05/06/2021	100,000	20.41638	(2,041,638)
2021031903166	FWD	USDMXN	05/13/2021	100,000	20.43197	(2,043,197)
2021031903167	FWD	USDMXN	05/20/2021	100,000	20.44756	(2,044,756)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031903168	FWD	USDMXN	05/27/2021	100,000	20.46314	(2,046,314)
2021031903247	FWD	USDMXN	03/18/2022	10,000,000	21.34568	(213,456,790)
2021032203043	FWD	USDMXN	03/22/2021	(9,000,000)	20.63813	185,743,201
2021032203380	FWD	USDMXN	03/22/2021	500,000	20.57	(10,285,000)
2021032203381	FWD	USDMXN	03/23/2021	(500,000)	20.5724	10,286,200
2021032203044	FWD	USDMXN	03/26/2021	9,000,000	20.64736	(185,826,205)
2021032203039	FWD	USDMXN	04/05/2021	(110,000)	20.67156	2,273,872
2021032203040	FWD	USDMXN	04/05/2021	(5,000)	20.66735	103,337
2021032203083	FWD	USDMXN	04/05/2021	(20,000)	20.59505	411,901
2021032203158	FWD	USDMXN	04/05/2021	(33,000)	20.60035	679,812
2021032203173	FWD	USDMXN	04/05/2021	(1,173)	20.60574	24,172
2021032203255	FWD	USDMXN	04/05/2021	(90,000)	20.59567	1,853,610
2021032203374	FWD	USDMXN	04/05/2021	(892)	20.59805	18,378
2021032203170	FWD	USDMXN	04/06/2021	(236,000)	20.59968	4,861,526
2021032203363	FWD	USDMXN	04/20/2021	32,500	20.63613	(670,674)
2021032203386	FWD	USDMXN	04/27/2021	22,550	20.64079	(465,450)
2021032203172	FWD	USDMXN	04/30/2021	(1,173)	20.65882	24,235
2021032203167	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.71428	(8,389,285)
2021032203168	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.66227	(18,803)
2021032203174	FWD	USDMXN	04/30/2021	1,173	20.66089	(24,237)
2021032203365	FWD	USDMXN	05/04/2021	18,000	20.66682	(372,003)
2021032203364	FWD	USDMXN	05/18/2021	50,000	20.69789	(1,034,895)
2021032303065	FWD	USDMXN	03/23/2021	(5,000,000)	20.57485	102,874,255
2021032303034	FWD	USDMXN	03/23/2021	1,500,000	20.62	(30,930,000)
2021032303237	FWD	USDMXN	03/24/2021	(60,000,000)	20.69	1,241,400,000
2021032303036	FWD	USDMXN	03/24/2021	1,500,000	20.62	(30,930,000)
2021032303037	FWD	USDMXN	03/25/2021	(1,500,000)	20.6224	30,933,600
2021032303238	FWD	USDMXN	03/25/2021	60,000,000	20.69233	(1,241,539,500)
2021032303502	FWD	USDMXN	03/25/2021	244,000	20.81118	(5,077,928)
2021032303504	FWD	USDMXN	03/25/2021	581,000	20.81031	(12,090,790)
2021032303035	FWD	USDMXN	03/26/2021	(1,500,000)	20.6272	30,940,800
2021032303503	FWD	USDMXN	03/30/2021	(244,000)	20.8216	5,080,471
2021032303091	FWD	USDMXN	04/05/2021	(15,000)	20.60694	309,104
2021032303194	FWD	USDMXN	04/05/2021	(20,000)	20.72188	414,438
2021032303363	FWD	USDMXN	04/05/2021	(17,000)	20.72291	352,290
2021032303386	FWD	USDMXN	04/05/2021	(87)	20.76963	1,797
2021032303464	FWD	USDMXN	04/05/2021	(17,000)	20.78372	353,323
2021032303476	FWD	USDMXN	04/05/2021	(545)	20.79404	11,335
2021032303505	FWD	USDMXN	04/05/2021	(581,000)	20.83336	12,104,179
2021032303223	FWD	USDMXN	04/27/2021	19,400	20.74513	(402,456)
2021032303374	FWD	USDMXN	04/28/2021	(18,000,000)	20.8041	374,473,800
2021032303376	FWD	USDMXN	04/28/2021	(242,305)	20.81223	5,042,906
2021032303119	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.69144	(8,380,034)
2021032303477	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.86842	(18,989)
2021032303043	FWD	USDMXN	06/03/2021	114,000	20.78956	(2,370,010)
2021032303478	FWD	USDMXN	06/03/2021	467	20.9539	(9,783)
2021032303046	FWD	USDMXN	06/04/2021	114,000	20.7882	(2,369,855)
2021032303479	FWD	USDMXN	06/04/2021	641	20.9553	(13,425)
2021032303050	FWD	USDMXN	06/07/2021	114,000	20.7553	(2,366,105)
2021032303480	FWD	USDMXN	06/07/2021	527	20.96325	(11,046)
2021032303053	FWD	USDMXN	06/09/2021	221,000	20.76195	(4,588,391)
2021032303481	FWD	USDMXN	06/09/2021	789	20.96623	(16,533)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021032303387	FWD	USDMXN	06/11/2021	(60)	20.92123	1,258
2021032303059	FWD	USDMXN	06/11/2021	111,000	20.74737	(2,302,958)
2021032303385	FWD	USDMXN	06/30/2021	(2,127)	20.96176	44,593
2021032303335	FWD	USDMXN	06/30/2021	7,400,000	20.93759	(154,938,166)
2021032403080	FWD	USDMXN	03/26/2021	1,000,000	20.76122	(20,761,220)
2021032403561	FWD	USDMXN	03/26/2021	183,000	20.96027	(3,835,729)
2021032403563	FWD	USDMXN	03/26/2021	274,000	20.96035	(5,743,136)
2021032403565	FWD	USDMXN	03/26/2021	148,000	20.96035	(3,102,132)
2021032403244	FWD	USDMXN	04/05/2021	(15,000)	20.81573	312,236
2021032403389	FWD	USDMXN	04/05/2021	999	20.87255	(20,851)
2021032403040	FWD	USDMXN	04/07/2021	(110,000)	20.87566	2,296,323
2021032403057	FWD	USDMXN	04/07/2021	7,910	20.79411	(164,474)
2021032403230	FWD	USDMXN	04/08/2021	(87,069)	20.81165	1,812,055
2021032403440	FWD	USDMXN	04/08/2021	(13,000)	20.91853	271,941
2021032403503	FWD	USDMXN	04/08/2021	(63,300)	20.96108	1,326,836
2021032403523	FWD	USDMXN	04/08/2021	(82,800)	20.9753	1,736,755
2021032403553	FWD	USDMXN	04/08/2021	(55,000)	20.98908	1,154,399
2021032403559	FWD	USDMXN	04/08/2021	(90,000)	20.99258	1,889,332
2021032403562	FWD	USDMXN	04/08/2021	(183,000)	20.98712	3,840,642
2021032403564	FWD	USDMXN	04/09/2021	(274,000)	20.98932	5,751,073
2021032403566	FWD	USDMXN	04/12/2021	(148,000)	20.9959	3,107,393
2021032403091	FWD	USDMXN	04/22/2021	(500,000)	20.89318	10,446,590
2021032403231	FWD	USDMXN	04/22/2021	(87,015)	20.84254	1,813,611
2021032403081	FWD	USDMXN	04/29/2021	(1,000,000)	20.83508	20,835,084
2021032403032	FWD	USDMXN	04/30/2021	(50,000)	20.95883	1,047,941
2021032403202	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.83424	(8,437,867)
2021032403253	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.8759	(18,997)
2021032403378	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.90435	(8,466,263)
2021032403390	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.92936	(19,045)
2021032403100	FWD	USDMXN	05/19/2021	76,155	20.90087	(1,591,706)
2021032403092	FWD	USDMXN	05/27/2021	(500,000)	20.97353	10,486,766
2021032403232	FWD	USDMXN	06/10/2021	(40,050)	20.95326	839,180
2021032403101	FWD	USDMXN	06/16/2021	83,901	20.96493	(1,758,979)
2021032403093	FWD	USDMXN	06/24/2021	(500,000)	21.03655	10,518,276
2021032403139	FWD	USDMXN	06/24/2021	(39,974)	20.98683	838,922
2021032403233	FWD	USDMXN	07/08/2021	(79,765)	21.01872	1,676,566
2021032403102	FWD	USDMXN	07/14/2021	87,195	21.03381	(1,834,043)
2021032403158	FWD	USDMXN	07/22/2021	(79,621)	21.06742	1,677,419
2021032403094	FWD	USDMXN	07/28/2021	(500,000)	21.12025	10,560,125
2021032403103	FWD	USDMXN	08/18/2021	80,887	21.12402	(1,708,659)
2021032403095	FWD	USDMXN	08/25/2021	(500,000)	21.19102	10,595,510
2021032403168	FWD	USDMXN	08/26/2021	(80,991)	21.13058	1,711,388
2021032403104	FWD	USDMXN	09/15/2021	64,856	21.196	(1,374,688)
2021032403238	FWD	USDMXN	09/23/2021	(64,599)	21.20852	1,370,050
2021032403239	FWD	USDMXN	10/07/2021	(94,784)	21.24476	2,013,666
2021032403105	FWD	USDMXN	10/13/2021	70,064	21.26873	(1,490,172)
2021032403214	FWD	USDMXN	11/10/2021	(85,247)	21.35128	1,820,136
2021032403106	FWD	USDMXN	11/17/2021	88,464	21.35929	(1,889,528)
2021032403247	FWD	USDMXN	11/24/2021	(85,000)	21.39879	1,818,897
2021032403252	FWD	USDMXN	11/24/2021	(60)	21.38057	1,280
2021032403107	FWD	USDMXN	12/15/2021	110,238	21.43184	(2,362,603)
2021032403264	FWD	USDMXN	01/13/2022	(117,000)	21.5207	2,517,922

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021032403266	FWD	USDMXN	01/13/2022	(90)	21.55207	1,937
2021032403265	FWD	USDMXN	01/27/2022	(116,862)	21.56129	2,519,690
2021032403320	FWD	USDMXN	02/24/2022	(122,658)	21.68201	2,659,470
2021032403321	FWD	USDMXN	03/10/2022	(162,342)	21.72183	3,526,368
2021032403323	FWD	USDMXN	03/10/2022	(930)	21.72914	20,202
2021032503475	FWD	USDMXN	03/25/2021	(20,000,000)	20.7	414,000,000
2021032503476	FWD	USDMXN	03/26/2021	20,000,000	20.7024	(414,048,000)
2021032503488	FWD	USDMXN	03/29/2021	1,000,000	20.71061	(20,710,610)
2021032503489	FWD	USDMXN	03/31/2021	(1,000,000)	20.71428	20,714,280
2021032503090	FWD	USDMXN	04/05/2021	(400,000)	20.79634	8,318,535
2021032503379	FWD	USDMXN	04/05/2021	(400,000)	20.72412	8,289,648
2021032503171	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.84039	(8,336,158)
2021032503243	FWD	USDMXN	04/05/2021	290,000	20.78545	(6,027,781)
2021032503249	FWD	USDMXN	04/05/2021	110,000	20.74606	(2,282,067)
2021032503185	FWD	USDMXN	04/08/2021	(32,000)	20.77667	664,853
2021032503376	FWD	USDMXN	04/08/2021	(55,000)	20.7383	1,140,607
2021032503445	FWD	USDMXN	04/08/2021	(81)	20.72301	1,678
2021032503195	FWD	USDMXN	04/08/2021	1,407	20.77863	(29,227)
2021032503201	FWD	USDMXN	04/08/2021	875	20.77589	(18,176)
2021032503529	FWD	USDMXN	04/09/2021	(166,000)	20.66522	3,430,427
2021032503598	FWD	USDMXN	04/09/2021	(811)	20.72166	16,803
2021032503236	FWD	USDMXN	04/27/2021	85,000	20.83479	(1,770,957)
2021032503628	FWD	USDMXN	04/27/2021	38,800	20.74085	(804,745)
2021032503237	FWD	USDMXN	05/11/2021	25,000	20.86657	(521,664)
2021032503408	FWD	USDMXN	05/12/2021	(42,357)	20.82918	882,254
2021032503239	FWD	USDMXN	05/18/2021	45,000	20.84321	(937,944)
2021032503407	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,208)	20.8602	880,473
2021032503424	FWD	USDMXN	06/24/2021	229,000	20.93924	(4,795,086)
2021032503444	FWD	USDMXN	06/24/2021	358	20.90578	(7,483)
2021032503409	FWD	USDMXN	08/18/2021	(45,116)	21.05622	949,965
2021032503446	FWD	USDMXN	08/19/2021	(458)	21.03074	9,635
2021032503433	FWD	USDMXN	08/19/2021	464,000	21.07187	(9,777,346)
2021032503410	FWD	USDMXN	09/29/2021	(76,427)	21.15726	1,616,991
2021032503411	FWD	USDMXN	10/13/2021	(68,051)	21.19205	1,442,146
2021032503412	FWD	USDMXN	10/27/2021	(67,981)	21.22684	1,443,015
2021032503413	FWD	USDMXN	11/10/2021	(54,548)	21.26243	1,159,829
2021032503374	FWD	USDMXN	11/24/2021	(54,446)	21.27798	1,158,495
2021032503414	FWD	USDMXN	12/08/2021	(59,404)	21.33363	1,267,297
2021032503415	FWD	USDMXN	12/22/2021	(59,245)	21.36897	1,266,012
2021032503421	FWD	USDMXN	01/05/2022	(140,128)	21.40644	2,999,641
2021032503420	FWD	USDMXN	01/19/2022	(139,847)	21.44677	2,999,269
2021032503393	FWD	USDMXN	02/16/2022	(126,453)	21.52108	2,721,401
2021032603008	FWD	USDMXN	03/26/2021	(36,000,000)	20.545	739,620,000
2021032603227	FWD	USDMXN	03/26/2021	1,500,000	20.58	(30,870,000)
2021032603511	FWD	USDMXN	03/26/2021	15,000,000	20.58	(308,700,000)
2021032603512	FWD	USDMXN	03/29/2021	(15,000,000)	20.5869	308,803,500
2021032603009	FWD	USDMXN	03/29/2021	36,000,000	20.55218	(739,878,300)
2021032603485	FWD	USDMXN	03/30/2021	(635,000)	20.59081	13,075,164
2021032603489	FWD	USDMXN	03/30/2021	(60,000)	20.59612	1,235,767
2021032603493	FWD	USDMXN	03/30/2021	(204,273)	20.59783	4,207,580
2021032603495	FWD	USDMXN	03/30/2021	(149,171)	20.59981	3,072,894
2021032603498	FWD	USDMXN	03/30/2021	(226,490)	20.6007	4,665,853

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021032603402	FWD	USDMXN	03/30/2021	100,000	20.59227	(2,059,227)
2021032603228	FWD	USDMXN	03/31/2021	(1,500,000)	20.5915	30,887,250
2021032603291	FWD	USDMXN	04/05/2021	(400,000)	20.55581	8,222,322
2021032603403	FWD	USDMXN	04/05/2021	(100,000)	20.60459	2,060,459
2021032603193	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.61272	(8,245,088)
2021032603195	FWD	USDMXN	04/08/2021	250,000	20.6079	(5,151,976)
2021032603069	FWD	USDMXN	04/09/2021	(33,000)	20.59111	679,507
2021032603360	FWD	USDMXN	04/09/2021	(733)	20.60327	15,106
2021032603292	FWD	USDMXN	04/09/2021	50,000	20.62952	(1,031,476)
2021032603294	FWD	USDMXN	04/14/2021	50,000	20.64093	(1,032,047)
2021032603293	FWD	USDMXN	04/19/2021	50,000	20.65226	(1,032,613)
2021032603295	FWD	USDMXN	04/20/2021	50,000	20.65453	(1,032,726)
2021032603196	FWD	USDMXN	04/22/2021	250,000	20.63943	(5,159,857)
2021032603296	FWD	USDMXN	04/22/2021	50,000	20.65899	(1,032,950)
2021032603298	FWD	USDMXN	04/27/2021	50,000	20.67015	(1,033,508)
2021032603197	FWD	USDMXN	04/29/2021	250,000	20.65494	(5,163,735)
2021032603297	FWD	USDMXN	05/11/2021	50,000	20.70172	(1,035,086)
2021032603299	FWD	USDMXN	05/25/2021	50,000	20.73382	(1,036,691)
2021032603486	FWD	USDMXN	05/28/2021	635,000	20.72344	(13,159,381)
2021032603490	FWD	USDMXN	06/30/2021	60,000	20.80643	(1,248,386)
2021032603494	FWD	USDMXN	10/15/2021	204,273	21.07048	(4,304,129)
2021032603496	FWD	USDMXN	11/16/2021	149,171	21.15627	(3,155,902)
2021032603499	FWD	USDMXN	12/15/2021	226,490	21.23311	(4,809,088)
2021032903005	FWD	USDMXN	03/29/2021	(4,824,392)	20.728	100,000,000
2021032903007	FWD	USDMXN	03/29/2021	(20,000,000)	20.7575	415,150,000
2021032903018	FWD	USDMXN	03/29/2021	(15,000,000)	20.72	310,800,000
2021032903189	FWD	USDMXN	03/29/2021	(50,000,000)	20.57	1,028,500,000
2021032903173	FWD	USDMXN	03/29/2021	35,000,000	20.578	(720,230,000)
2021032903198	FWD	USDMXN	03/29/2021	2,500,000	20.58	(51,450,000)
2021032903174	FWD	USDMXN	03/30/2021	(35,000,000)	20.58023	720,308,050
2021032903006	FWD	USDMXN	03/30/2021	4,823,869	20.73025	(100,000,000)
2021032903008	FWD	USDMXN	03/30/2021	20,000,000	20.75975	(415,195,000)
2021032903019	FWD	USDMXN	03/30/2021	15,000,000	20.7223	(310,834,500)
2021032903190	FWD	USDMXN	03/30/2021	50,000,000	20.5721	(1,028,605,000)
2021032903201	FWD	USDMXN	03/30/2021	2,000,000	20.58	(41,160,000)
2021032903202	FWD	USDMXN	03/31/2021	(2,000,000)	20.5824	41,164,800
2021032903199	FWD	USDMXN	04/05/2021	(2,500,000)	20.5963	51,490,750
2021032903142	FWD	USDMXN	04/07/2021	(400,000)	20.72785	8,291,139
2021032903032	FWD	USDMXN	04/07/2021	400,000	20.75076	(8,300,304)
2021032903009	FWD	USDMXN	04/09/2021	(58,000)	20.74513	1,203,218
2021032903334	FWD	USDMXN	04/09/2021	(514)	20.64319	10,605
2021032903374	FWD	USDMXN	04/09/2021	(61,000)	20.64004	1,259,042
2021032903459	FWD	USDMXN	04/09/2021	(13,000)	20.62276	268,096
2021032903383	FWD	USDMXN	04/12/2021	(217,000)	20.64632	4,480,251
2021032903436	FWD	USDMXN	04/12/2021	(1,097)	20.65565	22,664
2021032903396	FWD	USDMXN	04/15/2021	200,000	20.66414	(4,132,827)
2021032903422	FWD	USDMXN	04/27/2021	87,500	20.67069	(1,808,686)
2021032903423	FWD	USDMXN	05/18/2021	26,000	20.71808	(538,670)
2021033003010	FWD	USDMXN	03/30/2021	(20,000,000)	20.605	412,100,000
2021033003030	FWD	USDMXN	03/30/2021	(10,000,000)	20.615	206,150,000
2021033003439	FWD	USDMXN	03/31/2021	(68,000,000)	20.55	1,397,400,000
2021033003011	FWD	USDMXN	03/31/2021	20,000,000	20.6073	(412,146,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021033003031	FWD	USDMXN	03/31/2021	10,000,000	20.6173	(206,173,000)
2021033003384	FWD	USDMXN	04/05/2021	(425,165)	20.56755	8,744,611
2021033003468	FWD	USDMXN	04/05/2021	(405,910)	20.56173	8,346,212
2021033003440	FWD	USDMXN	04/05/2021	68,000,000	20.5613	(1,398,168,400)
2021033003545	FWD	USDMXN	04/08/2021	(243,179)	20.57282	5,002,878
2021033003202	FWD	USDMXN	04/09/2021	(10,000)	20.62502	206,250
2021033003242	FWD	USDMXN	04/09/2021	(1,083)	20.62458	22,336
2021033003542	FWD	USDMXN	04/09/2021	(243,000)	20.56769	4,997,947
2021033003603	FWD	USDMXN	04/09/2021	(191)	20.58447	3,925
2021033003469	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,910	20.61938	(8,369,613)
2021033003373	FWD	USDMXN	05/06/2021	150,000	20.63389	(3,095,083)
2021033003372	FWD	USDMXN	05/13/2021	150,000	20.6496	(3,097,440)
2021033003374	FWD	USDMXN	05/20/2021	150,000	20.66538	(3,099,807)
2021033003375	FWD	USDMXN	05/27/2021	150,000	20.68124	(3,102,186)
2021033003385	FWD	USDMXN	06/30/2021	425,165	20.76684	(8,829,342)
2021033003223	FWD	USDMXN	01/13/2022	(118,189)	21.31746	2,519,479
2021033003224	FWD	USDMXN	01/27/2022	(117,940)	21.36255	2,519,489
2021033003228	FWD	USDMXN	02/10/2022	(124,280)	21.40134	2,659,762
2021033003243	FWD	USDMXN	02/24/2022	(378)	21.43756	8,112
2021033003462	FWD	USDMXN	02/24/2022	(123,629)	21.39001	2,644,434
2021033003455	FWD	USDMXN	03/02/2022	(111,000)	21.39795	2,375,173
2021033003466	FWD	USDMXN	03/02/2022	(397)	21.40208	8,490
2021033003230	FWD	USDMXN	03/10/2022	(165,000)	21.46906	3,542,395
2021033003235	FWD	USDMXN	03/10/2022	(61)	21.48277	1,300
2021033003239	FWD	USDMXN	03/10/2022	(158)	21.4779	3,401
2021033003231	FWD	USDMXN	03/24/2022	(164,000)	21.51161	3,527,904
2021033003233	FWD	USDMXN	03/24/2022	(720)	21.52116	15,492
2021033003240	FWD	USDMXN	03/24/2022	(192)	21.51727	4,126
2021033003457	FWD	USDMXN	03/30/2022	(110,000)	21.48069	2,362,877
2021033003467	FWD	USDMXN	03/30/2022	(961)	21.48099	20,645
2021033103036	FWD	USDMXN	03/31/2021	(35,000,000)	20.45	715,750,000
2021033103257	FWD	USDMXN	03/31/2021	(75,000,000)	20.42	1,531,500,000
2021033103213	FWD	USDMXN	03/31/2021	8,414,873	20.44	(172,000,000)
2021033103237	FWD	USDMXN	03/31/2021	11,733,073	20.455	(240,000,000)
2021033103244	FWD	USDMXN	03/31/2021	30,000,000	20.45	(613,500,000)
2021033103246	FWD	USDMXN	03/31/2021	20,000,000	20.45	(409,000,000)
2021033103423	FWD	USDMXN	03/31/2021	3,500,000	20.46	(71,610,000)
2021033103214	FWD	USDMXN	04/05/2021	(8,410,264)	20.4512	172,000,000
2021033103238	FWD	USDMXN	04/05/2021	(11,726,652)	20.4662	240,000,000
2021033103245	FWD	USDMXN	04/05/2021	(30,000,000)	20.461	613,830,000
2021033103247	FWD	USDMXN	04/05/2021	(20,000,000)	20.461	409,220,000
2021033103424	FWD	USDMXN	04/05/2021	(3,500,000)	20.472	71,652,000
2021033103447	FWD	USDMXN	04/05/2021	(10,000,000)	20.45	204,500,000
2021033103037	FWD	USDMXN	04/05/2021	35,000,000	20.46135	(716,147,250)
2021033103258	FWD	USDMXN	04/05/2021	75,000,000	20.43	(1,532,250,000)
2021033103431	FWD	USDMXN	04/05/2021	6,000,000	20.46	(122,760,000)
2021033103293	FWD	USDMXN	04/06/2021	(311,820)	20.43436	6,371,842
2021033103387	FWD	USDMXN	04/06/2021	(150,000)	20.45827	3,068,741
2021033103390	FWD	USDMXN	04/06/2021	(150,000)	20.45827	3,068,741
2021033103392	FWD	USDMXN	04/06/2021	(150,000)	20.45827	3,068,741
2021033103394	FWD	USDMXN	04/06/2021	(150,000)	20.45827	3,068,741
2021033103432	FWD	USDMXN	04/06/2021	(6,000,000)	20.4624	122,774,400

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021033103448	FWD	USDMXN	04/06/2021	10,000,000	20.4525	(204,525,000)
2021033103093	FWD	USDMXN	04/12/2021	(273,256)	20.44848	5,587,670
2021033103094	FWD	USDMXN	04/13/2021	(488,000)	20.45061	9,979,898
2021033103306	FWD	USDMXN	04/13/2021	(1,237)	20.45258	25,296
2021033103512	FWD	USDMXN	04/13/2021	(48,000)	20.428	980,544
2021033103526	FWD	USDMXN	04/13/2021	(894)	20.42512	18,263
2021033103295	FWD	USDMXN	04/22/2021	200,000	20.48666	(4,097,332)
2021033103384	FWD	USDMXN	04/22/2021	500,000	20.56375	(10,281,877)
2021033103294	FWD	USDMXN	04/30/2021	311,820	20.48881	(6,388,821)
2021033103544	FWD	USDMXN	05/03/2021	100,000	20.49256	(2,049,257)
2021033103129	FWD	USDMXN	05/06/2021	300,000	20.51199	(6,153,598)
2021033103388	FWD	USDMXN	05/06/2021	150,000	20.52597	(3,078,896)
2021033103391	FWD	USDMXN	05/13/2021	150,000	20.5416	(3,081,240)
2021033103393	FWD	USDMXN	05/20/2021	150,000	20.55773	(3,083,660)
2021033103383	FWD	USDMXN	05/27/2021	500,000	20.64213	(10,321,065)
2021033103395	FWD	USDMXN	05/27/2021	150,000	20.57369	(3,086,054)
2021033103382	FWD	USDMXN	06/24/2021	500,000	20.70657	(10,353,287)
2021033103385	FWD	USDMXN	07/28/2021	500,000	20.78847	(10,394,236)
2021033103386	FWD	USDMXN	08/25/2021	500,000	20.85683	(10,428,414)

Liquidados anticipadamente

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
P14631	Cap	04/02/2021	Buy	U	mex					350,000,000
P14632	Cap	04/02/2021	Sell	U	mex					350,000,000
P14634	Cap	04/02/2021	Sell	U	mex					350,000,000
P14635	Cap	04/02/2021	Buy	U	mex					350,000,000
P16767	Cap	29/04/2021	Sell	U	mex					10,000,000
P16768	Cap	29/04/2021	Sell	U	mex					10,000,000
P16769	Cap	29/04/2021	Buy	U	mex					10,000,000
P16811	Cap	09/05/2021	Sell	U	mex					10,000,000
P16812	Cap	09/05/2021	Buy	U	mex					10,000,000
P16813	Cap	09/05/2021	Sell	U	mex					10,000,000
P16384	Cap	31/08/2023	Sell	U	mex					27,669,561
P16385	Cap	31/08/2023	Sell	U	mex					27,669,561
P16386	Cap	31/08/2023	Buy	U	mex					27,669,561
P16387	Cap	31/08/2023	Buy	U	mex					50,000,000
P16388	Cap	31/08/2023	Sell	U	mex					22,330,439
P16389	Cap	31/08/2023	Sell	U	mex					22,330,439
P16390	Cap	31/08/2023	Buy	U	mex					22,330,439
C55909	CC Swap	24/10/2022	Buy	U	usd	1,000,000	usd	19,140,000	mex	
C55910	CC Swap	24/10/2022	Buy	U	usd	19,140,000	mex	1,000,000	usd	
C65843	CC Swap	01/09/2025	Buy	U	usd	1	usd	3,635	cop	
C65927	CC Swap	01/09/2025	Buy	U	usd	1	usd	3,598	cop	
C59643	CC Swap	21/01/2026	Buy	U	usd	10,000,000	usd	243,500,000	mex	
C59752	CC Swap	21/01/2026	Buy	U	usd	15,000,000	usd	360,450,000	mex	
C59939	CC Swap	21/01/2026	Buy	U	usd	10,000,000	usd	243,400,000	mex	
C59952	CC Swap	21/01/2026	Buy	U	usd	10,000,000	usd	247,900,000	mex	
C59958	CC Swap	21/01/2026	Buy	U	usd	25,000,000	usd	610,250,000	mex	
C59906	CC Swap	11/01/2028	Buy	U	usd	20,000,000	usd	478,800,000	mex	
E65263	Eq Option	06/04/2021	Buy	U	mex					71,691,500

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
E65264	Eq Option	06/04/2021	Sell	U	mex					71,691,500
E65265	Eq Option	06/04/2021	Buy	U	mex					71,691,500
E65266	Eq Option	06/04/2021	Sell	U	mex					71,691,500
E68018	Eq Option	02/02/2022	Buy	U	mex					89,440,000
P14633	Floor	04/02/2021	Buy	U	mex					350,000,000
P14636	Floor	04/02/2021	Sell	U	mex					350,000,000
SAE187	SC Swap	28/01/2021	Buy	U	mex	11,250,000	mex	11,250,000	mex	
SAE238	SC Swap	28/01/2021	Buy	U	mex	11,250,000	mex	11,250,000	mex	
SU7281	SC Swap	19/02/2021	Buy	U	mex	22,600,000	mex	22,600,000	mex	
SU9578	SC Swap	19/02/2021	Buy	U	mex	22,600,000	mex	22,600,000	mex	
SX6075	SC Swap	01/03/2021	Buy	U	mex	225,000,000	mex	225,000,000	mex	
SAE522	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	mex	12,206,667	mex	12,206,667	mex	
SAE557	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	mex	12,206,667	mex	12,206,667	mex	
SAE558	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	mex	12,206,667	mex	12,206,667	mex	
SU6819	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	mex	14,200,000	mex	14,200,000	mex	
SU9625	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	mex	14,200,000	mex	14,200,000	mex	
SBO941	SC Swap	08/03/2021	Buy	U	usm	331,063	usm	331,063	usm	
SBQ911	SC Swap	08/03/2021	Buy	U	usm	331,063	usm	331,063	usm	
SX5673	SC Swap	12/03/2021	Buy	U	mex	8,146,930	mex	8,146,930	mex	
SX5687	SC Swap	12/03/2021	Buy	U	mex	8,146,930	mex	8,146,930	mex	
SX9025	SC Swap	26/03/2021	Buy	U	mex	1,248,950	mex	1,248,950	mex	
SX9049	SC Swap	26/03/2021	Buy	U	mex	1,248,950	mex	1,248,950	mex	
SAN828	SC Swap	29/03/2021	Buy	U	mex	1,773,354	mex	1,773,354	mex	
SAN836	SC Swap	29/03/2021	Buy	U	mex	1,773,354	mex	1,773,354	mex	
SU6288	SC Swap	31/03/2021	Buy	U	mex	15,000,000	mex	15,000,000	mex	
SU9585	SC Swap	31/03/2021	Buy	U	mex	15,000,000	mex	15,000,000	mex	
SCD642	SC Swap	03/04/2021	Buy	U	mex	15,000,000	mex	15,000,000	mex	
SCD677	SC Swap	03/04/2021	Buy	U	mex	15,000,000	mex	15,000,000	mex	
SCR872	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	mex	9,873,252	mex	9,873,252	mex	
SCR873	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	mex	9,873,252	mex	9,873,252	mex	
SCR874	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	mex	42,290,357	mex	42,290,357	mex	
SCR875	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	mex	42,290,357	mex	42,290,357	mex	
SCS010	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	mex	17,143,865	mex	17,143,865	mex	
SCS011	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	mex	17,143,865	mex	17,143,865	mex	
SCZ475	SC Swap	30/09/2021	Buy	U	usm	234,217	usm	234,217	usm	
SCZ483	SC Swap	30/09/2021	Buy	U	usm	376,498	usm	376,498	usm	
SCZ501	SC Swap	30/09/2021	Buy	U	usm	219,752	usm	219,752	usm	
SCJ133	SC Swap	29/11/2021	Buy	U	mex	90,277,778	mex	90,277,778	mex	
SCJ134	SC Swap	29/11/2021	Buy	U	mex	90,277,778	mex	90,277,778	mex	
SCR359	SC Swap	30/11/2021	Buy	U	mex	176,113,834	mex	176,113,834	mex	
SCR362	SC Swap	30/11/2021	Buy	U	mex	176,113,834	mex	176,113,834	mex	
SCR845	SC Swap	30/11/2021	Buy	U	mex	40,000,000	mex	40,000,000	mex	
SCR846	SC Swap	30/11/2021	Buy	U	mex	27,000,000	mex	27,000,000	mex	
SCR862	SC Swap	30/11/2021	Buy	U	mex	40,000,000	mex	40,000,000	mex	
SCR863	SC Swap	30/11/2021	Buy	U	mex	27,000,000	mex	27,000,000	mex	
SCS007	SC Swap	30/11/2021	Buy	U	mex	6,745,852	mex	6,745,852	mex	
SCS008	SC Swap	30/11/2021	Buy	U	mex	6,745,852	mex	6,745,852	mex	
SDF147	SC Swap	16/02/2022	Buy	U	mex	205,000,000	mex	205,000,000	mex	
SDF149	SC Swap	16/02/2022	Buy	U	mex	205,000,000	mex	205,000,000	mex	
SDD737	SC Swap	28/03/2022	Buy	U	mex	1,500,000,000	mex	1,500,000,000	mex	
SDD738	SC Swap	28/03/2022	Buy	U	mex	1,500,000,000	mex	1,500,000,000	mex	
SX6094	SC Swap	28/03/2022	Buy	U	mex	1,500,000,000	mex	1,500,000,000	mex	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SX6168	SC Swap	28/03/2022	Buy	U	mex	1,500,000,000	mex	1,500,000,000	mex	
SX6090	SC Swap	26/04/2022	Buy	U	mex	1,000,000,000	mex	1,000,000,000	mex	
SX6124	SC Swap	26/04/2022	Buy	U	mex	1,000,000,000	mex	1,000,000,000	mex	
SCY652	SC Swap	17/05/2022	Buy	U	mex	2,000,000,000	mex	2,000,000,000	mex	
SCY653	SC Swap	17/05/2022	Buy	U	mex	2,000,000,000	mex	2,000,000,000	mex	
SX6091	SC Swap	17/05/2022	Buy	U	mex	2,000,000,000	mex	2,000,000,000	mex	
SX6079	SC Swap	27/05/2022	Buy	U	mex	207,500,000	mex	207,500,000	mex	
SX6083	SC Swap	27/05/2022	Buy	U	mex	207,500,000	mex	207,500,000	mex	
SX6086	SC Swap	27/05/2022	Buy	U	mex	207,500,000	mex	207,500,000	mex	
SCF571	SC Swap	22/09/2022	Buy	U	mex	82,000,000	mex	82,000,000	mex	
SCF572	SC Swap	22/09/2022	Buy	U	mex	82,000,000	mex	82,000,000	mex	
SAE786	SC Swap	30/11/2022	Buy	U	mex	173,000,000	mex	173,000,000	mex	
SCJ175	SC Swap	30/11/2022	Buy	U	mex	173,000,000	mex	173,000,000	mex	
SCJ177	SC Swap	30/11/2022	Buy	U	mex	173,000,000	mex	173,000,000	mex	
SW9569	SC Swap	01/02/2023	Buy	U	mex	20,000,000	mex	20,000,000	mex	
SW9585	SC Swap	01/02/2023	Buy	U	mex	20,000,000	mex	20,000,000	mex	
SDI536	SC Swap	08/03/2023	Buy	U	mex	110,000,000	mex	110,000,000	mex	
SDI537	SC Swap	08/03/2023	Buy	U	mex	110,000,000	mex	110,000,000	mex	
SDK139	SC Swap	16/03/2023	Buy	U	mex	215,000,000	mex	215,000,000	mex	
SDK140	SC Swap	16/03/2023	Buy	U	mex	215,000,000	mex	215,000,000	mex	
SCD460	SC Swap	31/05/2023	Buy	U	mex	231,500,000	mex	231,500,000	mex	
SCH821	SC Swap	15/06/2023	Buy	U	mex	147,500,000	mex	147,500,000	mex	
SCH980	SC Swap	15/06/2023	Buy	U	mex	147,500,000	mex	147,500,000	mex	
SAE277	SC Swap	28/06/2023	Buy	U	mex	75,763,057	mex	75,763,057	mex	
SCD818	SC Swap	28/06/2023	Buy	U	mex	75,763,057	mex	75,763,057	mex	
SCD855	SC Swap	28/06/2023	Buy	U	mex	75,763,057	mex	75,763,057	mex	
SCJ157	SC Swap	28/06/2023	Buy	U	mex	119,429,828	mex	119,429,828	mex	
SCZ470	SC Swap	20/09/2023	Buy	U	usm	828,475	usm	828,475	usm	
SCS018	SC Swap	29/01/2024	Buy	U	mex	20,000,000	mex	20,000,000	mex	
SCS028	SC Swap	29/01/2024	Buy	U	mex	20,000,000	mex	20,000,000	mex	
SCR878	SC Swap	26/02/2024	Buy	U	mex	19,833,333	mex	19,833,333	mex	
SCR879	SC Swap	26/02/2024	Buy	U	mex	19,833,333	mex	19,833,333	mex	
SCE377	SC Swap	22/04/2024	Buy	U	mex	7,000,000	mex	7,000,000	mex	
SCE417	SC Swap	22/04/2024	Buy	U	mex	7,000,000	mex	7,000,000	mex	
SAR594	SC Swap	29/04/2024	Buy	U	mex	450,000,000	mex	450,000,000	mex	
SAR730	SC Swap	29/04/2024	Buy	U	mex	450,000,000	mex	450,000,000	mex	
SDG148	SC Swap	29/04/2024	Buy	U	mex	450,000,000	mex	450,000,000	mex	
SDG149	SC Swap	29/04/2024	Buy	U	mex	450,000,000	mex	450,000,000	mex	
SCZ465	SC Swap	31/01/2025	Buy	U	usm	1,300,000	usm	1,300,000	usm	
SBW818	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	usm	10,000,000	usm	10,000,000	usm	
SBW861	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	usm	25,000,000	usm	25,000,000	usm	
SAI918	SC Swap	28/01/2026	Buy	U	usm	3,750,000	usm	3,750,000	usm	
SAI919	SC Swap	28/01/2026	Buy	U	usm	3,750,000	usm	3,750,000	usm	
SAI926	SC Swap	28/01/2026	Buy	U	mex	166,900,000	mex	166,900,000	mex	
SAI927	SC Swap	28/01/2026	Buy	U	mex	166,900,000	mex	166,900,000	mex	
SAI947	SC Swap	28/01/2026	Buy	U	usm	3,750,000	usm	3,750,000	usm	
SAI949	SC Swap	28/01/2026	Buy	U	mex	166,900,000	mex	166,900,000	mex	
SDG359	SC Swap	18/02/2026	Buy	U	mex	45,000,000	mex	45,000,000	mex	
SDG361	SC Swap	18/02/2026	Buy	U	mex	45,000,000	mex	45,000,000	mex	
SCC761	SC Swap	27/04/2026	Buy	U	mex	157,170,000	mex	157,170,000	mex	
SCC762	SC Swap	27/04/2026	Buy	U	mex	157,170,000	mex	157,170,000	mex	
SCC793	SC Swap	27/04/2026	Buy	U	usm	1,875,000	usm	1,875,000	usm	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SCC850	SC Swap	27/04/2026	Buy	U	mex	157,170,000	mex	157,170,000	mex	
SCC851	SC Swap	27/04/2026	Buy	U	usm	1,875,000	usm	1,875,000	usm	
SDH332	SC Swap	17/02/2031	Buy	U	mex	28,000,000	mex	28,000,000	mex	
SDH333	SC Swap	17/02/2031	Buy	U	mex	28,000,000	mex	28,000,000	mex	
SDK640	SC Swap	11/03/2031	Buy	U	mex	27,000,000	mex	27,000,000	mex	
SDK641	SC Swap	11/03/2031	Buy	U	mex	27,000,000	mex	27,000,000	mex	
SDK765	SC Swap	11/03/2031	Buy	U	mex	27,000,000	mex	27,000,000	mex	
SDK767	SC Swap	11/03/2031	Buy	U	mex	27,000,000	mex	27,000,000	mex	
SDL171	SC Swap	13/03/2031	Buy	U	mex	28,000,000	mex	28,000,000	mex	
SDL173	SC Swap	13/03/2031	Buy	U	mex	28,000,000	mex	28,000,000	mex	
MX2911	Term Deposit	04/03/2021	Buy	U	mex			12,206,667	mex	
MJF377	Term Deposit	30/11/2021	Buy	U	mex			193,087,327	mex	
MHC730	Term Deposit	22/09/2022	Buy	U	mex			82,000,000	mex	
MHU326	Term Deposit	30/11/2022	Buy	U	mex			173,000,000	mex	
MHM172	Term Deposit	15/06/2023	Buy	U	mex			147,500,000	mex	
MGW054	Term Deposit	28/06/2023	Buy	U	mex			75,763,057	mex	
MHT627	Term Deposit	28/06/2023	Buy	U	mex			119,429,828	mex	
MGH655	Term Deposit	21/01/2026	Buy	U	usd			10,000,000	usd	
MZ4444	Term Deposit	28/01/2026	Buy	U	usm			3,750,000	usm	
MZ4450	Term Deposit	28/01/2026	Buy	U	mex			166,900,000	mex	
MGR810	Term Deposit	27/04/2026	Buy	U	mex			157,170,000	mex	
MGR666	Term Deposit	11/01/2028	Buy	U	usd			20,000,000	usd	

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2067841	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067842	FX	250,000	27-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067843	FX	250,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067844	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067845	FX	250,000	24-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067846	FX	250,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067847	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067848	FX	250,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067849	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067867	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067868	FX	250,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067869	FX	250,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2067870	FX	19,481	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068290	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068291	FX	125,000	04-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068292	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068293	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068294	FX	125,000	03-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068295	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068296	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068297	FX	125,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068298	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068319	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068320	FX	125,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2068321	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068322	FX	8,170	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068335	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068336	FX	125,000	04-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068337	FX	125,000	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068338	FX	8,188	04-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068339	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068340	FX	125,000	03-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068341	FX	125,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068342	FX	8,188	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068343	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068344	FX	125,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068345	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068346	FX	8,188	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068472	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068473	FX	200,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068474	FX	200,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068475	FX	8,949	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068546	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068547	FX	200,000	03-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068548	FX	200,000	03-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068587	FX	60,000	11-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2068597	FX	60,000	11-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069005	FX	250,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069006	FX	250,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069007	FX	250,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069023	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069024	FX	125,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069025	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069064	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069065	FX	125,000	03-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069066	FX	125,000	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069067	FX	9,740	03-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069110	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069111	FX	250,000	31-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069112	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069156	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069157	FX	250,000	31-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069158	FX	250,000	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069159	FX	29,271	31-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069947	FX	400,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069948	FX	400,000	27-ene-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069949	FX	400,000	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069950	FX	43,100	27-ene-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069951	FX	400,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069952	FX	400,000	24-feb-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069953	FX	400,000	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069954	FX	43,100	24-feb-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069955	FX	400,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069956	FX	400,000	29-mar-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069957	FX	400,000	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069958	FX	43,100	29-mar-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED

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

Respecto a las llamadas de margen, al 31 de marzo de 2021 se tienen los siguientes saldos:

CONTRAPARTE	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	USD	-	(17,350,000)
CLIENTE 2	USD	113,767	(903,268)
CLIENTE 3	MXN	-	(761,000,000)
CLIENTE 4	MXN	179,500,000.00	(34,800,000)
CLIENTE 5	MXN	322,000,000.00	(5,908,075,408)
CLIENTE 6	MXN	-	(1,100,000)
CLIENTE 7	MXN	-	(21,300,000)
CLIENTE 8	MXN	1,031,300,000	(79,500,000)
CLIENTE 9	MXN	19,200,000	(66,700,000)
CLIENTE 10	MXN	2,669,500,366	(450,700,000)
CLIENTE 11	USD	90,010,000	(61,990,000)
CLIENTE 12	MXN	1,451,300,000	(614,400,000)
CLIENTE 13	USD	2,360,000	(61,410,000)
CLIENTE 14	USD	440,140,000	(25,600,000)
CLIENTE 15	USD	-	(1,640,000)
CLIENTE 16	USD	8,319,730	(8,480,000)
CLIENTE 17	MXN	4,600,000	(372,400,000)
CLIENTE 18	MXN	-	(95,100,000)
CLIENTE 19	USD	-	(2,221,532)
CLIENTE 20	MXN	-	(48,000,000)
CLIENTE 21	USD	450,000	-
CLIENTE 22	MXN	38,300,000	(1,673,740,251)
CLIENTE 23	USD	18,140,000	(15,500,000)
CLIENTE 24	MXN	301,143,036	(4,365,988,338)
CLIENTE 25	MXN	214,600,000	(65,800,000)
CLIENTE 26	USD	280,000	-
CLIENTE 27	USD	2,447,877	-
CLIENTE 28	USD	160,000	(160,000)
CLIENTE 29	MXN	285,200,000	(152,600,000)
TOTAL		7,079,064,775	(14,906,458,798)

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

Deal	Fecha de evento	Contraparte/ Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento	Producto
P16668	05/01/2021	Cliente 1	MXN	267,000	NO FONDEO SU CUENTA	Caps & Floors
2069175	14/01/2021	Cliente 2	MXN	3,090,000	NO FONDEO SU CUENTA	FX Options (Vanilla)
SAK055	28/01/2021	Cliente 3	MXN	1,409,715	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SX6539	29/01/2021	Cliente 4	MXN	1,609,063	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SY8025	02/02/2021	Cliente 5	MXN	31,310	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SAM825	02/02/2021	Cliente 6	MXN	1,725,932	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
2021012203487	02/02/2021	Cliente 6	USD	101,000	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
2021012203495	02/02/2021	Cliente 7	USD	132,000	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
2075585	18/02/2021	Cliente 8	MXN	703,500	NO FONDEO SU CUENTA	FX Options (Vanilla)
2074846	18/02/2021	Cliente 9	MXN	1,005,000	NO FONDEO SU CUENTA	FX Options (Vanilla)
SAK055	01/03/2021	Cliente 10	MXN	1,458,824	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SX6539	01/03/2021	Cliente 11	MXN	1,615,475	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SCD904	01/03/2021	Cliente 12	MXN	181,032	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
2021012203262	01/03/2021	Cliente 13	USD	29,000	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
2021021103424	16/03/2021	Cliente 14	MXN	696,619	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
2021010603352	16/03/2021	Cliente 15	MXN	834,027	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
C63921	16/03/2021	Cliente 16	USD	6,091	NO FONDEO SU CUENTA	Cross Currency Swaps
SX6242	23/03/2021	Cliente 17	MXN	101,821	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SAK055	29/03/2021	Cliente 18	MXN	1,322,828	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SX6539	29/03/2021	Cliente 19	MXN	1,520,056	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SCD904	29/03/2021	Cliente 20	MXN	170,715	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte

Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertura o Negociación	Nocional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores dados en garantía
				VP Trim Anterior	VP Trim Actual	VP Trim Anterior	VP Trim Actual	0 A 1 AÑO	1 A 5 AÑOS	5 A 10 AÑOS	
Forwards	Nego	1,964,207,313	Compra	Divisas	Divisas	51,636,848,749	77,851,121,579	1,692,382,448	271,824,865	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	Nego	1,812,957,279	Venta	Divisas	Divisas	(51,523,786,407)	(77,954,633,068)	1,574,699,853	238,257,426	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	356,131,000	Compra	Acción	Acción	6,500,304	51,475,240	-	356,131,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	(200,266,000)	Venta	Acción	Acción	(6,500,304)	(43,283,394)	-	(200,266,000)	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	7,010,287,342	Compra	Divisas	Divisas	264,215,888	197,307,084	6,406,991,166	603,296,176	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	7,010,287,342	Venta	Divisas	Divisas	(256,381,088)	(195,525,600)	6,406,991,166	603,296,176	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	2,110,327,500	Compra	Índice	Índice	266,743,187	174,727,245	-	2,110,327,500	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	428,296,500	Venta	Índice	Índice	(32,643,866)	(3,835,874)	-	428,296,500	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	26,715,634,919	Compra	Tasas	Tasas	123,303,755	143,848,858	78,700,000	21,236,833,866	5,400,101,053	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	26,639,047,118	Venta	Tasas	Tasas	(123,311,568)	(141,570,893)	78,700,000	21,200,233,938	5,360,113,181	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	483,382,000	Compra	Acción NE	Acción NE	-	48,893,576.57	-	483,382,000.00	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	253,691,000	Venta	Acción NE	Acción NE	-	57,058,353.70	-	253,691,000.00	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	428,296,500	Compra	Índice NE	Índice NE	24,153,161	3,835,073	-	428,296,500	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	2,110,327,500	Venta	Índice NE	Índice NE	(257,867,029)	(174,188,938)	-	2,110,327,500	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	78,376,976	Compra	Divisas NE	Divisas NE	7,263,122	4,185,916	-	78,376,975.60	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	78,376,976	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(15,097,928)	(5,967,506)	-	78,376,975.60	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	1,309,933.3	Compra	Tasas NE	Tasas NE	1.9	0.01	-	1,309,933	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	1,309,933	Venta	Tasas NE	Tasas NE	(52)	(1.41)	-	1,309,933	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	473,115,295	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	332,176,211	10,139,588	-	332,486,001	140,629,294	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	4,518,000	CCIRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	(6,031,610)	(7,497,505)	-	4,518,000	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	45,502,891,420	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	(2,541,801,082)	(1,045,222,585)	-	28,559,150,358	16,943,741,063	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	4,000,000	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD	FIJA EUR / LIBOR USD	(10,262,586)	(5,317,116)	-	4,000,000	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	177,524,996,781	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	(57,971,957)	19,229,473	-	177,507,046,683	17,950,099	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	1,233,758,142	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	(1,233,742,389)	(1,204,829,233)	-	428,988,472	804,769,671	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	302,465,044,787	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	(11,511,542,902)	(3,211,333,611)	70,213,513,117	91,378,972,191	140,872,559,480	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	1,693,708,297	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	1,693,497,264	1,214,808,467	108,470,358	681,566,015	903,671,924	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	302,738,783,588	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	10,828,451,280	2,774,539,230	75,771,257,080	78,215,584,070	148,751,942,438	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
100000000000			A C T I V O	656,938,493,000	646,525,196,728
110000000000			DISPONIBILIDADES	26,762,773,650	30,834,984,804
115000000000			CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)	1,742,678,626	1,466,882,988
120000000000			INVERSIONES EN VALORES	135,854,023,120	102,714,109,770
	120100000000		Títulos para negociar	65,864,119,876	55,181,529,617
	120200000000		Títulos disponibles para la venta	64,919,215,775	42,552,727,313
	120300000000		Títulos conservados a vencimiento	5,070,687,469	4,979,852,840
120800000000			DEUDORES POR REPORTE (SALDO DEUDOR)	30,681,371,740	17,912,417,959
120700000000			PRÉSTAMO DE VALORES	0	0
121400000000			DERIVADOS	19,228,723,730	22,661,807,196
	121406000000		Con fines de negociación	14,392,413,922	17,348,849,643
	121407000000		Con fines de cobertura	4,836,309,808	5,312,957,553
121700000000			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS	226,628,785	572,797,053
128000000000			TOTAL DE CARTERA DE CRÉDITO NETO	406,463,552,368	433,742,444,573
129000000000			CARTERA DE CRÉDITO NETA	406,463,552,368	433,742,444,573
129500000000			Cartera de crédito	424,065,366,675	446,246,313,655
130000000000			CARTERA DE CRÉDITO VIGENTE	408,906,846,409	435,944,929,448
	130100000000		Créditos comerciales	226,878,223,198	255,146,598,140
		130107010000	Actividad empresarial o comercial	186,316,307,760	204,332,760,272
		130107020000	Entidades financieras	27,583,345,376	36,405,522,034
		130107030000	Entidades gubernamentales	12,978,570,062	14,408,315,834
	131100000000		Créditos de consumo	36,196,087,117	43,717,246,463
	132100000000		Créditos a la vivienda	145,832,536,094	137,081,084,845
		132107010000	Media y residencial	140,682,737,182	131,994,204,424
		132107020000	De interés social	5,556,762	68,493,792
		132107030000	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	5,144,242,150	5,018,386,629
		132107040000	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
	133100000000		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
135000000000			CARTERA DE CRÉDITO VENCIDA	15,158,520,266	10,301,384,207
	135051000000		Créditos comerciales	5,105,589,659	4,497,469,530
		135051010000	Actividad empresarial o comercial	4,984,647,335	4,415,954,267
		135051020000	Entidades financieras	120,942,324	81,515,263
		135051030000	Entidades gubernamentales	0	0
	135061000000		Créditos de consumo	3,421,887,826	1,856,744,927
	135071000000		Créditos a la vivienda	6,631,042,781	3,947,169,750
		135071010000	Media y residencial	6,502,730,530	3,926,487,063
		135071020000	De interés social	16,766,466	14,755,168
		135071030000	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	111,545,785	5,927,519
		135071040000	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
139000000000			ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS	-17,601,814,307	-12,503,869,082
139700000000			Derechos de cobro (neto)	0	0
	139798000000		DERECHOS DE COBRO ADQUIRIDOS	0	0
	139799000000		ESTIMACIÓN POR IRRECUPERABILIDAD O DIFÍCIL COBRO	0	0
179700000000			BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
140000000000			Otras cuentas por cobrar	19,787,249,202	21,404,708,981
150000000000			Bienes adjudicados	144,549,736	132,424,485
160000000000			Propiedades, mobiliario y equipo	3,386,745,851	3,252,762,715
170000000000			INVERSIONES PERMANENTES	51,402,375	51,751,501
179500000000			ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA	21,650,131	23,544,331
180000000000			Impuestos y ptu diferidos (a favor)	6,653,445,507	5,736,994,827
190000000000			OTROS ACTIVOS	5,933,698,179	6,017,565,545
	190300000000		Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles	5,933,698,179	6,017,545,840
	191600000000		Otros activos a corto y largo plazo	0	19,705
200000000000			P A S I V O	599,599,455,037	592,257,973,468
210000000000			CAPTACIÓN TRADICIONAL	410,719,043,064	410,461,149,710
	210100000000		Depósitos de exigibilidad inmediata	198,074,745,855	174,339,505,726
	211100000000		Depósitos a plazo	178,956,768,021	196,157,417,645
		211101000000	Del público en general	170,878,344,278	151,152,378,891
		211102000000	Mercado de dinero	8,078,423,743	45,005,038,754
		211103000000	Fondos especiales	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
	212500000000		Títulos de crédito emitidos	33,111,259,746	39,374,840,604
	216100000000		Cuenta global de captación sin movimientos	576,269,442	589,385,735
230000000000			PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS	62,421,124,587	61,897,617,794
	230100000000		De exigibilidad inmediata	0	0
	230200000000		De corto plazo	29,967,795,830	21,093,333,369
	230300000000		De largo plazo	32,453,328,757	40,804,284,425
203000000000			VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR	4,308,505,881	9,211,883,341
220800000000			ACREEDORES POR REPORTE	60,919,790,572	41,257,253,481
220700000000			PRÉSTAMO DE VALORES	13,039	18,968
220900000000			COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA	753,537,859	401,969,039
	220901000000		Reportos	0	0
	220902000000		Préstamo de valores	753,537,859	401,969,039
	220903000000		Derivados	0	0
	220990000000		Otros colaterales vendidos	0	0
221400000000			DERIVADOS	20,685,508,074	26,186,546,142
	221406000000		Con fines de negociación	14,800,823,327	19,592,828,700
	221407000000		Con fines de cobertura	5,884,684,747	6,593,717,442
221700000000			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS	11,640,768	16,899,283
221900000000			OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
225000000000			Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal	0	0
240000000000			OTRAS CUENTAS POR PAGAR	29,106,544,628	31,934,571,199
	240200000000		Impuestos a la utilidad por pagar	864,318,511	1,679,293,852
	240800000000		Participación de los trabajadores en las utilidades por pagar	0	0
	240300000000		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	240900000000		Acreedores por liquidación de operaciones	8,896,691,636	15,833,276,768
	241000000000		Acreedores por cuentas de margen	0	0
	241300000000		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	604,187,326	1,107,975,885
	240100000000		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	18,741,347,155	13,314,024,694
270000000000			OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN	9,093,676,836	9,090,581,977
280000000000			Impuestos y ptu diferidos (a cargo)	0	0
290000000000			CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS	1,580,069,729	1,799,482,534
400000000000			CAPITAL CONTABLE	57,339,037,963	54,267,223,260
450000000000			Participación controladora	57,338,003,457	54,267,016,496
410000000000			CAPITAL CONTRIBUIDO	10,876,764,482	10,876,764,482
	410100000000		Capital social	10,404,165,369	10,404,165,369
	410700000000		Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
	410400000000		Prima en venta de acciones	472,599,113	472,599,113
	411100000000		Obligaciones subordinadas en circulación	0	0
420000000000			CAPITAL GANADO	46,461,238,975	43,390,252,014
	420100000000		Reservas de capital	6,757,848,750	6,263,000,124
	420300000000		Resultado de ejercicios anteriores	39,450,852,511	36,914,041,127
	420500000000		Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	23,474,044	-44,727,240
	421500000000		Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-377,166,284	-322,765,916
	421700000000		Efecto acumulado por conversión	0	0
	422300000000		Remediones por beneficios definidos a los empleados	-1,006,062,983	-802,921,478
	420900000000		Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	421100000000		Resultado neto	1,612,292,937	1,383,625,397
430000000000			PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA	1,034,506	206,764
	431000000000		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	819,869	3,198
	439000000000		Otra participación no controladora	214,637	203,566
700000000000			CUENTAS DE ORDEN	2,944,256,670,636	2,930,832,456,657
710000000000			Avales otorgados	0	0
790000000000			Activos y pasivos contingentes	0	2,977,405
730000000000			Compromisos crediticios	270,063,257,193	255,261,698,877
740000000000			Bienes en fideicomiso o mandato	383,191,388,637	369,726,499,066
	740100000000		Fideicomisos	354,124,836,982	340,554,167,362
	740200000000		Mandatos	29,066,551,655	29,172,331,704
770300000000			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
750000000000			Bienes en custodia o en administración	626,320,933,116	684,795,156,429
773100000000			Colaterales recibidos por la entidad	40,132,570,688	49,073,390,300

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
773200000000			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	983,539,653	401,969,039
760000000000			Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros	144,011,472,815	112,290,743,061
771000000000			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	759,044,270	506,357,240
780000000000			Otras cuentas de registro	1,478,794,464,264	1,458,773,665,240

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01**

AÑO: **2021**

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

ESTADO DE RESULTADOS DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
510000000000	Ingresos por intereses	10,968,111,459	12,721,992,346
610000000000	Gastos por intereses	4,658,553,967	6,763,765,994
520000000000	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
670100000000	MARGEN FINANCIERO	6,309,557,492	5,958,226,352
620000000000	Estimación preventiva para riesgos crediticios	1,349,365,242	2,002,724,331
670200000000	MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS	4,960,192,250	3,955,502,021
530000000000	Comisiones y tarifas cobradas	1,309,832,304	1,269,018,301
630000000000	Comisiones y tarifas pagadas	226,140,956	239,073,602
540000000000	Resultado por intermediación	204,336,043	741,548,057
505000000000	Otros ingresos (egresos) de la operación	465,210,342	495,056,176
590000000000	Subsidios	0	0
640000000000	Gastos de administración y promoción	4,805,015,564	4,593,003,101
670400000000	RESULTADO DE LA OPERACIÓN	1,908,414,419	1,629,047,852
570000000000	Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos	316,948	279,470
672500000000	RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD	1,908,731,367	1,629,327,322
660000000000	Impuestos a la utilidad causados	455,762,315	1,178,897,324
560000000000	Impuestos a la utilidad diferidos	160,143,754	933,198,597
670700000000	RESULTADO ANTES DE OPERACIONES DISCONTINUADAS	1,613,112,806	1,383,628,595
580000000000	Operaciones discontinuadas	0	0
671100000000	RESULTADO NETO	1,612,292,937	1,383,625,397
670900000000	Participación controladora	1,612,292,937	1,383,625,397
671300000000	Participación no controladora	819,869	3,198

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
820103500000		Resultado neto	1,613,112,806	1,383,628,595
820103600000		Ajustes por partidas que no implican flujo de efectivo:	2,130,831,420	5,178,752,482
	820103600100	Pérdidas por deterioro o efecto por reversión del deterioro asociados a actividades de inversión	-22,556,128	37,138,430
	820103600200	Depreciaciones de propiedades, mobiliario y equipo	118,203,725	125,946,329
	820103600300	Amortizaciones de activo intangibles	127,979,403	95,065,625
	820103600400	Provisiones	487,909,734	2,441,967,038
	820103600500	Impuestos a la utilidad causados y diferidos	295,618,561	245,698,727
	820103600600	Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos	-316,948	-279,470
	820103600700	Operaciones discontinuadas	0	0
	820103609000	Otros	1,123,993,073	2,233,215,803
		Actividades de operación		
	820103010000	Cambio en cuentas de margen	987,353,421	-450,204,046
	820103020000	Cambio en inversiones en valores	-8,913,950,625	-7,933,963,499
	820103030000	Cambio en deudores por reporto	-2,822,520,406	-15,337,978,611
	820103040000	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	820103050000	Cambio en derivados (activo)	5,475,133,154	-10,038,667,962
	820103060000	Cambio de cartera de crédito (neto)	-9,670,088,709	-33,620,062,930
	820103070000	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	820103080000	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	820103090000	Cambio en bienes adjudicados (neto)	53,370,324	-12,575,485
	820103100000	Cambio en otros activos operativos (neto)	-6,102,120,757	-2,844,338,852
	820103110000	Cambio en captación tradicional	4,594,276,229	45,590,065,365
	820103120000	Cambio en préstamos interbancarios y de otros organismos	-4,190,854,899	6,255,454,076
	820103130000	Cambio en acreedores por reporto	18,028,462,660	-7,877,710,801
	820103140000	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	-2,884	18,968
	820103150000	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	230,754,229	401,969,039
	820103160000	Cambio en derivados (pasivo)	-6,624,071,318	10,227,280,837
	820103170000	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	0	0
	820103180000	Cambio en obligaciones subordinadas con características de pasivo	42,091,189	44,755,822
	820103190000	Cambio en otros pasivos operativos	3,515,061,156	2,267,314,211
	820103200000	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	820103230000	Cobros de impuestos a la utilidad (devoluciones)	0	0
	820103240000	Pagos de impuestos a la utilidad	-1,151,472,201	-327,485,271
	820103900000	Otros	0	0
820103000000		Flujos netos de efectivo de actividades de operación	-6,548,579,437	-13,656,129,139
		Actividades de inversión		
	820104010000	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	0	29,880,716
	820104020000	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-124,612,159	0
	820104030000	Cobros por disposición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto	0	0
	820104040000	Pagos por adquisición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto	-1,000	0
	820104050000	Cobros por disposición de otras inversiones permanentes	0	0
	820104060000	Pagos por adquisición de otras inversiones permanentes	0	0
	820104070000	Cobros de dividendos en efectivo	0	0
	820104080000	Pagos por adquisición de activos intangibles	-262,540,585	-44,634,174
	820104090000	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	820104100000	Cobros por disposición de otros activos de larga duración	0	0
	820104110000	Pagos por adquisición de otros activos de larga duración	0	0
	820104120000	Cobros asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	820104130000	Pagos asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	820104900000	Otros	0	0
820104000000		Flujos netos de efectivo de actividades de inversión	-387,153,744	-14,753,458
		Actividades de financiamiento		
	820105010000	Cobros por emisión de acciones	0	0
	820105020000	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	820105030000	Pagos de dividendos en efectivo	0	0
	820105040000	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	820105050000	Cobros por la emisión de obligaciones subordinadas con características de capital	0	0
	820105060000	Pagos asociados a obligaciones subordinadas con características de capital	0	0
	820105900000	Otros	0	0
820105000000		Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

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

AL 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

**CONSOLIDADO
Impresión Final**

(PESOS)

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
820100000000		Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo	-3,191,788,955	-7,108,501,520
820400000000		Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo	0	0
820200000000		Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo	29,954,562,605	37,943,486,324
820000000000		Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo	26,762,773,650	30,834,984,804

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

ESTADO DE VARIACIONES EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE

AL 31 DE MARZO DE 2021 Y 2020

CRÉDITO

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

Concepto	Participación controladora	Capital contribuido				Capital Ganado								Participación no controladora	Capital contable
		Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Obligaciones subordinadas en circulación	Reservas de capital	Resultado de ejercicios anteriores	Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	Efecto Acumulado por conversión	Remediones por beneficios definidos a los empleados	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Resultado neto		
Saldo al inicio del periodo	55,321,125,241	10,404,165,369	0	472,599,113	0	6,757,848,750	36,432,175,039	416,755,619	-1,161,122,172	0	-1,019,973,949	0	3,018,677,472	214,637	55,321,339,878
MOVIMIENTOS INHERENTES A LAS DECISIONES DE LOS PROPIETARIOS															
Suscripción de acciones	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Capitalización de utilidades	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Constitución de reservas	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Traspaso del resultado neto a resultado de ejercicios anteriores	0	0	0	0	0	0	3,018,677,472	0	0	0	0	-3,018,677,472	0	0	0
Pago de dividendos	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Otros	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total por movimientos inherentes a las decisiones de los propietarios	0	0	0	0	0	0	3,018,677,472	0	0	0	0	-3,018,677,472	0	0	0
MOVIMIENTOS INHERENTES AL RECONOCIMIENTO DE LA UTILIDAD INTEGRAL															
-Resultado neto	1,612,292,937	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,612,292,937	819,869	1,613,112,806	
-Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	-393,281,575	0	0	0	0	0	0	-393,281,575	0	0	0	0	0	-393,281,575	
-Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo.	783,955,888	0	0	0	0	0	0	0	783,955,888	0	0	0	0	783,955,888	
-Efecto acumulado por conversión	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Remediones por beneficios definidos a los empleados	13,910,966	0	0	0	0	0	0	0	0	13,910,966	0	0	0	13,910,966	
-Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Otros	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Total de movimientos inherentes al reconocimiento de la utilidad integral	2,016,878,216	0	0	0	0	0	0	-393,281,575	783,955,888	0	13,910,966	0	1,612,292,937	819,869	2,017,698,085
Saldo al final del periodo	57,338,003,457	10,404,165,369	0	472,599,113	0	6,757,848,750	39,450,852,511	23,474,044	-377,166,284	0	-1,006,062,983	0	1,612,292,937	1,034,506	57,339,037,963

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

(1) Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 29 de Abril de 2021, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y H. Valerio Bustos Quiroz (Director Contabilidad Grupo) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

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

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

Los accionistas y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (la Comisión Bancaria) tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2021 adjuntos, se someterán a la aprobación de la próxima Asamblea de Accionistas.

Bases de presentación

a) Declaración de cumplimiento

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

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

b) Uso de juicios y estimaciones

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Juicios

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

Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

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

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

-Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios: supuestos e insumos utilizados en su determinación;

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

-Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves;

-Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables y la materialización de los impuestos diferidos.

c) Moneda funcional y de informe

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

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

d) Reconocimiento de activos y pasivos por instrumentos financieros

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

(2) Resumen de las principales políticas contables-

Las políticas contables que se muestran en la preparación de los estados financieros consolidados que se presentan a continuación, han sido aplicadas consistentemente por el Banco, excepto por los Criterios Contables especiales aplicados en el año.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 3 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

(a) Reconocimiento de los efectos de la inflación-

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

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

	Inflación	
	31 de diciembre de	UDIDel añoAcumulada
2020	6.6055973.23%	11.31%
2019	6.3990182.77%	15.03%
2018	6.2266314.92%	15.71%

(b) Bases de consolidación-

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

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

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

(c) Disponibilidades-

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

Las disponibilidades se reconocen a su valor nominal. En el caso de cuentas bancarias

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 4 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

denominadas en dólares, el tipo de cambio utilizado para la conversión es el publicado por el Banco Central. El efecto de valorización y los intereses ganados se registran en resultados, como ingreso o gasto por intereses, según corresponda, conforme se devengan.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(d)Cuentas de margen-

Los activos financieros otorgados en efectivo requeridos al Banco con motivo de la celebración de operaciones con derivados realizados en mercados o bolsas reconocidos se reconocen a su valor nominal y se presentan en el rubro de "Cuentas de margen". El

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

valor de la cuenta de margen otorgada en efectivo se modifica por las liquidaciones parciales o totales que la cámara de compensación deposita o retira y por las aportaciones adicionales o retiros efectuados por el Banco.

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

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

(e) Inversiones en valores-

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

Títulos para negociar-

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

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

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

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

Títulos disponibles para la venta-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 6 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

Títulos conservados al vencimiento-

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

Deterioro del valor de un título-

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

Si en un período posterior, el valor razonable del título se incrementa, y dicho efecto está relacionado objetivamente con un evento que ocurra después de que el deterioro fue reconocido en los resultados del ejercicio, el deterioro se revierte en los resultados del ejercicio, excepto si se trata de un instrumento de patrimonio.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Operaciones fecha valor-

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

Reclasificación entre categorías-

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

(f) Préstamo de valores-

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

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

En el caso de que el Banco, previo al vencimiento de la operación de préstamo de valores, venda el colateral recibido como prestamista o el valor objeto de la operación como prestatario, reconoce la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como la obligación de restituir dicho colateral al prestatario o el valor objeto de la operación al prestamista dentro del rubro de "Colaterales vendidos o dados en

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 8 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

garantía", dicha obligación es medida inicialmente al precio pactado y posteriormente se valúa a valor razonable, el efecto por valuación se presenta en resultados dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

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

(g) Operaciones de reporto-

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

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

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

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

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

(h) Derivados-

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

El efecto por valuación de los derivados con fines de negociación se presenta en el balance general consolidado y en el estado consolidado de resultados dentro de los

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 9/ 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

Derivados implícitos y estructurados

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

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

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

Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de derivados no realizadas en mercados o bolsas reconocidos-

El colateral es una garantía constituida para asegurar el pago de las

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

contraprestaciones pactadas en contratos con instrumentos financieros derivados en operaciones no realizadas en mercados o bolsas reconocidos.

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

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

(i) Compensación de cuentas liquidadoras-

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

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

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

(j) Cartera de crédito-

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

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

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

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

Cartera INFONAVIT-

La cartera en prórroga se integra por todos aquellos créditos a la vivienda originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT) adquiridos por las entidades, y que en términos de la Ley del INFONAVIT, cuenten con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios, al concluir la prórroga la cartera recibirá el tratamiento que le corresponda de: Régimen Ordinario de Amortización (ROA) o Régimen Especial de Amortización (REA). Lo anterior, siempre y cuando la entidad esté contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos del organismo de referencia.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 11 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

Créditos e intereses vencidos-

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

a) los pagos correspondientes a los créditos que el Banco haya adquirido al INFONAVIT o el Fondo de la Vivienda del Instituto de Seguridad y Servicios Sociales de los Trabajadores del Estado (FOVISSSTE), conforme a la modalidad de pago correspondiente (REA o ROA), así como

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 12 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

Pago sostenido

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

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

En los créditos con pagos periódicos de principal e intereses cuyas amortizaciones sean

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 13 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

menores o iguales a 60 días en los que se modifique la periodicidad del pago a periodos menores derivado de la aplicación de una reestructura, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado presenta cumplimiento de pago de amortizaciones equivalentes a tres amortizaciones consecutivas del esquema original del crédito.

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

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

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

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

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

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

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

Reestructuras y renovaciones

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

d) Prórroga del plazo del crédito.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 15 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

Comisiones

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

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

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

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

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

Costos y gastos relacionados al otorgamiento inicial del crédito

Los costos y gastos relacionados con el otorgamiento del crédito se reconocen como un cargo diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio dentro del

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 16/ 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

rubro de "Gastos por intereses", durante el plazo promedio de la vida de los créditos, excepto para las que se originen por créditos revolventes, las cuales son amortizadas en un periodo de 12 meses contra el rubro del gasto que le corresponda de acuerdo a su naturaleza.

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

Adquisición de cartera de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 17/ 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(k) Estimación preventiva para riesgos crediticios-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 18 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

A10.0000.90%
A20.9011.50%
B11.5012.00%
B22.0012.50%
B32.5015.00%
C15.00110.00%
C210.00115.50%
D15.50145.00%
EMayor a 45.00%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 19 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Cartera hipotecaria incluyendo la originada y adquirida al INFONAVIT-

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

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

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

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

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

Cartera de consumo-

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 20 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Rango de porcentaje de estimación preventiva
Tarjeta de crédito
y otros créditos
Grado de riesgo No revolventes

A10.002.0%0.003.00%
A22.013.0%3.015.00%
B13.014.0%5.016.50%
B24.015.0%6.518.00%
B35.016.0%8.0110.00%
C16.018.0%10.0115.00%
C28.0115.0%15.0135.00%
D15.0135.0%35.0175.00%
E35.01100.0%Mayores a75.01%

Cartera emproblemada - El Banco para propósitos de las revelaciones en los estados financieros consolidados, considera emproblemados aquellos créditos comerciales respecto de los cuales determina que existe una probabilidad considerable de que no se podrían recuperar en su totalidad, sin excluir las mejoras en los grados de riesgo derivadas de la parte del crédito cubierto por garantías, así como créditos que aún y cuando se encuentren vigentes provengan de una negociación en la cual se autorizó una condonación, quita o bonificación al final del plazo pactado, o son a cargo de personas a las cuales se les ha clasificado como clientela indeseable.

Reservas adicionales identificadas - Son establecidas para aquellos créditos que, en la opinión de la administración, podrían verse emproblemados en el futuro dada la situación del cliente, la industria o la economía. Además, incluye estimaciones para partidas como intereses ordinarios devengados no cobrados y otras partidas cuya realización se estima podrían resultar en una pérdida para el Banco, así como reservas mantenidas por regulación normativa.

Castigos- El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo a plazos establecidos (6 y 35 meses, respectivamente) que determinan la imposibilidad práctica de recuperación; los castigos cancelan el saldo del crédito contra la estimación preventiva previamente constituida. Cuando el crédito a castigar excede el saldo de su estimación asociada, antes de efectuar el castigo, dicha estimación se incrementa hasta por el monto de la diferencia. Cualquier recuperación derivada de los créditos previamente castigados, se reconoce en los resultados del ejercicio dentro del rubro de estimación preventiva para riesgos crediticios.

(l) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

Con base al párrafo 3 del criterio A-4 "Aplicación Supletoria a los Criterios de Contabilidad" emitido por la Comisión, el Banco había adoptado la NIIF 15 "Ingresos provenientes de contratos con clientes" el cual incorpora el reconocimiento de ingresos derivados de programas de fidelización con clientes, y por lo tanto la IFRIC 13 "Programa de fidelidad de clientes" queda sin efecto. De acuerdo con la NIIF 15, una porción de los ingresos por cuota de intercambio se difiere en el momento en que se identifican las obligaciones de cumplir, es decir, de entregar los premios a los que los clientes tienen derecho y se amortizan contra resultados una vez que se satisface dicha obligación de cumplir.

(m) Otras cuentas por cobrar-

Los derechos de cobro y las cuentas por cobrar relativas a deudores identificados cuyo vencimiento se pacte desde su origen a un plazo mayor a 90 días naturales, son

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 21 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

evaluados por la Administración del Banco para determinar su valor de recuperación estimado, y en su caso constituir las reservas correspondientes. Los saldos de las demás partidas deudoras se reservan con cargo a los resultados del ejercicio a los 90 días siguientes a su registro inicial cuando correspondan a saldos identificados y a los 60 días si corresponden a saldos no identificados, independientemente de su posibilidad de recuperación, con excepción de los relativos a saldos por recuperar de impuestos e impuesto al valor agregado acreditable.

Tratándose de cuentas liquidadoras, en los casos en que el monto por cobrar no se realice a los 90 días naturales siguientes a partir de la fecha en que se haya registrado en cuentas liquidadoras, se registra como adeudo vencido y se constituye una estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro por el importe total del mismo.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes, que no cuenten con una línea de crédito para tales efectos, se clasificarán como adeudos vencidos y las instituciones deberán constituir simultáneamente a dicha clasificación una estimación por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

(n) Bienes adjudicados o recibidos como dación en pago-

Los bienes adquiridos mediante adjudicación judicial se registran en la fecha en que cause ejecutoria el auto aprobatorio del remate mediante el cual se decretó la adjudicación.

Los bienes recibidos en dación en pago se registran en la fecha en que se firmó la escritura de dación, o en la que se haya dado formalidad a la transmisión de la propiedad del bien.

El reconocimiento contable de un bien adjudicado considera el valor del bien (costo o valor razonable deducido de los costos y gastos estrictamente indispensables que se eroguen en su adjudicación, el que sea menor) así como el valor neto del activo que da origen a la adjudicación. Cuando el valor neto del activo que dio origen a la adjudicación es superior al valor del bien adjudicado, la pérdida se reconoce en los resultados del ejercicio, en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto"; en caso contrario, el valor del bien adjudicado se ajusta al valor neto del activo.

El valor del activo que dio origen a la misma y la estimación preventiva que se tenga constituida a esa fecha, se dan de baja del balance general consolidado.

Los bienes adjudicados prometidos en venta se reconocen como restringidos a valor en libros, los cobros que se reciben a cuenta del bien se registran como un pasivo; en la fecha de enajenación se reconoce en resultados la utilidad o pérdida generada dentro del rubro "Otros ingresos de la operación, neto".

Los bienes adjudicados se valúan de acuerdo al tipo de bien de que se trate, registrando dicha valuación (bajas de valor) contra resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El Banco constituye provisiones adicionales que reconozcan los indicios de deterioro por las potenciales pérdidas de valor por el paso del tiempo en los bienes adjudicados, contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", las cuales se determinan multiplicando el porcentaje de reserva que corresponda por el valor de los bienes adjudicados, con base en las disposiciones por tenencia de bienes adjudicados o recibidos en dación de pago de la Comisión Bancaria, conforme se muestra a continuación:

Porcentaje de reserva
Bienes muebles,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Meses transcurridos a partir de laderechos de cobro e adjudicación o dación en pagoBienes inmueblesinversiones en valores

Hasta 6 0%0%
Más de 6 y hasta 120%10%
Más de 12 y hasta 1810%20%
Más de 18 y hasta 2410%45%
Más de 24 y hasta 3015%60%
Más de 30 y hasta 3625%100%
Más de 36 y hasta 4230%100%
Más de 42 y hasta 4835%100%
Más de 48 y hasta 5440%100%
Más de 54 y hasta 6050%100%
Más de 60 100%100%

(o) Inmuebles, mobiliario y equipo-

Los inmuebles, mobiliario y equipo son registrados a su costo de adquisición. Los saldos que provienen de adquisiciones realizadas hasta el 31 de diciembre 2007, se actualizaron mediante factores derivados del valor de la UDI de su fecha de adquisición hasta esa fecha, que fue cuando se suspendió el reconocimiento de la inflación en la información financiera de acuerdo a las NIF. Los componentes adquiridos en moneda extranjera se registran al tipo de cambio histórico, es decir, a aquellos vigentes en la fecha de adquisición del bien.

La depreciación se calcula usando el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del Banco de los activos correspondientes.

El monto a depreciar de los inmuebles, mobiliario y equipo se determina después de deducir a su costo de adquisición su valor residual y, en su caso menos las pérdidas por deterioro acumuladas. El Banco evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichos inmuebles, mobiliario y equipo.

El Banco evalúa periódicamente los valores netos en libros de los inmuebles, mobiliario y equipo, para determinar la existencia de indicios de que dichos valores exceden su monto recuperable. El monto recuperable es aquel que resulte mayor entre el precio neto de venta y el valor de uso. Si se determina que los valores netos en libros exceden su monto recuperable, el Banco reconoce el deterioro con cargo a los resultados del ejercicio para reducirlos a este último monto. Los gastos de mantenimiento y reparaciones menores se registran en los resultados cuando se incurren.

(p) Activos de larga duración disponibles para su venta-

Los activos de larga duración se clasifican como disponibles para su venta si cumplen todos los requisitos que se muestran a continuación:

- a) El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.
 - b) Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.
 - c) Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.
 - d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 23 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

no se cumple en los casos en que el Banco celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del periodo de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control del Banco y existen evidencias suficientes de que el Banco se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.

e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.

f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores, se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

(q) Inversiones permanentes-

Las inversiones permanentes en donde no se tiene el control, control conjunto, ni influencia significativa son clasificadas como otras inversiones, las cuales se reconocen inicialmente y se mantienen valuadas a su costo de adquisición. En caso de que haya dividendos provenientes de dichas inversiones se reconocen en resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de periodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

(r) Otros activos-

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la administración del Banco.

Ante la presencia de algún indicio de deterioro del valor de un activo, se determina la posible pérdida por deterioro, y en caso de que el valor de recuperación sea menor al valor neto en libros se reduce el valor del activo y se reconoce la pérdida por deterioro en los resultados del ejercicio.

(s) Impuestos a la utilidad-

Los impuestos a la utilidad causados en el año se determinan conforme a las disposiciones fiscales vigentes.

El impuesto causado se presenta dentro del balance general consolidado como un pasivo; cuando los anticipos realizados exceden el impuesto determinado del ejercicio, el exceso generado constituye una cuenta por cobrar.

Los impuestos a la utilidad diferidos se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas y por

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 24 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

pérdidas fiscales por amortizar. Los activos y pasivos por impuestos a la utilidad se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas fiscales sobre los impuestos a la utilidad se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por impuesto a la utilidad diferido se evalúa periódicamente creando, en su caso, reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los "Otros Resultados Integrales" (ORI) o directamente en un rubro del capital contable.

(t) Arrendamientos capitalizables-

Las operaciones de arrendamiento capitalizable se registran como un activo y una obligación correlativa por el equivalente al valor menor entre el valor presente de los pagos mínimos y el valor de mercado del activo arrendado. La diferencia entre el valor nominal de los pagos mínimos y la obligación mencionada anteriormente, se registra durante el periodo de arrendamiento en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El activo se deprecia de la misma manera que los otros activos que se tienen en propiedad cuando se tiene la certeza de que al término del contrato se transferirá la propiedad del activo arrendado, caso contrario se deprecia durante la duración del contrato.

(u) Captación tradicional-

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del público en general, los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses". Por aquellos títulos colocados a un precio diferente al valor nominal, la diferencia entre el valor nominal del título y el monto de efectivo recibido por el mismo, se reconoce como un cargo o crédito diferido y se amortiza bajo el método de línea recta contra resultados durante el plazo del título que le dio origen.

Los depósitos e inversiones y sus intereses de los instrumentos de captación que no tengan una fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven de forma automática, así como las transacciones o las inversiones vencidas y no reclamadas se registraran en el rubro de "Cuenta global de captación sin movimientos". Los depósitos e inversiones y sus intereses sin movimiento en el transcurso de 3 años contados a partir de que estos últimos se depositen en la cuenta global, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública. El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto en este.

(v) Provisiones-

El Banco reconoce con base en estimaciones de la administración, provisiones por

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

aquellas obligaciones presentes en las que es probable la transferencia de activos o la prestación de servicios y surge como consecuencia de eventos pasados.

(w) Préstamos interbancarios y de otros organismos-

En este rubro se registran los préstamos de exigibilidad inmediata, de corto plazo y de largo plazo de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento; asimismo, este rubro incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

(x) Beneficios a los empleados-

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que se devengan los servicios prestados, se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

Plan de contribución definida

El Banco tiene reconocido un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocían directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción".

Plan de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos, se realiza anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al 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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 26 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 periodo, 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 periodo.

Las remediciones generadas resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del periodo, se reconocen en el periodo en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable y posteriormente se recicla a los resultados del periodo, tomando como base la vida laboral remanente promedio del personal jubilado.

(y) Obligaciones subordinadas-

Las obligaciones subordinadas se reconocen a su valor contractual y los intereses se reconocen conforme se devengan en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Gastos por intereses".

(z) Reconocimiento de ingresos-

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan. Los intereses sobre cartera de crédito vencida, se reconocen en resultados hasta el momento en que efectivamente se cobran.

Los cobros anticipados por concepto de intereses y las comisiones por originación del crédito se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas cobradas" respectivamente, conforme se devenguen o en el plazo del crédito, según aplique.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes, así como comisiones por servicios relacionados a operaciones derivadas se reconocen en los resultados cuando se proporciona el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

Las comisiones por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devenga el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas". En el momento en que el adeudo de dichas comisiones presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, se suspende la acumulación de dichos ingresos devengados y se lleva el control de éstos en cuentas de orden; en caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

Las comisiones por reestructuraciones o renovaciones de créditos se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses", bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito.

(aa) Transacciones en moneda extranjera-

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 27 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio para solventar obligaciones denominadas en moneda extranjera pagaderas en la República Mexicana, determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio FIX publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el periodo en que se originan.

(ab) Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)-

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que es un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regular los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo.

De acuerdo a dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400 mil UDIS por persona, física o moral, y por institución bancaria. Las aportaciones al IPAB se reconocen en resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción".

(ac) Cuentas de orden-

Las cuentas de orden corresponden principalmente a los bienes en custodia o de administración y operaciones de fideicomisos.

Los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración, se reconocen en las cuentas de orden respectivas de acuerdo con los Criterios Contables establecidos por la Comisión Bancaria, representando así el monto máximo esperado por el que estaría obligado el Banco a responder ante sus clientes.

Los montos de los bienes en custodia o en administración se presentan en el rubro "Bienes en custodia o en administración", en tanto que las operaciones de fideicomiso se presentan en el rubro de "Bienes en fideicomiso o mandato".

(ad) Contingencias-

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos, utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

(4) Cambios contables-

NIF aplicables en 2021:

NIF B-11 "Disposición de activos de larga duración y operaciones discontinuadas"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2020, no

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 28 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

permitiendo su aplicación anticipada, dado que es necesario aplicarla junto con la NIF C-15 que se reemitirá durante 2019 y también será aplicable a partir del 2020. La aplicación por primera vez de esta NIF no genera cambios contables en los estados financieros.

Venta de créditos de cartera hipotecaria

El 31 de enero de 2020, el Banco vendió un portafolio de préstamos hipotecarios totalmente castigados a una compañía no relacionada con valor nominal de \$181, el ingreso recibido y utilidad en libros de dicho portafolio fue de \$38. El resultado por esta operación fue registrado como recuperaciones en el estado de resultados dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios".

Cambios en las Disposiciones de la Comisión Bancaria

El 4 de diciembre de 2020 la Comisión Bancaria emitió resolución sobre la entrada en vigor de la Resolución publicada en el DOF el 13 de marzo de 2020, referente a las NIF emitidas por el CINIF, referidas en el párrafo 3 del Criterio A-2 "Aplicación de normas particulares" del Anexo 33, entrarán en vigor el 1 de enero de 2022.

El CINIF emitió las siguientes NIF's que se mencionan a continuación:

NIF B-17 "Determinación del valor razonable"- Establece las normas de valuación y revelación en la determinación del valor razonable, en su reconocimiento inicial y posterior, si el valor razonable es requerido o permitido por otras NIF particulares.

NIF C-2 "Inversión en instrumentos financieros"- Permite la opción de reconocer inversiones en ciertos instrumentos negociables de capital que no se negocian en el corto plazo, para ser valuadas a través del ORI. Esta mejora entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2021, permitiéndose su aplicación anticipada para el ejercicio 2020. Los cambios contables que surjan deben reconocerse de conformidad con lo que establece la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF C-3 "Cuentas por cobrar"- Entre los principales cambios que presenta se encuentran los siguientes:

- Especifica que las cuentas por cobrar que se basan en un contrato representan un instrumento financiero, en tanto que algunas de las otras cuentas por cobrar, generadas por una disposición legal o fiscal, pueden tener ciertas características de un instrumento financiero, tal como generar intereses, pero no son en sí instrumentos financieros.
- Establece que la estimación para incobrabilidad por cuentas por cobrar debe reconocerse desde el momento en que se devenga el ingreso, con base en las pérdidas crediticias esperadas presentando la estimación en un rubro de gastos, por separado cuando sea significativa en el estado de resultado integral.
- Establece que, desde el reconocimiento inicial, debe 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, debe ajustarse considerando dicho valor presente.
- Requiere una conciliación entre el saldo inicial y el final de la estimación para incobrabilidad por cada período presentado.

NIF C-9 "Provisiones, Contingencias y Compromisos"- Entre los principales aspectos que cubre esta NIF se encuentran los siguientes:

- Se disminuye su alcance al reubicar el tema relativo al tratamiento contable de
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 29 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

pasivos financieros en la NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar".

•Se modifica la definición de "pasivo" eliminando el calificativo de "virtualmente ineludible" e incluyendo el término "probable".

NIF C-15 "Deterioro en el valor de activos de larga duración"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien el 1 de enero de 2022 y permite su adopción anticipada. Deja sin efecto al Boletín C-15, "Deterioro" en el valor de los activos de larga duración y su disposición. Los cambios contables por su aplicación inicial deben reconocerse con base en el método prospectivo. Los principales cambios que presenta son:

Adiciona nuevos ejemplos de indicios para evaluar si existe deterioro, y los separa en fuentes externas de información, fuentes internas de información y aplicables a las inversiones en subsidiarias, asociadas o negocios conjuntos.

Cambia el requerimiento de uso de un precio neto de venta por el de valor razonable, menos los costos de disposición para llevar a cabo las pruebas de deterioro;

Establece la opción del uso de estimaciones de los flujos de efectivo futuros y de una tasa de descuento, en términos reales;

Incorpora normas para el tratamiento de flujos de efectivo futuros en moneda extranjera en la determinación del monto recuperable;

Modifica la NIF C-8, Activos intangibles, para indicar que la asignación del crédito mercantil debe hacerse a nivel de una unidad generadora de efectivo (UGE) que se espere será beneficiada por la sinergia de la adquisición de negocios;

Incorpora el reconocimiento del deterioro del crédito mercantil en dos pasos: i. primero, comparando el valor en libros de la UGE incluido el crédito mercantil con su monto recuperable, y si este último fuese menor se genera una pérdida por deterioro; y ii. segundo, afectando esta pérdida en primera instancia al crédito mercantil, incluso hasta dejarlo en cero, para después, si existiera un exceso de pérdida por asignar, distribuirlo a prorrata entre los demás activos de larga duración que formen parte de la UGE;

Elimina el cálculo del deterioro a través del valor a perpetuidad en los activos intangibles de vida útil indefinida, modificando la prueba de deterioro.

Establece la determinación del deterioro de los activos corporativos como sigue: i. primero, se asignan a la UGE a la que pertenece de manera razonable y consistente, ii. segundo, se compara el valor en libros de la UGE, incluidos los activos corporativos, con su monto recuperable y si este último fuese menor se genera una pérdida por deterioro, la cual se distribuye a prorrata entre todos los activos de larga duración que formen parte de la UGE, incluidos los activos corporativos,

Modifica las revelaciones en consecuente a los cambios antes descritos.

•
NIF C-16 "Deterioro de los instrumentos financieros por cobrar"- Establece las normas para el reconocimiento contable de las pérdidas por deterioro de todos los instrumentos financieros por cobrar (IFC); señala cuándo y cómo debe reconocerse una pérdida esperada por deterioro y establece la metodología para su determinación.

Los principales cambios que incluye esta NIF consisten en determinar cuándo y cómo deben reconocerse las pérdidas esperadas por deterioro de IFC, entre ellos:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 30 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

-
- Establece que las pérdidas por deterioro de un IFC deben reconocerse cuando al haberse incrementado el riesgo de crédito se concluye que una parte de los flujos de efectivo futuros del IFC no se recuperará.
 - Propone que se reconozca la pérdida esperada con base en la experiencia histórica que tenga la entidad de pérdidas crediticias, las condiciones actuales y los pronósticos razonables y sustentables de los diferentes eventos futuros cuantificables que pudieran afectar el importe de los flujos de efectivo futuros de los IFC.
 - En el caso de los IFC que devengan intereses, establece determinar cuánto y cuándo se estima recuperar del monto del IFC, pues el monto recuperable debe estar a su valor presente.

NIF C-17 "Propiedades de inversión"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2021 permitiendo su aplicación anticipada. Elimina la supletoriedad de la Norma Internacional de Contabilidad (NIC) 40 "Propiedades de inversión". Asimismo, deroga la Circular 55, "Aplicación supletoria de la NIC 40". Los efectos de su adopción deben reconocerse de forma retrospectiva. Los principales cambios son: 1) se ajusta la definición de propiedades de inversión para establecer que estos activos se tienen por un inversionista bajo un modelo de negocios cuyo objetivo principal es ganar por la apreciación de su valor (apreciación del capital) en el mediano plazo mediante su venta; 2) permite valuar las propiedades de inversión a su costo de adquisición o a su valor razonable.

NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar"- Entre las principales características que tiene se encuentran las siguientes:

- Se establece la posibilidad de valuar, subsecuentemente a su reconocimiento inicial, ciertos pasivos financieros a su valor razonable, cuando se cumplen ciertas condiciones.
- Valuar los pasivos a largo plazo a su valor presente en su reconocimiento inicial.
- Al reestructurar un pasivo, sin que se modifiquen sustancialmente los flujos de efectivo futuros para liquidar el mismo, los costos y comisiones erogados en este proceso afectarán el monto del pasivo y se amortizarán sobre una tasa de interés efectiva modificada, en lugar de afectar directamente la utilidad o pérdida neta.
- Incorpora lo establecido en la IFRIC 19 "Extinción de Pasivos Financieros con Instrumentos de Capital", tema que no estaba incluido en la normativa existente.
- El efecto de extinguir un pasivo financiero debe presentarse como un resultado financiero en el estado de resultado integral.
- Introduce los conceptos de costo amortizado para valuar los pasivos financieros y el de método de interés efectivo, basado en la tasa de interés efectiva.

NIF C-20 "Instrumentos financieros para cobrar principal e interés"- Entre los principales aspectos que cubre se encuentran los siguientes:

- La clasificación de los instrumentos financieros en el activo. Se descarta el concepto de intención de adquisición y tenencia de éstos para determinar su clasificación. En su lugar, se adopta el concepto de modelo de negocios de la administración, ya sea para obtener un rendimiento contractual, generar un rendimiento contractual y vender para cumplir ciertos objetivos estratégicos o para generar ganancias por su compra y venta, para clasificarlos de acuerdo con el modelo correspondiente.
 - El efecto de valuación de las inversiones en instrumentos financieros se enfoca también al modelo de negocios.
 - No se permite la reclasificación de los instrumentos financieros entre las clases de instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), la de instrumentos financieros para cobrar y vender (IFCV) y la de instrumentos financieros negociables, a menos de que cambie el modelo de negocios de la entidad.
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 31 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

•No se separa el instrumento derivado implícito que modifique los flujos de principal e interés del instrumento financiero por cobrar anfitrión, sino que todo el IFCPI se valorará a su valor razonable, como si fuera un instrumento financiero negociable.

NIF D-1 "Ingresos por contratos con clientes"- Entre los principales cambios se encuentran los siguientes:

- Establece la transferencia del control como base para la oportunidad del reconocimiento de los ingresos.
- Requiere la identificación de las obligaciones a cumplir en un contrato.
- Indica que la asignación del monto de la transacción entre las obligaciones a cumplir, debe realizarse con base en los precios de venta independientes.
- Introduce el concepto de "cuenta por cobrar condicionada".
- Requiere el reconocimiento de derechos de cobro.
- Establece requerimientos y orientación sobre cómo valorar la contraprestación variable y otros aspectos, al realizar la valuación del ingreso.

NIF D-2 "Costos por contratos con clientes"- Establece las normas para el reconocimiento contable de los costos de ventas de bienes o de prestación de servicios

Su principal cambio es la separación de la normativa relativa al reconocimiento de ingresos por contratos con clientes, de la correspondiente al reconocimiento de los costos por contratos con clientes. Adicionalmente, amplía el alcance que tenía el Boletín D-7, referenciado exclusivamente a costos relacionados con contratos de construcción y de fabricación de ciertos bienes de capital, para incluir costos relacionados con todo tipo de contratos con clientes.

NIF D-5 "Arrendamientos"- Los cambios más relevantes son los siguientes:

La norma contable introduce un único modelo de reconocimiento de los arrendamientos por el arrendatario y requiere que éste reconozca los activos y pasivos de todos los arrendamientos con una duración superior a 12 meses, a menos que el activo subyacente sea de bajo valor. Se requiere que reconozca un activo por derecho de uso que representa su derecho a usar el activo subyacente arrendado y un pasivo por arrendamiento que representa su obligación para hacer pagos por arrendamiento.

Se considera que los siguientes aspectos del nuevo modelo son los cambios más significativos e importantes para los arrendatarios:

- modificación de la definición de arrendamiento;
- eliminación de clasificación de arrendamientos operativos o financieros para un arrendatario, y éste reconoce un pasivo por arrendamiento al valor presente de los pagos por arrendamiento un activo por derecho de uso por ese mismo monto;
- aumento en los activos en arrendamiento y en los pasivos financieros de un arrendatario, lo que implica cambios en los indicadores financieros relacionados con los activos y pasivos de la entidad;
- cambia para los arrendatarios la naturaleza de los gastos relacionados con dichos arrendamientos: gasto por arrendamiento ahora dividido en un gasto por depreciación/amortización y gasto por interés;
- modificación en la presentación de los flujos de efectivo relacionados con arrendamientos operativos;
- modifica el reconocimiento de la ganancia o pérdida en arrendamientos de activos en vía de regreso.

Cabe mencionar que estos cambios entrarán en vigor el 1 de enero de 2022. El Grupo está en proceso de evaluación del impacto de las mismas.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 32 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Compra de cartera comercial

Durante el mes enero de 2021, el Banco celebró contratos de adquisición de cartera comercial a descuento con una institución financiera no relacionada, a la fecha de la compra la cartera estaba clasificada como cartera vigente, el valor en libros a la fecha de la compra era de \$874. El monto pagado por la transacción fue de \$865, generando una utilidad de \$9. La utilidad generada se registró en el estado consolidado de resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto" por \$5 y "Créditos diferidos y cobros anticipados" por \$4 que se amortizara conforme se realicen los cobros de dicha cartera adquirida.

Préstamo Bancario

Con fecha 19 de enero de 2021, el Banco firmó un contrato de apertura de crédito simple garantizado con activos elegibles fideicomitidos en fideicomiso de garantía con Banco de México por \$1,100, a una tasa promedio de la tasa interbancaria y a un plazo de 720 días.

"ver archivo completo en pdf"
