ANEXO
Scotiabank Inverlat

Informe Trimestral T1 2024

INDICADORES FINANCIEROS

Scotiabank-Indicadores Financieros	T2 2023	T3 2023	T4 2023	T1 2024
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	13.2%	14.8%	14.2%	13.1%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	1.3%	1.5%	1.4%	1.3%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.4%	3.3%	3.1%	3.0%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.2%	2.1%	2.2%	2.0%
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	4.0%	4.0%	3.3%	3.4%
Índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)	82.2%	79.8%	77.4%	76.9%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	21.94%	22.60%	21.47%	22.01%[1)]
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	16.59%	17.07%	15.99%	16.64%[1)]
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	50.6%	49.0%	47.2%	44.4%

1). Sujeto a aprobación de Banco Central

En el primer trimestre de 2024 Scotiabank alcanzó una utilidad neta de $2,610 millones, una disminución de $385 millones o 13% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente por mayores requerimientos de reservas crediticias. Por otro lado, el PTPP presentó un incremento de $535 millones o 13% respecto al mismo trimestre del año pasado alcanzando $4,804 millones; impulsado por mayores ingresos en el margen financiero e intermediación, así como una gestión eficiente del gasto.

La utilidad neta mostró una disminución de $218 millones u 8% respecto al trimestre anterior. Al mismo tiempo, el PTPP presentó un incremento de $497 millones o 12%, debido a mayores ingresos por intermediación y una gestión eficiente del gasto; compensados parcialmente por un menor margen financiero.

Scotiabank-Información Financiera (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Ingresos por intereses	18,392	21,215	20,840	13%
Gastos por intereses	(11,733)	(14,035)	(14,065)	20%
Margen Financiero	**6,659**	**7,180**	**6,775**	**2%**
Comisiones	1,199	1,210	1,114	-7%
Resultado por Intermediación	563	312	756	34%
Otros ingresos/egresos de la operación	282	115	212	-25%
Ingresos no Financieros	**2,044**	**1,637**	**2,082**	**2%**
Total Ingresos	**8,703**	**8,817**	**8,857**	**2%**
Gastos de Administración y Promoción	(4,434)	(4,510)	(4,053)	-9%
PTPP [1].	**4,269**	**4,307**	**4,804**	**13%**
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(145)	(1,191)	(1,034)	> +100%
Resultado de la Operación	**4,124**	**3,116**	**3,770**	**-9%**
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	79	394	(154)	> -100%
Resultado antes de Impuestos a la Utilidad	4,203	3,510	3,616	-14%
Impuestos a la Utilidad	(1,208)	(682)	(1,006)	-17%
Resultado Neto	**2,995**	**2,828**	**2,610**	**-13%**
Otros Resultados Integrales				
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	52	662	(254)	> -100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	(42)	(774)	125	> -100%
Remedición de beneficios definidos a los empleados	1	(154)	19	> +100%
Participación en ORI de otras entidades	-	1	-	0%
Resultado Integral	**3,006**	**2,563**	**2,500**	**-17%**

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

MARGEN FINANCIERO

El margen financiero fue de $6,775 millones al cierre del primer trimestre de 2024, un incremento de $116 millones o 2% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente por mayores ingresos en la cartera comercial e hipotecaria, así como un día más de operación; compensados parcialmente por mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró una disminución de $405 millones o 6%; debido principalmente a un día menos de operación y menores volúmenes de cartera comercial; compensado parcialmente por mayores volúmenes de menudeo.

INGRESOS NO FINANCIEROS

El total de ingresos no financieros fue de $2,082 millones en el primer trimestre de 2024, un incremento de $38 millones o 2% respecto al mismo trimestre del año pasado, debido principalmente a mayores resultados por intermediación en el mercado cambiario; compensados por menores comisiones provenientes de colocación de créditos.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron un incremento de $445 millones o 27%, debido principalmente a mayores resultados por intermediación en instrumentos financieros derivados; compensados por menores comisiones provenientes de colocación de créditos.

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Aceptaciones por Cuenta de Terceros	1	1	-	-100%
Actividades Fiduciarias	60	46	57	-5%
Apertura de Cuenta	6	5	4	-33%
Cartas de Crédito	75	81	81	8%
Cheques Certificados	1	1	1	0%
Compraventa de instrumentos financieros	-	-	1	0%
Manejo de Cuenta	83	91	106	28%
Operaciones de Crédito	400	482	395	-1%
Otras Comisiones y Tarifas	495	430	297	-40%
Servicios de Banca Electrónica	51	47	149	> +100%
Transferencia de Fondos	27	26	23	-15%
Total de Comisiones y Tarifas (netas)	**1,199**	**1,210**	**1,114**	**-7%**

Scotiabank- Otros Ingresos/Egresos de la operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	35	(15)	14	-60%
Aportaciones al IPAB	(533)	(577)	(582)	9%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	35	5	6	-83%
Donativos	-	(17)	-	0%
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados	6	9	8	33%
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito	-	-	-	0%
Ingresos por Arrendamiento	3	9	12	> +100%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados	46	56	56	22%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	762	787	751	-1%
Pérdida por venta de cartera de crédito	-	(79)	-	0%
Quebrantos	(72)	(149)	(105)	46%
Recuperaciones	-	3	-	0%
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo	-	(1)	-	0%
Utilidad por venta de cartera de crédito	-	84	2	0%
Resultado por adjudicación de bienes	-	-	50	0%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación	**282**	**115**	**212**	**-25%**

ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS

En el primer trimestre de 2024, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en $1,034 millones, un incremento de $889 millones respecto al mismo periodo del año anterior; debido a mayores requerimientos en tarjeta de crédito, vivienda, automotriz y consumo.

Respecto al trimestre pasado, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra una disminución de $157 millones o 13%, principalmente por menores requerimientos en la cartera comercial.

Scotiabank- Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	**(145)**	**(1,191)**	**(1,034)**	**> +100%**

GASTOS DE ADMINISTRACIÓN Y PROMOCIÓN

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en $4,053 millones en el primer trimestre de 2024, una disminución de $381 millones o 9% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una menor compensación variable; compensada parcialmente por mayores gastos por IVA, honorarios, procesadores y gastos generales.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, disminuyeron $457 millones o 10%, debido principalmente a menores gastos por amortización de sistemas, honorarios, IVA, así como por gastos generales.

Scotiabank- Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Gastos de Personal	(2,367)	(1,783)	(1,768)	-25%
Gastos de Operación	(2,067)	(2,727)	(2,285)	11%
Total de Gastos de Administración y Promoción	**(4,434)**	**(4,510)**	**(4,053)**	**-9%**

IMPUESTOS A LA UTILIDAD

En el primer trimestre de 2024, se registró un impuesto neto a cargo de $1,006 millones, una disminución de $202 millones o 17% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una menor utilidad gravable en el periodo.

Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto incrementó $324 millones o 48%, principalmente por una menor inflación en el periodo.

Scotiabank-Impuestos - Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Impuesto a la Utilidad Causado	(962)	(657)	(710)	-26%
Impuesto a la Utilidad Diferido	(246)	(25)	(296)	20%
Total de Impuestos a la Utilidad	**(1,208)**	**(682)**	**(1,006)**	**-17%**

BALANCE GENERAL

6% respecto al cierre de marzo de 2023. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en cartera de crédito total, inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental) y deudores por reporto.

Los activos totales disminuyeron $14,194 millones o 2% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a menores volúmenes de inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental) y cartera de crédito total; compensados parcialmente por mayores deudores por reporto.

El total del pasivo registró $740,940 millones al 31 de marzo de 2024, un incremento de $39,980 millones o 6% respecto al cierre de marzo de 2023. Este incremento se debe a mayores volúmenes en depósitos; compensados parcialmente por menores volúmenes en otros pasivos (acreedores por reporto, colaterales vendidos o dados en garantía y acreedores diversos).

El pasivo total disminuyo $16,694 millones o 2% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a menores volúmenes en otros pasivos (acreedores por reporto, colaterales vendidos o dados en garantía y valores asignados por liquidar); así como préstamos bancarios y de otros organismos; compensados parcialmente por mayores volúmenes en depósitos.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	248,273	284,193	273,601	10%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	472,571	496,519	492,728	4%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	18,550	17,061	17,583	-5%
Partidas diferidas	2,765	3,093	3,303	19%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(16,278)	(13,209)	(13,524)	-17%
Otros Activos	50,515	48,663	48,435	-4%
Total Activo	**776,396**	**836,320**	**822,126**	**6%**
Depósitos	485,731	541,557	553,302	14%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	35,734	36,804	33,035	-8%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,099	9,060	9,102	0%
Otros Pasivos	170,396	170,213	145,501	-15%
Total Pasivo	**700,960**	**757,634**	**740,940**	**6%**
Capital	**75,436**	**78,686**	**81,186**	**8%**
Total Pasivo y Capital	**776,396**	**836,320**	**822,126**	**6%**

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 1 Y 2

La cartera de préstamos de menudeo al 31 de marzo de 2024 alcanzó $258,864 millones, un incremento anual de $32,883 millones o 15% y de $8,109 o 3% millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado principalmente por mayores créditos a la vivienda.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de marzo de 2024 se ubicó en $233,864 millones, una disminución anual de $12,726 millones o 5%; debido a menores créditos de cartera empresarial o comercial; compensados parcialmente por mayores créditos a entidades gubernamentales y financieras.

Respecto al trimestre anterior, el total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales disminuyeron $11,900 millones o 5%, debido a menores créditos de cartera a entidades financieras, empresarial o comercial, así como gubernamentales.

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	33,042	37,274	39,526	20%
Créditos a la Vivienda	192,939	213,481	219,338	14%
Total Préstamos de Menudeo	**225,981**	**250,755**	**258,864**	**15%**
Actividad Empresarial o Comercial	216,060	200,774	196,171	-9%
Entidades Financieras	16,097	23,989	17,815	11%
Entidades Gubernamentales	14,433	21,001	19,878	38%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	**246,590**	**245,764**	**233,864**	**-5%**
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	**472,571**	**496,519**	**492,728**	**4%**

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 3

Al 31 de marzo de 2024 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó $17,583 millones, una disminución anual de $967 millones o 5% y un incremento trimestral de $522 millones o 3%.

Por otro lado, la estimación preventiva para riesgos crediticios al 31 de marzo de 2024 se ubicó en $13,524 millones, una disminución anual de $2,754 millones o 17% y un incremento trimestral de $315 millones o 2%.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 76.9% al 31 de marzo de 2024, una disminución respecto al año pasado y al trimestre anterior de 1,083pb y 50pb, respectivamente.

El índice de morosidad al 31 de marzo de 2024 fue de 3.4%, una disminución de 33pb respecto del año anterior y un incremento de 13pb respecto al trimestre pasado.

Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	18,550	17,061	17,583	-5%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(16,278)	(13,209)	(13,524)	-17%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta	**2,272**	**3,852**	**4,059**	**79%**
Índice de morosidad	**3.78%**	**3.32%**	**3.45%**	**-33 pb**

DEPÓSITOS

El total de depósitos registró $553,302 millones al 31 de marzo de 2024, un incremento anual de $ 67,571 millones o 14%, y de $11,745 millones o 2% respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral se debió principalmente a mayores depósitos de vista y ahorro.

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024	A/A Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro	**229,911**	**276,129**	**292,949**	**27%**
Público en General	205,915	208,686	212,753	3%
Mercado de Dinero	43,630	44,504	25,168	-42%
Total Depósitos a Plazo	**249,545**	**253,190**	**237,921**	**-5%**
Títulos de Crédito Emitidos	5,047	10,941	21,120	> +100%
Cuenta global de captación sin movimientos	1,228	1,297	1,312	7%
Total de Depósitos	**485,731**	**541,557**	**553,302**	**14%**

OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN

Al 31 de marzo de 2024, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en $9,102 millones, sin cambios significativos respecto al año pasado y al trimestre anterior.

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

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Instrumentos financieros negociables	**63,576**	**1,855**	**17**	**25**	**65,473**
Sin restricción:	-	-	17	25	42
Restringidos:	63,576	1,855	-	-	65,431
En operaciones de reporto	54,285	1,855	-	-	56,140
Préstamos de valores	1,064	-	-	-	1,064
Otros	8,227	-	-	-	8,227
Instrumentos financieros para cobrar o vender	**70,245**	**21,893**	**-**	**2,034**	**94,172**
Sin restricción:	69,514	21,893	-	2,034	93,441
Restringidos:	731	-	-	-	731
En operaciones de reporto	-	-	-	-	-
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	731	-	-	-	731
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	**4,960**	**-**	**-**	**-**	**4,960**
Sin restricción	4,960	-	-	-	4,960
Total	**138,781**	**23,748**	**17**	**2,059**	**164,605**

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

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I_BANSAN_24141	**14,922,556,935**	**10.90%**	**5**	**14,918**

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados
(millones de pesos al 31 de marzo de 2024 valor razonable)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Negociación	3,510	3,186	-	-	1,215	961	303	363	28,927	29,049	-	-	33,955	33,559
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	10,942	8,295	-	-	10,942	8,295

Scotiabank-Montos nocionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de marzo de 2024)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados	
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
Con fines de negociación												
Posición USD	5,018	5,259	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	214	231	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CHF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	57	57	555	535	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	92	92	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	12	12	1,159	1,159	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	203	3,049	3,987	1,123	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	27,438	27,103	426,712	457,037	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	671	671	6,385	6,604	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	8	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
Con fines de cobertura												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	66,583	580	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	647	517	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 **(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)**	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	155,304	40,613	-	195,917
Créditos a entidades financieras	17,582	233	-	17,815
Créditos a entidades gubernamentales	15,552	4,326	-	19,878
Créditos al consumo	38,552	-	-	38,552
Créditos a la vivienda	215,574	10	42	215,626
Total	**442,564**	**45,182**	**42**	**487,788**

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 31 de marzo de 2024)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	254	-	-	254
Créditos al consumo	974	-	-	974
Créditos a la vivienda	3,707	2	3	3,712
Total	**4,935**	**2**	**3**	**4,940**

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 31 de marzo de 2024)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	4,995	1,371	-	6,366
Créditos a entidades financieras	56	-	-	56
Créditos al consumo	941	-	-	941
Créditos a la vivienda	10,191	23	6	10,220
Total	**16,183**	**1,394**	**6**	**17,583**

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)	
Saldo al 31 de diciembre de 2023	**17,061**
Reestructuras	75
Recuperaciones	(387)
Castigos y quitas	(737)
Traspasos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 3	1,605
Fluctuación Tipo Cambio	(34)
Saldo al 31 de marzo de 2024	**17,583**

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)			
Saldo al 31 de diciembre de 2023			**13,209**
Más: Creación de reservas			27
Calificación			1,128
Menos: Adjudicaciones y otros			86
Castigos y quitas			714
Comercial		20	
Hipotecario		113	
Consumo		581	
Desliz cambiario			40
Saldo al 31 de marzo de 2024			**13,524**

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2			
Metropolitano	63.8%	69.3%	69.2%
Noroeste – Centro	10.5%	8.7%	8.8%
Norte	13.2%	11.2%	11.1%
Bajío	7.3%	6.3%	6.3%
Sur	5.2%	4.5%	4.6%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3			
Metropolitano	51.0%	57.2%	58.0%
Noroeste – Centro	16.3%	13.1%	13.8%
Norte	6.1%	5.9%	5.7%
Bajío	13.0%	13.5%	12.6%
Sur	13.6%	10.3%	9.9%

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

		Reservas Preventivas Necesarias				
			Consumo			
Grado de Riesgo	Importe Cartera Crediticia	Cartera Comercial	No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes	Cartera de Vivienda	Total Reservas Preventivas
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	443,352	933	116	476	327	1,852
Riesgo A2	62,618	570	39	212	17	838
Riesgo B1	5,552	19	52	66	17	154
Riesgo B2	7,113	18	78	36	51	183
Riesgo B3	3,888	21	24	41	41	127
Riesgo C1	3,121	2	62	75	54	193
Riesgo C2	3,976	77	40	106	232	455
Riesgo D	8,760	631	64	316	1,532	2,543
Riesgo E	9,515	3,804	665	286	2,021	6,776
Total	**547,895**	**6,075**	**1,140**	**1,614**	**4,292**	**13,121**
Exceso						**403**
Reservas Constituidas						**13,524**

NOTAS:

1). Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas, son las correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 31 de marzo de 2024.

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

La institución de crédito utiliza metodología de la CNBV para créditos a cargo personas morales y físicas con actividad empresarial distintas a entidades federativas, municipios y entidades financieras, con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales mayores o iguales a 14 millones de UDIs.

Para los portafolios de créditos a cargo de empresas con ventas menores a 14 millones de UDIs, para créditos a cargo de Entidades Federativas y Municipios, créditos para proyectos de Inversión con fuente de pago propia, créditos a cargo de Entidades Financieras, así como para la cartera de crédito menudeo, se utiliza la metodología establecida por la CNBV.

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	$	14
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		47
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3		3
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		339
Total	**$**	**403**

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 2024 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses” son:

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes (millones de pesos al 31 de marzo de 2024)	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	1,855	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	**11,209,692**	**1,855**	

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 31 de marzo de 2024)	ISR	PTU
Futuros castigos de crédito	4,888	1,347
Pagos anticipados	(626)	(172)
Comisiones cobradas por anticipado	(235)	(65)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	802	211
Plan de pensiones	1,067	293
Provisiones y otros	775	154
Otros	(776)	(72)
Efecto Neto en Diferido	**5,895**	**1,696**

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

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

Vencimiento	Préstamos		Financiamiento			Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	10,876	2,483	-	13,359
Largo	-	-	7,000	3,703	-	10,703
Total	**-**	**-**	**17,876**	**6,186**	**-**	**24,062**
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	12.85%	10.81%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	8,315	-	13	108	-	8,436
Largo	-	-	-	537	-	537
Total	**8,315**	**-**	**13**	**645**	**-**	**8,973**
Tasa Promedio	5.84%	0.00%	6.56%	5.92%	0.00%	
Total Préstamos Interbancarios	**8,315**	**-**	**17,889**	**6,831**	**-**	**33,035**

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 2024.

Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	31 mar 2023	31 dic 2023	31 mar 2024
Depósitos a la Vista	**48.1%**	**52.3%**	**55.3%**
Metropolitano	21.5%	27.4%	29.3%
Noroeste – Centro	9.0%	7.2%	9.3%
Norte	6.7%	7.0%	6.8%
Bajío	5.1%	5.0%	4.6%
Sur	5.8%	5.7%	5.3%
Depósitos Ventanilla	**42.8%**	**39.3%**	**40.0%**
Metropolitano	19.9%	18.0%	15.1%
Noroeste – Centro	4.4%	4.1%	4.2%
Norte	7.6%	7.5%	8.0%
Bajío	5.3%	6.0%	7.1%
Sur	5.6%	3.7%	5.6%
Total de Captación del Público	**90.9%**	**91.6%**	**95.3%**
Fondeo Profesional	**9.1%**	**8.4%**	**4.7%**

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional **Tasa Promedio** **(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)**	Pesos	Dólares
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	4.71%	2.11%
Depósitos a plazo	9.73%	0.00%

Scotiabank-Resultados por Intermediación (millones de pesos)	31 mar 2024
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(301)
Resultado por valuación de divisas	(209)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	766
Resultado por compraventa de divisas	502
Costos de transacción	(2)
Total	**756**

EMISIÓN DE CERTIFICADOS BURSÁTILES

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

	Cuarta*	**Primera	**Segunda
Clave de Pizarra	**SCOTIAB 23**	**SCOTIAB 24**	**SCOTIAB 24-2**
Monto de la Emisión	$7,125 millones	$5,189 millones	$4,811 millones
Fecha de Emisión y Colocación	18 agosto 2023	26 febrero 2024	26 febrero 2024
Plazo de Vigencia de la Emisión	927 días, aprox. 2.5 años	1,095 días, aprox. 3 años	2,548 días, aprox. 7 años
Garantía	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria
Tasa de interés	TIIE28+0.04	TIIE Fondeo+0.32%	9.24%
Pago de Intereses	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	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

* Programa autorizado por la CNBV en diciembre de 2018.
** Programa autorizado por la CNBV en febrero de 2024.

EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS

(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)

Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo	Importe ($)	Tasa (%)
18-diciembre-14	05-diciembre-24	MX0QSC1N0016	3,640	2,093,000,000	7.4
28-junio-18	09-junio-33	MX0QSC1N0024	5,460	3,360,000,000	12.3
11-septiembre-18	Perpetua	MX0QSC1N0032	-	3,455,000,000	11.3
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
99_SCOTIAB_5-21	4,772,100	29-abr-21	26-abr-24	1093	Index (IDBTVER)	477,210,000
99_SCOTIAB_6-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1093	Index (IDBTVER)	57,230,000
99_SCOTIAB_9-21	3,913,200	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	391,320,000
99_SCOTIAB_10-21	3,782,250	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	378,225,000
99_SCOTIAB_1-22	533,200	28-feb-22	25-feb-25	1093	MSFDVTHY Index	53,320,000
99_SCOTIAB_5-22	1,238,860	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	123,886,000
99_SCOTIAB_6-22	1,795,500	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	179,550,000
99_SCOTIAB_7-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_8-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_11-22	5,790,750	17-nov-22	14-nov-25	1093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	579,075,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-22	14-nov-25	1092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	803,800	19-dic-22	17-dic-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	80,380,000
99_SCOTIAB_1-23	120,200	03-mar-23	03-sep-24	550	iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)	12,020,000
99_SCOTIAB_2-23	5,842,850	27-jul-23	27-ene-25	550	Dólar - Peso (USDMXN)	584,285,000
99_SCOTIAB_3-23	423,600	31-ago-23	28-feb-25	547	Dólar - Peso (USDMXN)	42,360,000
83_SCOTIAB_4-23	146,267	21-nov-23	15-nov-24	360	S&P 500 Index (SPX)	14,626,700
99_SCOTIAB_5-23	2,536,050	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	253,605,000
99_SCOTIAB_6-23	1,736,600	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P / BMV IPC (MEXBOL)	173,660,000
99_SCOTIAB_7-23	481,400	15-dic-23	14-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	48,140,000
83_SCOTIAB_1-24	1,661,850	27-mar-24	05-nov-24	223	Dólar - Peso (USDMXN)	166,185,000
Total Bonos Bancarios al 31 de marzo de 2024						**3,853,351,700**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Aplicación del programa OTIS

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

a) CrediAuto

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

b) Hipotecario

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

c) Préstamo personal y préstamo de nómina

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

d) ScotiaLine

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

e) Tarjetas de crédito

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

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

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

		2024		
		Saldo con CCE OTIS	Efectos en Cartera y Estimación	Saldo sin CCE OTIS
Cartera comercial	$	233,610	-	233,610
Créditos de consumo		38,552	(7)	38,545
Créditos a la vivienda:		215,626	(20)	215,606
Etapa 1	$	487,788	(27)	487,761
Cartera comercial		254	-	254
Créditos de consumo		974	1	975
Créditos a la vivienda:		3,712	16	3,728
Etapa 2	$	4,940	17	4,957
Cartera comercial		6,422	-	6,422
Créditos de consumo		941	6	947
Créditos a la vivienda:		10,220	3	10,223
Etapa 3	$	17,583	9	17,592
Cartera de crédito	$	510,311	-	510,311
(+/-) Partidas diferidas	$	3,303	-	3,303
(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios	$	(13,524)	(11)	(13,535)
Total cartera de crédito, neta	$	500,090	(11)	500,079
Total activos	**$**	822,126	**(11)**	**822,115**
Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados)	$	(1,034)	(11)	(1,045)
Resultado neto	**$**	2,610	**(11)**	**2,599**
Total capital contable	**$**	81,186	**(11)**	**81,175**
Total pasivo y capital contable	**$**	822,126	**(11)**	**822,115**

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 2024)

Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	13,468
2	Resultados de ejercicios anteriores	56,116
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	11,603
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	81,187
	Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios	
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	1,710
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-
12	Reservas pendientes de constituir	-
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	-
14	Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable	No aplica
15	Plan de pensiones por beneficios definidos	-
16 conservador	Inversiones en acciones propias	-
17 conservador	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	-
18 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
19 conservador	Inversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
20 conservador	Derechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%)	-
21	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo)	-
22	Monto que excede el umbral del 15%	No aplica
23	del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
24	del cual: Derechos de servicios hipotecarios	No aplica
25	del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales	No aplica
26	Ajustes regulatorios nacionales	9,422
A	del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	-

B	del cual: Inversiones en deuda subordinada	-
C	del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	-
D	del cual: Inversiones en organismos multilaterales	-
E	del cual: Inversiones en empresas relacionadas	-
F	del cual: Inversiones en capital de riesgo	-
G	del cual: Inversiones en sociedades de inversión	-
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones	-
J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	8,625
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	797
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 deduciones	-
28	Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1	11,132
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	70,055
	Capital adicional de nivel 1: instrumentos	
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,483
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,483
32	de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables	No aplica
33	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1	-
34	Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1)	No aplica
35	del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
36	Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	3,483
	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)	3,483
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	73,538
	Capital de nivel 2: instrumentos y reservas	
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	3,476

47	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2	-
48	Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2)	No aplica
49	de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
50 conservador	Reservas	339
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	3,815
	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)	3,815
59	Capital total (TC = T1 + T2)	77,353
60	Activos ponderados por riesgo totales	464,864
	Razones de capital y suplementos	
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.07%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.82%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.64%
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)	18.17%
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)	8.07%
	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)	339
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,103
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 emero 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 amotizaciones y vencimientos)	-
84	Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual	-
85	Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-

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

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

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

	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.
20*	Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.
21	El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.
22	No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.
23	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
24	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
25	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.
26	Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.
	A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.
	B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
	H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.
	L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

	M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.
	O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
	P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas 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 2024)

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Efectivo y equivalentes de efectivo	46,028
BG2	Cuentas de Margen	1,297
BG3	Inversiones en instrumentos financieros	164,605
BG4	Deudores por reporto	17,083
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos financieros derivados	44,897
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(653)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	500,090
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	26,765
BG11	Bienes adjudicados (neto)	665
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	2,562
BG13	Inversiones permanentes	4,159
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta	14
BG15	Impuestos a la utilidad diferidos (neto)	5,864
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)	2,862
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,637
	Activos Intangibles (neto)	4,584
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	553,485
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	33,035
	Valores Asignados por liquidar	7,721
BG19	Acreedores por reporto	56,153
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	998
BG22	Instrumentos financieros derivados	41,854
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	-

BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	29,010
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por Impuestos a la Utilidad	217
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,131
	Pasivos por arrendamiento	1,794
	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	9,102
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	6,774
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	13,468
BG30	Capital ganado	67,717
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	336,181
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	480,614
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	78,725
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	24,160
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	998
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	-
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,725
BG41	Otras cuentas de registro	2,116,787

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 2024)

Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
	ACTIVO			
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	1,710	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) $1,710
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	-	
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	339	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) $339
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	8,625	BG 16 Activos Intangibles $4,583 más Gastos de Instalación $4,042
21	Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	797	BG 13 Inversiones Permanentes $ 797
	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	3,483	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,483
30	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental	33	-	
31	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S	46	3,476	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,476
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	13,468	BG 29 Capital Social $10,671 más Prima en Venta de Acciones $2,797
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	56,116	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores $56,116
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	828	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo $828
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	10,774	BG 30 Reservas de Capital $9,112 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta ($355) más Remedición por beneficios definidos a los empleados ($592) más Resultado Neto $2,610
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			
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

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

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

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales
(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	53,239	4,259
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	926	74
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA´s	2,372	190
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's, UMA´s o con rendimiento referido al INPC	29	2
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	7,137	571
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	1,973	158
Posición 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	203	16
Requerimiento de capital por impacto Vega	36	3
Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	33	3
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%)	817	65
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	3,612	289
Grupo III (ponderados al 25%)	1	0
Grupo III (ponderados al 50%)	1,008	81
Grupo III (ponderados al 57.5%)	22	2
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%)	3,978	318
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	1,092	87

Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	1,562	125
Grupo VI (ponderados al 20%)	4,493	359
Grupo VI (ponderados al 25%)	3,127	250
Grupo VI (ponderados al 30%)	11,901	952
Grupo VI (ponderados al 40%)	12,040	963
Grupo VI (ponderados al 50%)	36,168	2,893
Grupo VI (ponderados al 70%)	37	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	28,196	2,256
Grupo VI (ponderados al 85%)	6,440	515
Grupo VI (ponderados al 100%)	45,325	3,626
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%)	141	11
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	16,823	1,346
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	135	11
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	7,086	567
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	124,056	9,924
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	627	50
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,731	138
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%)	657	53
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	7,474	598
Grupo VIII (ponderados al 150%)	4,631	370
Grupo IX (ponderados al 100%)	25,414	2,033
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	32	3
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-

Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	2,582	207
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	17	1
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	203	16

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional		
Método empleado	**Activos ponderados por riesgo**	**Requerimiento de capital**
Indicador de Negocio	47,428	3,794

CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

El índice de capitalización de Scotiabank Inverlat S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (Scotiabank) fue de 16.64% al cierre de marzo 2024, 214pb superior al mínimo requerido para la categoría I del artículo 220 de las Disposiciones Generales aplicables a las Instituciones de Crédito (14.50% Índice regulatorio más suplementos de Absorción de Pérdidas Totales y de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local).

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

17	Tipo de rendimiento / dividendo	Fijo o Variable
18	Tasa de Interés /Dividendo	La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19	Cláusula de cancelación de dividendos	Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20	Discrecionalidad en el pago	Parcialmente discrecional.
21	Cláusula de aumento de intereses	No
22	Rendimientos / dividendos	No Acumulable
23	Convertibilidad del instrumento	N.A.
24	Condiciones de convertibilidad	N.A.
25	Grado de convertibilidad	N.A.
26	Tasa de conversión	N.A.
27	Tipo de convertibilidad del instrumento	N.A.
28	Tipo de instrumento financiero de la convertibilidad	N.A.
29	Emisor del instrumento	Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.
30	Cláusula de disminución de valor (Write-Down)	No
31	Condiciones para disminución de valor	N.A.
32	Grado de baja de valor	N.A.
33	Temporalidad de la baja de valor	N.A.
34	Mecanismos de disminución de valor temporal	N.A.
35	Posición de subordinación en caso de liquidación	Los títulos de las acciones están sujetos a las disposiciones que en su caso emite la Secretaría de Hacienda y Crédito Público y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, así como lo que al efecto dispongan los Estatutos Sociales.
36	Características de incumplimiento	NO
37	Descripción de características de incumplimiento	NO

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

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

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

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

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

Ref.	RUBRO	Mar-24[1)] T	Dic-23 T-1	Sep-23 T-2	Jun-23 T-3	Mar-23 T-4
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	15,792	16,280	7,799	7,585	7,638
1ª	No aplica					
2	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo	464,864	471,664	461,662	456,829	459,745
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	3.25%	3.25%	1.63%	1.63%	1.63%
3a	No aplica					
4	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones	842,238	868,289	831,882	809,032	814,737
5	"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	1.88%	1.88%	0.94%	0.94%	0.94%
5a	No aplica					
6a	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No
6b	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No
6c	En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?	0%	0%	0%	0%	0%

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

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

AUMENTOS Y/O DISMINUCIONES DE CAPITAL

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

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

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

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

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

SCOTIABANK INVERLAT / ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en equipos expertos por tipo de riesgo, lo anterior para garantizar una gestión adecuada tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

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

Riesgo de mercado

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

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre de marzo de 2024 fue de $16.67 millones y su promedio durante el primer trimestre de 2024 fue de $14.52 millones mismo que corresponde a un 0.018% del capital neto ($80,381 millones a febrero 2024, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del primer trimestre de 2024 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre Marzo 2024	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	1,309,746	1,242,575
Mercado de Dinero	53,019	54,375
Tipo de cambio		
Cash	4,398	3,392
Derivados	207,927	189,952
Capitales		
Derivados	9,559	10,542

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre Marzo 2024	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	17.06	13.24
Tipo de cambio	2.41	6.92
Capitales	0.00	0.00
VaR Global	**16.67**	**14.52**

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 2024 muestra una pérdida máxima de $269.79 millones. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, México 1994 por el denominado “Error de diciembre” y México 1997 por el efecto de la “crisis del rublo” y la crisis financiera asiática.

Asimismo, mensualmente se realizan pruebas de “backtesting” para comparar las pérdidas y ganancias teóricas y reales con el valor en riesgo observado y, en consecuencia, en su caso calibrar los modelos utilizados. El nivel de eficiencia del modelo se basa en el enfoque establecido por el BIS. Respecto de las pruebas de backtesting, durante el primer trimestre de 2024, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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

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

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

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

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de marzo 2024 así como el promedio del primer trimestre de 2024 se muestran a continuación:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)[2]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US	43,178	68,788
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	134,322	127,518

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales, incluyendo posiciones de derivados de cobertura. Adicionalmente, las exposiciones de riesgo de liquidez se encuentran dentro de los límites aprobados.

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el primer trimestre de 2024 de 152% y 113% respectivamente.

Por otro lado, el riesgo de tasas de interés deriva de la incertidumbre en las utilidades y/o valor del portafolio como resultado de movimientos en las tasas de interés, y se presenta cuando existen desfasamientos (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.

[2] Cifras previas al cierre del primer trimestre 2024.

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.

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de marzo 2024 y en promedio para el primer trimestre de 2024 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Valor Económico (+100 pbs)	(1,612)	(1,622)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(291)	(227)

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender[1)]	94,172	93,678
Derivados de Cobertura	86,945	87,967

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 2024 y el promedio del primer trimestre del 2024 fueron $3,911 millones y $3,430 millones, respectivamente.

RIESGO DE CRÉDITO

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del primer trimestre corresponde a $15 millones; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.

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

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

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

Al cierre del primer trimestre de 2024, el Banco mantiene $334 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

INFORMACIÓN METODOLÓGICA

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

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito[1]. (Cifras al 31 de marzo 2024)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.29%	2.80%
Consumo	3.77%	15.57%
Cartera Comercial	0.58%	4.19%
Total	**0.70%**	**4.46%**

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

Parámetros de Riesgo[1]. (Cifras a millones al 31 de marzo 2024)	EI[2].	PI	SP
Hipotecas	219,338	1.62%	16.86%
Consumo	57,484	4.75%	72.19%
Cartera Comercial	277,570	1.43%	43.99%

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

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

TÉCNICAS DE MITIGACIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO

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

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

La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de marzo de 2024.

POLÍTICAS PARA ASEGURAR LAS GARANTÍAS REALES Y ESTABLECER RESERVAS DE CRÉDITO

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

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

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

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

RIESGO DE CRÉDITO EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS

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

Al cierre de marzo 2024 y en promedio durante el primer trimestre de 2024, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.38% y 0.42% respectivamente.

RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES DE DERIVADOS

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

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

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

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

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

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

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

RIESGO OPERACIONAL

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

METODOLOGÍA GENERAL

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

POLÍTICAS PARA LA GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL

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

EVALUACIÓN DE RIESGO OPERACIONAL

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

MANUAL PARA LA RECOLECCIÓN Y CLASIFICACIÓN DE DATOS DE RIESGO OPERACIONAL

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

NIVELES DE TOLERANCIA DE RIESGO OPERACIONAL

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

INDICADORES CLAVE DE RIESGO (KRI)

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

RIESGO LEGAL

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

CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO OPERACIONAL

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

VALOR PROMEDIO DE LA EXPOSICIÓN

Durante el periodo de enero - marzo 2024, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por $103.7 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de marzo 2024 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman $61.9 millones, donde $2.5 millones corresponden al Riesgo Operacional y $59.4 millones al Riesgo Legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

RIESGO TECNOLÓGICO

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

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

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

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)
Periodo Reportado: enero 2024 – marzo 2024 (T1 2024)
Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez[3]

(Cifras en millones de pesos)		Calculo Individual T1 2024		Calculo Consolidado T1 2024	
		Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOSCOMPUTABLES					
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	114,362.12	No aplica	114,362.12
SALIDAS DE EFECTIVO					
2	Financiamiento minorista no garantizado	165,826	13,362	165,826	13,362
3	Financiamiento estable	97,220	6,501	97,220	6,501
4	Financiamiento menos estable	68,606	6,861	68,606	6,861
5	Financiamiento mayorista no garantizado	269,908	100,986	269,908	100,986
6	Depósitos operacionales	139,621	34,144	139,621	34,144
7	Depósitos no operacionales	123,550	60,106	123,550	60,106
8	Deuda no garantizada	6,736	6,736	6,736	6,736
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	500	No aplica	500
10	Requerimientos adicionales:	244,821	17,619	244,821	17,619
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,125	5,554	7,125	5,554
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	0	0	0	0
13	Líneas de crédito y liquidez	237,695	12,065	237,695	12,065
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	185	185	185	185
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,854	2,854	2,854	2,854
16	TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	135,505	No aplica	135,505
ENTRADAS DE EFECTIVO					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	7,215	791	7,215	791
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	50,114	31,819	50,114	31,819
19	Otras entradas de efectivo	16,263	16,263	16,263	16,263
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	73,591	48,872	73,591	48,872
					Importe ajustado
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	131,723	No aplica	131,723
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	86,633	No aplica	86,633
23	**COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]**	**No aplica**	**151.78**	**No aplica**	**151.78**

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

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

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

Durante marzo 2024, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):[4]

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por $74,005 millones y depósitos a plazo tradicionales por $34,877 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por $1,904 millones y $3,911 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por $12,181 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de $19,947 millones y por operaciones de call money de $10,653 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por $14,918 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de $135,059 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; $98,605 millones en títulos de deuda de nivel 1, $25,319 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por $8,022 millones y $3,664 millones en títulos de nivel 2.

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

Promedio del cuarto trimestre 2023: 150% – promedio del primer trimestre 2024: 152%

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

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron $3,998 millones y los depósitos en bancos crecieron en MXN $7,015 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de $12655 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en $22,459 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en $7,982, millones.

d) La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables[5];

Evolución de Activos Líquidos T1-2024	Enero	Febrero	Marzo
Efectivo	6%	6%	6%
Reservas en el Banco Central	37%	28%	19%
Nivel 1	55%	64%	73%
Nivel 2ª	2%	2%	2%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	**100%**	**100%**	**100%**

4 Salidas y entradas ponderadas para los próximos 30 días considerando los factores definidos en las Disposiciones de Carácter General sobre los requerimientos de Liquidez para las Instituciones de Banca Múltiple.
5 Activos líquidos computables bajo los lineamientos establecidos por Banco de México.

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento	Enero	Febrero	Marzo
CAPTACION TRADICIONAL			
Depósitos de exigibilidad inmediata	48%	47%	50%
Depósitos a plazo			
Del público en general	37%	38%	36%
Mercado de dinero	7%	5%	4%
Títulos de crédito emitidos	2%	4%	4%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	4%	4%	4%
De largo plazo	2%	2%	2%
Total	**100%**	**100%**	**100%**

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

- El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo con las políticas establecidas.
- Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:
- Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo-rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.
- Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.
- Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
- Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

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

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

Exposición Potencial Futura (marzo 2024) (Cifras en millones de pesos)	
Con contrato de compensación	2,716
Sin contrato de compensación	8,189
Posibles llamadas de margen (marzo 2024)	
Colateral en Tránsito	21
Downgrade (marzo 2024)	
Baja calificación 3 niveles	3, 911

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

Scotiabank-Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	1,309,746
Tipo de cambio	207,927
Capitales	9,559
Total	**1,527,232**

g) El descalce en divisas;

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

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

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el primer trimestre del 2024, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de 5% al cierre de marzo del 2024 y en promedio durante primer trimestre del 2024 fue de 7%.

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[6]	Límite MM
Concepto	
Concentración de Depósitos (MXN)	9,500 MXN
Concentración de Depósitos (USD)	175 USD

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

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

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

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

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

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

[6] Sujeto a excepciones para algunos nombres.

Descripción [7]	Promedio T1 2024	Marzo 2024
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	41,347	25,801
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	87,640	114,336
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	41	40
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	41	39
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	41	40
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	41	39

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

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

Los resultados al cierre de marzo 2024 y el promedio del primer trimestre de 2024 son

Scotiabank [8]	Posición (Cierre)[9]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	43,178	68,788
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	134,322	127,518

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.

[7] Sujeto a excepciones para algunos nombres.
[8] Sujeto a excepciones para algunos nombres.
[9] Cifras previas al cierre de marzo 2024.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

e) Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de estás: (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 2024, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del primer trimestre 2024, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)
Periodo Reportado: primer trimestre del 2024
Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto[10]

(Cifras en millones de pesos)	Cifras Individuales					Cifras Consolidadas				
	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado
	Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	**>1 año**	
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE										
1 Capital:	84,048.85	0.00	0.00	0.00	84,048.85	84,048.85	0.00	0.00	0.00	84,048.85
2 Capital fundamental y capital básico no fundamental.	84,048.85	0.00	0.00	0.00	84,048.85	84,048.85	0.00	0.00	0.00	84,048.85
3 Otros instrumentos de capital.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
4 Depósitos minoristas:	0.00	205,057.08	2,213.10	21.20	191,128.15	0.00	205,057.08	2,213.10	21.20	191,128.15
5 Depósitos estables.	0.00	90,483.33	792.40	17.50	86,729.44	0.00	90,483.33	792.40	17.50	86,729.44
6 Depósitos menos estables.	0.00	114,573.76	1,420.70	3.70	104,398.71	0.00	114,573.76	1,420.70	3.70	104,398.71
7 Financiamiento mayorista:	0.00	374,751.12	34,652.19	26,967.67	181,599.84	0.00	374,751.12	34,652.19	26,967.67	181,599.84
8 Depósitos operacionales.	0.00	42,741.14	0.00	0.00	21,370.57	0.00	42,741.14	0.00	0.00	21,370.57
9 Otro financiamiento mayorista.	0.00	332,009.98	34,652.19	26,967.67	160,229.27	0.00	332,009.98	34,652.19	26,967.67	160,229.27
10 Pasivos interdependientes	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11 Otros pasivos:	113.28	40,702.38	2,103.76	5,638.64	6,690.52	113.28	40,702.38	2,103.76	5,638.64	6,690.52
12 Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	113.28	0.00	0.00	0.00	0.00	113.28	0.00	0.00	0.00	0.00
13 Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	0.00	40,702.38	2,103.76	5,638.64	6,690.52	0.00	40,702.38	2,103.76	5,638.64	6,690.52
14 Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	84,162.13	620,510.58	38,969.05	32,627.52	463,467.36	84,162.13	620,510.58	38,969.05	32,627.52	463,467.36

[10] Anexo 10 de las disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple. Cifras Previas.

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	7,717.89	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	7,717.89
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
17	Préstamos al corriente y valores:	0.00	123,901.85	35,615.11	327,360.85	353,183.78	0.00	123,901.85	35,615.11	327,360.85	353,183.78
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	7,750.57	0.00	0.00	775.06	0.00	7,750.57	0.00	0.00	775.06
19	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	10,743.67	2,422.14	5,154.42	7,977.04	0.00	10,743.67	2,422.14	5,154.42	7,977.04
20	Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	86,504.46	29,851.05	133,415.68	165,084.70	0.00	86,504.46	29,851.05	133,415.68	165,084.70
21	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
22	Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:	0.00	3,831.13	4,036.86	232,583.23	169,850.89	0.00	3,831.13	4,036.86	232,583.23	169,850.89
23	Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	650.81	694.94	45,715.63	30,388.04	0.00	650.81	694.94	45,715.63	30,388.04
24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	15,722.84	0.00	1,923.14	9,496.09	0.00	15,722.84	0.00	1,923.14	9,496.09
25	Activos interdependientes.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
26	Otros Activos:	0.00	51,906.65	954.06	6,397.70	38,513.79	0.00	51,906.65	954.06	6,397.70	38,513.79
27	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00
28	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	No Aplica	1,506.54	0.00	0.00	1,280.56	No Aplica	1,506.54	0.00	0.00	1,280.56
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,001.39	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,001.39
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,483.29	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,483.29
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		50,400.11	954.06	6,397.70	32,748.55	0.00	50,400.11	954.06	6,397.70	32,748.55
32	Operaciones fuera de balance.	No Aplica	240,378.94	0.00	0.00	12,018.95	No Aplica	240,378.94	0.00	0.00	12,018.95
33	Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	411,434.41	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	411,434.41
34	**Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**112.65**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**112.65**

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

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

- Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por $190,204 millones y depósitos a plazo tradicionales por $140,253 millones, Capital (fundamental y complementario) por $89,198 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por $16,993 millones y $26,670 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por $6,067 millones.

- Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de $346,048 millones y por operaciones mercado de dinero de $19,495 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por $14,848 millones, deducciones de capital por $11,132 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por $4,220 millones.

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

Promedio del cuarto trimestre del 2023: 107.02% – Promedio del primer trimestre del 2024: 112.65%

El coeficiente de financiamiento neto incrementó 560pb respecto al cuarto trimestre del 2023, esto debido principalmente a::

a. El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 22,465 millones. El fondeo profesional disminuyó en MXN 9,219 millones.
b. El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas disminuyó $7,533 millones.

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

Monto Computable (MXN MM)	Enero	Febrero	Marzo
Financiamiento Estable Disponible	456,980	463,840	469,582
Financiamiento Estable Requerido	413,803	412,800	407,701
Coeficiente de Fondeo Estable Neto	**110.43%**	**112.36%**	**115.18%**

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

Las entidades objeto de consolidación de acuerdo con las reglas contables, y con aprobación del consejo de administración son las siguientes:

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

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

Posiciones en Acciones

Al cierre de marzo de 2024 la posición accionaria de títulos para negociar asciende $16.37 millones de pesos, con una minusvalía de $0.41 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1A_BABA_N	2,200	2.60	2.72	(0.12)
Scotiabank	Pública	1I_PSQ_*	383	0.06	0.06	-
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	182,950	0.60	0.59	0.01
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	200,000	3.12	3.07	0.05
Scotiabank	Pública	1_LASITE_B-1	9,373	0.05	0.05	-
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	8,800	5.75	5.99	(0.24)
Scotiabank	Pública	1I_SHV_*	2,200	4.02	4.13	(0.11)
Scotiabank	Pública	1E_FRES_*	1,736	0.17	0.17	-
Total			**407,642.00**	**16.37**	**16.78**	**(0.41)**

Al cierre del primer trimestre del año 2024, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por $0.20 millones de pesos.
La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1_GMEXICO_B	20,000	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	300	-	(0.03)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1_GCARSO_A1	6,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_GMEXICO_B	30,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_ALFA_A	71,731	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1_CEMEX_CPO	69,395	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_GCARSO_A1	34,487	0.05	(0.01)	0.04
Scotiabank	Pública	1_ALPEK_A	114,427	0.03	(0.05)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	35,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	423,976	0.01	(0.10)	(0.09)
Scotiabank	Pública	1A_BABA_N	3,125	0.17	(0.05)	0.12
Scotiabank	Pública	1E_FRES_*	23	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I_GDX_*	2,010	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1I_SHV_*	1,100	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	209	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1I_IB1MXX_N	717	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1I_IEF_*	10,175	-	(0.11)	(0.11)
Scotiabank	Pública	1_GFNORTE_O	72,275	0.02	(0.05)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1_GFINBUR_O	288,529	0.04	(0.06)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1_ALFA_A	40,000	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1_CEMEX_CPO	154,890	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1_ALPEK_A	107,760	0.03	(0.14)	(0.11)
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	72,288	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1A_BABA_N	500	-	(0.03)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1E_FRES_*	168	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I_EWZ_*	1,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I_GDX_*	200	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I_SHV_*	812	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	309	-	(0.04)	(0.04)

Scotiabank	Pública	1I_IB1MXX_N	300	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1_ALPEK_A	45,516	-	(0.04)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	28,106	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_GFINBUR_O	58,977	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1_ALPEK_A	101,618	0.07	(0.01)	0.06
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	100,000	0.07	-	0.07
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	278,502	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_CEMEX_CPO	180,000	0.14	-	0.14
Scotiabank	Pública	1_GFINBUR_O	136,779	0.02	(0.03)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1_LASITE_B-1	190,460	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	190,155	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	5,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1A_BABA_N	2,000	0.01	(0.04)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1E_FRES_*	4,700	0.01	(0.04)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1I_GDX_*	7,500	0.16	(0.02)	0.14
Scotiabank	Pública	1I_IB1MXX_N	228	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	305	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1I_PSQ_*	11,517	-	(0.04)	(0.04)
Total			**2,903,069**	**1.17**	**(0.97)**	**0.20**

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

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

31 de marzo de 2024, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de $4.93 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de $ 3.59 millones de pesos y el requerimiento por riesgo especifico asciende a la cantidad de $1.34 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición	Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado	16.46	0.31	16.15	22.23%	3.59
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	16.37	0.10	16.46	8.00%	1.32
Índices accionarios	0.10	0.22	0.32	4.00%	0.01
Requerimiento por riesgos específico	0.10	0.22	0.32	4.00%	0.01
Total Requerimiento de capital					**4.93**

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-23	mar-24
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	789,130	760,478
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,610)	(11,132)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	778,520	749,346
Exposiciones a instrumentos financieros derivados			
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	6,359	6,311
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	5,352	6,032
6	Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo		
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	(2,626)	(2,207)
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)	9,085	10,136
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	8,004	17,083
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(998)	(17,083)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	11	9
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)	7,017	9
Otras exposiciones fuera de balance			
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	258,234	336,181
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(185,583)	(253,435)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	72,651	82,747
Capital y exposiciones totales			
20	Capital de Nivel 1	71,660	73,538
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	867,273	842,238
Coeficiente de apalancamiento			
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	8.26%	8.73%

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

Referencia	DESCRIPCION	dic-23	mar-24
1	Activos totales	839,876	822,459
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	(574)	(797)
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	(33,657)	(34,762)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(987)	(17,074)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	72,651	82,747
7	Otros ajustes	(10,036)	(10,335)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	867,273	842,238

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

Referencia	DESCRIPCION	dic-23	mar-24
1	Activos totales	839,876	822,459
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(42,742)	(44,897)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(8,004)	(17,083)
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	789,130	760,478

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

CONCEPTO/PERIODO	dic-23	mar-24	Variación
Capital Básico [1)]	71,660	73,538	1,877
Activos Ajustados[2)]	867,273	842,238	(25,035)
Razón de Apalancamiento [3)]	8.26%	8.73%	47 pb

1). Reportado en la fila 20
2). Reportado en la fila 21 y
3). Reportado en la fila 22, de la Tabla I.1
Cifras previas a la réplica de Banxico

Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la Razón de

Apalancamiento por el periodo de diciembre 2023 a marzo de 2024.

El indicador se ubicó en 8.73%, 47pb mayor respecto el trimestre anterior, debido a la disminución en los activos ajustados por $25,035 millones o 25pb; principalmente por las exposiciones dentro del balance y a un incremento del capital nivel 1 por $1,877 millones o 22pb, debido principalmente por la utilidad del periodo.

TABLA I.2

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

Referencia	Explicación
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico (menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.
2	Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.
3	Suma de las líneas 1 y 2
4	Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) *recibidas,* siempre que se cumpla con las condiciones siguientes: **a)** Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución. **b)** La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia. **c)** El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda. **d)** El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente. **e)** El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos. En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.
5	Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones. En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7	Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
10	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11	Suma de las líneas 4 a 10
12	Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)

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

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

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

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

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

AGENCIAS CALIFICADORAS

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

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

DIVIDENDOS

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de octubre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de $2,400'000,000.00 (Dos mil cuatrocientos millones de pesos 00/100) M.N., a razón de $0.254768944692 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientas veinte millones trescientas mil cuatrocientos treinta y tres) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de "Utilidad de Ejercicios Anteriores".

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de diciembre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de $2,000'000,000.00 (Dos mil millones de pesos 00/100) M.N., a razón de $0.212307453910 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientos veinte millones trescientos mil cuatrocientos treinta y tres) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de "Resultado de Ejercicios Anteriores".

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 8 de febrero del 2023, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de $2,850,000,000.00 (Dos mil ochocientos cincuenta millones de pesos 00/100) M.N., a razón de $0.302538121822 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientos veinte millones trescientos mil cuatrocientos treinta y tres) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de "Resultado de Ejercicios Anteriores".

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

FUENTES INTERNAS Y EXTERNAS DE LIQUIDEZ

Al 31 de marzo de 2024, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN$114,318 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN$46,028 millones de pesos.

Adicionalmente:

- Se cuenta con líneas comprometidas con Instituciones Extranjeras por USD $250 millones de dólares.
- Se mantiene una buena calificación de crédito para asegurar acceso a préstamos a tasas y plazos competitivos.
- Se cuenta con una amplia base de depósitos tradicionales (Vista y Plazo), bien diversificada y segmentada entre los diferentes tipos de depositantes de tal forma que no se cuenta con dependencias relevantes que comprometan la liquidez de la institución.
- Adicionalmente se cuenta con préstamos de la banca de desarrollo y de fomento (Fovi, Nafin, Fira, entre otros) cuyas funciones son contar con una fuente de fondeo destinada a apoyar sectores específicos de la economía.

INVERSIONES RELEVANTES EN CAPITAL

Al 31 de marzo de 2024, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital

Instrumentos Financieros Derivados

Informe Trimestral T1 2024

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

A) DISCUSIÓN SOBRE LAS POLÍTICAS DE USO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2). (MR) Mercados reconocidos

3). (ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

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

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

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

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

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

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

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de marzo 2024 y en promedio para el primer trimestre de 2024 es de:

Scotiabank– Brechas de liquidez acumuladas (millones de pesos)	Posición (Cierre)[11]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	43,178	68,788
Liquidity Buffer	134,322	127,518

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

[11]Cifras previas a marzo 2024.

INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

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

INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

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

Producto	Subyacente	Moneda	Módelo de Valuación	Factor de Valuación	Fuente de Precios
OTC Single Stock Autocallable Option	Common Stock, Equity Index, ETF	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	EqOpt Autocallable Note	Curve Price Surface Correlation Dividend	VALMER K2 Trader's mark
Bond Futures	(All Interest Rate)	MXN	Price	OPICS	VALMER
Equity Index Future	Equity Index	MXN	Price	OPICS	VALMER
Equity Future	Equity Stock	MXN	Price	OPICS	VALMER
Interest Rate Future	(All Interest Rate)	MXN	Price	OPICS	VALMER
Listed Equity Index Future Option	Equity Index	MXN	Price	OPICS	VALMER
Listed Single Stock Option	Common Stock	MXN	Price	OPICS	VALMER
FX Futures	FX Spot	USD,BRL,CLP,COP, MXN,PEN,AUD,EUR, JPY,GBP,CHF,CAD	Price	OPICS	VALMER
OTC Foreign Exchange (FX) American Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Cox, Ross and Rubinstein	Curve FX Rate Surface	VALMER
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Merton, Reiner and Rubinstein	Curve FX Rate Surface	VALMER
OTC Foreign Exchange (FX) European Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Garman and Kohlhagen	Curve FX Rate Surface	VALMER
OTC FX Binary Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Black-Scholes	Curve FX Rate Surface	VALMER
Precious Metals European Option	Gold/Silver Bullion	Gold/Silver	Black 76	Curve Price Surface	VALMER Bloomberg/Reuters
Precious Metals Forward	Gold/Silver Bullion	Gold/Silver	Forward OTC Model	Curve Price	VALMER
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery Forward	FX Spot	MXN,USD,CAD,EUR, BRL,CLP,COP,PEN, AUD,JPY,GBP,CHF	Forex	Curve FX Rate	VALMER

INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO

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

POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO

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

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

a) Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:
   - Necesidades de tesorería del Banco
   - Relación de corresponsalía
   - Límites recíprocos

b) Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:
   - Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:
   - Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO

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

SUJETOS DE CRÉDITO

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

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

REGLAS PARTICULARES

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

IDONEIDAD DEL CLIENTE

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

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

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

POLÍTICAS DE VAR

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

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

B) DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN

MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:

CÁLCULO DE SENSIBILIDADES

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

PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)

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

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

BONOS DE TASA FLOTANTE

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

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

BONOS CUPÓN CERO

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

RIESGO DE CRÉDITO

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

SENSIBILIDAD DEL PASIVO

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

DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS

SWAPS DE TASA DE INTERÉS

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

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

FUTUROS DE TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

FUTUROS DE BONO M

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

FUTUROS DE CETE

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

EFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:

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

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

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

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

Grado de relación entre los cambios observados: R2 ≥ 80%.

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

Significancia de la regresión: F > 5.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2024 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

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

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

COBERTURA DE FLUJOS DE EFECTIVO:

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

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

COBERTURA DE VALOR RAZONABLE:

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

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

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

C) INFORMACIÓN DE RIESGOS POR EL USO DE DERIVADOS

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

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

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

Scotiabank– (millones de pesos)	Posición (Cierre)[12]	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer	134,322	127,518

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:

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

$$SD = \sum_{i=1}^{n} SD_i$$
$$SD_i = Max\left(\left|MTM\right| - T_{ij}, \left(T_{ii} - T_{ij}\right)\right)$$

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

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.

[12]Cifras previas a marzo 2024.

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario Estrés
Gap 30d Gap Acum	43,178	39,242	39,192	39,144
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(3,936)	(3,986)	(4,034)

D) ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD Y CAMBIOS EN EL VALOR RAZONABLE.

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

El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.

DELTA

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

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

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

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

GAMMA

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

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

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

VEGA

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

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

RHO

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

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

THETA

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

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

DIVIDEND RISK

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

II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA

Cifras expresadas en pesos

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a marzo 27, 2024:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	471,137.00	(129,463.00)	259,339.00	(82,166.00)	(102,568.00)	(28,900.00)	387,379.00
CCS	(12.00)	(55.00)	(140.00)	75.00	176.00	28.00	72.00
Caps&Floors	(230.00)	3,826.00	60.00	21.00	-	-	3,677.00
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total DERIVATIVES	**470,895.00**	**(125,692.00)**	**259,259.00**	**(82,070.00)**	**(102,392.00)**	**(28,872.00)**	**391,128.00**

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD

SUPUESTOS DE CÁLCULO.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

a) Bajo el escenario probable una pérdida de (176.24) Millones de pesos.
b) Con escenario poco probable un P&L de (352.49) Millones de pesos.
c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (861.66) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock (+/-)	P&L	Stress 1 Shock (+/-)	P&L	Stress 2 Shock (+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	0.39	(90.56)	50.00	(19.56)	100.00	(39.11)	200.00	(78.23)
Volatilidad al 1%	Caps &Floors	(0.02)	(0.46)	0.10	(0.00)	0.40	(0.01)	1.00	(0.02)
a FX %	Forwards	87.16	1,566.83	0.10	(156.68)	0.20	(313.37)	0.50	(783.42)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
Total					**(176.24)**		**(352.49)**		**(861.67)**

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 27 de marzo de 2024 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	251,607.00	6,261.00	67,064.00
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options META.OQ	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SLB.N	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options STX50E.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
Total	**251,607.00**	**6,261.00**	**67,064.00**

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 AAPL.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	(25,160.70)	(75,482.10)	(125,803.50)
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options META.OQ	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SLB.N	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options STX50E.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
Total	**(25,160.70)**	**(75,482.10)**	**(125,803.50)**

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

Escenarios al alza	0.05	0.15	0.2
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	12,580.35	37,741.05	50,321.40
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options META.OQ	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SLB.N	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options STX50E.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
Total	**12,580.35**	**37,741.05**	**50,321.40**

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Escenario	Monto
Probable	(25,160.70)
Poco Probable	(75,482.10)
Muy poco Probable	(125,803.50)

DESCRIBIR Y NUMERAR LAS LLAMADAS DE MARGEN QUE SE HAYAN PRESENTADO DURANTE EL TRIMESTRE

Respecto a las llamadas de margen, al 27 de marzo de 2024 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte	Colateral Recibido MXN	Colateral Enviado MXN	Colateral Recibido USD	Colateral Enviado USD
CLIENTE 1	-	-	1,285,000	(2,035,000)
CLIENTE 2	167,000,000	(186,000,000)	-	-
CLIENTE 3	-	-	-	(5,125,000)
CLIENTE 4	-	-	20,620,000	(265,000)
CLIENTE 5	3,000,000	(16,600,000)	-	-
CLIENTE 6	148,300,418	(163,100,000)	25,325,000	(20,575,000)
CLIENTE 7	-	-	18,220,000	(13,340,000)
CLIENTE 8	-	-	57,580,000	(25,640,000)
CLIENTE 9	-	-	205,300,000	(142,100,000)
CLIENTE 10	-	-	1,550,000	-
SUBTOTAL	**318,300,418**	**(365,700,000)**	**329,880,000**	**(209,080,000)**

Contraparte	Colateral Recibido MXN	Colateral Enviado MXN	Colateral Recibido USD	Colateral Enviado USD
CLIENTE 11	-	-	15,200,000	(3,360,000)
CLIENTE 12	-	-	33,120,000	(14,330,000)
CLIENTE 13	-	-	530,000	-
CLIENTE 14	5,600,000	(61,300,000)	-	-
CLIENTE 15	202,200,000	(246,600,000)	-	-
CLIENTE 16	300,000	-	-	-
CLIENTE 17	566,100,000	(252,400,000)	94,840,000	(72,300,000)
CLIENTE 18	1,049,349,143	(249,207,953)	-	-
CLIENTE 19	2,200,000	-	-	-
CLIENTE 20	-	-	6,280,000	(490,000)
CLIENTE 21	-	-	1,050,000	-
CLIENTE 22	-	-	3,670,000	-
CLIENTE 23	-	-	12,970,000	(11,160,000)
CLIENTE 24	2,144,049,560	(1,175,207,953)	497,540,000	(310,720,000)
TOTAL	**4,288,099,121**	**(2,350,415,906)**	**995,080,000**	**(621,440,000)**

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

Producto	Fecha	Cliente	Divisa	Monto	Motivo del incumplimiento
Interest Rate Swap	02/01/2024	Cliente 1	USD	23,943	No envió los fondos
Opcion fx	09/01/2023	Cliente 2	MXN	82,007	No confirmaron la operación
Opcion eq	11/01/2024	Cliente 3	MXN	10,026,500	No envió los fondos
Interest Rate Swap	15/01/2024	Cliente 4	MXN	811	Problemas SPEI
Interest Rate Swap	29/01/2024	Cliente 5	MXN	(844,184)	Retención Pago
Interest Rate Swap	29/01/2024	Cliente 6	MXN	(1,254,771)	Retención Pago
Interest Rate Swap	30/01/2024	Cliente 7	USD	93,000	No confirmaron la operación
FORWARD	01/02/2024	Cliente 8	USD	500,000	Problemas con Banca
FORWARD	13/02/2024	Cliente 9	MXN	57,654,300	Problemas envío de pago
Interest Rate Swap	19/02/2024	Cliente 10	MXN	168,986	No envió los fondos
Interest Rate Swap	28/02/2024	Cliente 11	MXN	(784,229)	Retención Pago
Interest Rate Swap	29/02/2024	Cliente 12	MXN	(1,243,268)	Retención Pago
Opcion fx	04/03/2024	Cliente 13	MXN	19,400	Problemas sistemas
Interest Rate Swap	04/03/2024	Cliente 14	USD	47,550	Problemas sistemas
Interest Rate Swap	04/03/2024	Cliente 15	USD	17,451	Problemas sistemas
Interest Rate Swap	04/03/2024	Cliente 16	USD	17,451	Problemas sistemas
Interest Rate Swap	04/03/2024	Cliente 17	USD	9,881	Problemas sistemas
Interest Rate Swap	04/03/2024	Cliente 18	USD	9,678	Problemas sistemas
Interest Rate Swap	04/03/2024	Cliente 19	USD	3,283	Problemas sistemas
FORWARD	15/03/2024	Cliente 20	MXN	9,528	Solo hizo pago parcial
Opcion fx	15/03/2024	Cliente 21	MXN	281,775	No envió los fondos
FORWARD	19/03/2024	Cliente 22	MXN	138,470	Problemas Instrucciones
FORWARD	19/03/2024	Cliente 23	MXN	139,192	Problemas Instrucciones
FORWARD	19/03/2024	Cliente 24	MXN	169,182	Problemas Instrucciones
FORWARD	22/03/2024	Cliente 25	MXN	163,929	Problemas Instrucciones
FORWARD	25/03/2024	Cliente 26	MXN	139,726	Problemas Instrucciones
FORWARD	25/03/2024	Cliente 27	MXN	140,570	Problemas Instrucciones
FORWARD	25/03/2024	Cliente 28	MXN	133,100	Problemas Instrucciones
FORWARD	21/03/2024	Cliente 29	USD	(7,976)	Problemas Instrucciones
FORWARD	21/03/2024	Cliente 30	USD	(8,139)	Problemas Instrucciones
FORWARD	21/03/2024	Cliente 31	USD	(8,181)	Problemas Instrucciones
FORWARD	21/03/2024	Cliente 32	USD	(8,278)	Problemas Instrucciones
FORWARD	21/03/2024	Cliente 33	USD	(9,944)	Problemas Instrucciones
FORWARD	26/03/2024	Cliente 34	USD	(7,990)	Problemas Instrucciones
Opcion fx	26/03/2024	Cliente 35	USD	200,000	Discrepancia en la liquidación
FORWARD	27/03/2024	Cliente 36	MXN	(7,681)	Problemas Instrucciones
FORWARD	27/03/2024	Cliente 37	MXN	1,789,800	No envió los fondos
Interest Rate Swap	27/03/2024	Cliente 38	USD	36	Discrepancia en la liquidación

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

Cifras expresadas en pesos

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
C67348	02/02/2024	Active		mxn/usd	401,470,000	20,000,000	
C67393	15/03/2024	Active		usd/mxn	1,959,619	37,271,948	
C67400	31/01/2024	Active		usd/mxn	5,000,000	88,900,000	
C67401	31/01/2024	Active		mxn/usd	88,900,000	5,000,000	
C67408	31/01/2024	Active		usd/mxn	12,564,689	232,446,746	
C67410	31/01/2024	Active		mxn/usd	232,446,746	12,564,689	
C67427	02/02/2024	Active		usd/mxn	20,000,000	401,470,000	
C85662	31/01/2024	Active		mxn/usd	379,995,505	20,094,950	
C85663	31/01/2024	Active		usd/mxn	20,094,950	379,995,505	
C87727	29/02/2024	Active		usd/mxn	12,797,766	227,160,347	
C87728	29/02/2024	Active		mxn/usd	227,160,347	12,797,766	
C88079	29/02/2024	Active		usd/mxn	15,528,730	266,123,610	
C88080	29/02/2024	Active		mxn/usd	266,123,610	15,528,730	
C91176	31/01/2024	Active		mxn/usd	1,095,885,000	63,000,000	
C91177	31/01/2024	Active		usd/mxn	63,000,000	1,095,885,000	
C91288	18/01/2024	Active		mxn/usd	2,560,500,000	150,000,000	
C91289	18/01/2024	Active		usd/mxn	150,000,000	2,560,500,000	
C91331	18/01/2024	Active		usd/mxn	200,000,000	3,388,000,000	
C91332	18/01/2024	Active		mxn/usd	3,388,000,000	200,000,000	
C91624	29/01/2024	Active		usd/mxn	200,000,000	3,442,000,000	
C91625	29/01/2024	Active		mxn/usd	2,581,500,000	150,000,000	
C91627	29/01/2024	Active		usd/mxn	150,000,000	2,581,500,000	
C91636	29/01/2024	Active		mxn/usd	3,442,000,000	200,000,000	
C91954	01/02/2024	Active		usd/mxn	301,428,496	5,169,498,703	
C91955	01/02/2024	Active		mxn/usd	5,169,498,703	301,428,496	
M00220481	25/01/2024	Active	600	mxn	600		
M00225584	31/01/2024	Active	600	mxn	600		
M00240494	29/02/2024	Active	171,170,000	mxn	171,170,000		
MNF386	19/02/2024	Active	3,000,000	usd		3,000,000	
MNF390	21/03/2024	Active	600,000,000	mxn		600,000,000	
MNF402	21/03/2024	Active	400,000,000	mxn		400,000,000	
MNF405	15/03/2024	Active	9,482,759	mxn		9,482,759	
MNF406	15/03/2024	Active	9,482,759	mxn		9,482,759	
MNF407	15/03/2024	Active	31,767,241	mxn		31,767,241	
MNF408	15/03/2024	Active	33,189,655	mxn		33,189,655	
MNF409	15/03/2024	Active	9,482,759	mxn		9,482,759	
MNF410	15/03/2024	Active	1,375,000	mxn		1,375,000	
MNF433	12/01/2024	Active	48,769,161	mxn		48,769,161	
P16951	29/02/2024	Active	353,458,355	mxn			353,458,355
P16952	29/02/2024	Active	353,458,355	mxn			353,458,355
P17010	09/01/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P17011	09/01/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P17012	09/01/2024	Active	400,000,000	mxn			400,000,000
P17027	08/01/2024	Active	78,188,086	mxn			78,188,086
P17028	08/01/2024	Active	78,188,086	mxn			78,188,086
P17039	24/03/2024	Active	1,000,000	mxn			1,000,000
P17041	24/03/2024	Active	1,333,333	mxn			1,333,333
P17045	24/03/2024	Active	1,000,000	mxn			1,000,000
P17060	24/03/2024	Active	1,333,333	mxn			1,333,333
P17118	10/01/2024	Active	227,283,888	mxn			227,283,888
P17119	10/01/2024	Active	227,283,888	mxn			227,283,888
P17156	08/03/2024	Active	3,000,000	mxn			3,000,000
P17157	08/03/2024	Active	3,000,000	mxn			3,000,000
P17158	08/03/2024	Active	3,000,000	mxn			3,000,000
P17159	08/03/2024	Active	3,000,000	mxn			3,000,000
P17160	08/03/2024	Active	2,000,000	mxn			2,000,000
P17161	08/03/2024	Active	2,000,000	mxn			2,000,000
P17162	08/03/2024	Active	2,000,000	mxn			2,000,000
P17196	01/02/2024	Active	400,000,000	mxn			400,000,000

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
P17197	01/02/2024	Active	400,000,000	mxn			400,000,000
P17283	23/03/2024	Active	10,000,000	mxn			10,000,000
P17289	08/03/2024	Active	2,000,000	mxn			2,000,000
P17671	22/01/2024	Active	75,000,000	mxn			75,000,000
P17672	22/01/2024	Active	75,000,000	mxn			75,000,000
P17679	09/01/2024	Active	400,000,000	mxn			400,000,000
P17698	31/01/2024	Active	17,429,396	mxn			17,429,396
P17699	31/01/2024	Active	17,429,396	mxn			17,429,396
P17717	21/02/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P17718	21/02/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P17735	12/03/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P17739	12/03/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P17769	20/03/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P17770	20/03/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P18093	23/03/2024	Active	10,000,000	mxn			10,000,000
P18118	24/03/2024	Active	1,000,000	mxn			1,000,000
P18119	24/03/2024	Active	1,333,333	mxn			1,333,333
P18127	24/03/2024	Active	1,000,000	mxn			1,000,000
P18128	24/03/2024	Active	1,333,333	mxn			1,333,333
P18160	22/01/2024	Active	75,000,000	mxn			75,000,000
P18161	22/01/2024	Active	75,000,000	mxn			75,000,000
P18350	09/03/2024	Active	32,900,000	usd			32,900,000
P18351	09/03/2024	Active	32,900,000	usd			32,900,000
P18623	31/01/2024	Active	52,100,000	usd			52,100,000
P18625	31/01/2024	Active	52,100,000	usd			52,100,000
P18694	10/02/2024	Active	10,000,000	mxn			10,000,000
P18696	10/02/2024	Active	10,000,000	mxn			10,000,000
P18697	10/02/2024	Active	10,000,000	mxn			10,000,000
P18698	10/02/2024	Active	10,000,000	mxn			10,000,000
P19186	09/03/2024	Active	9,783,180	usd			9,783,180
P19187	09/03/2024	Active	9,783,180	usd			9,783,180
P19195	15/03/2024	Active	18,576,795	usd			18,576,795
P19196	15/03/2024	Active	18,576,795	usd			18,576,795
P19197	15/03/2024	Active	10,408,104	usd			10,408,104
P19198	15/03/2024	Active	10,408,104	usd			10,408,104
SDQ845	28/02/2024	Active	50,000,000	usd	50,000,000	50,000,000	
SDQ846	28/02/2024	Active	50,000,000	usd	50,000,000	50,000,000	
SDQ847	28/02/2024	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	
SDQ849	28/02/2024	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	
SDQ853	28/02/2024	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	
SDQ857	28/02/2024	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	
SDQ858	28/02/2024	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	
SDQ861	28/02/2024	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	
SDQ864	28/02/2024	Active	50,000,000	usd	50,000,000	50,000,000	
SDQ867	28/02/2024	Active	50,000,000	usd	50,000,000	50,000,000	
SDQ871	28/02/2024	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	
SDQ872	28/02/2024	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	
SDR935	29/02/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDR982	27/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDR992	22/02/2024	Active	325,000,000	mxn	325,000,000	325,000,000	
SDR993	26/02/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDS005	26/02/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDS021	21/03/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SDS026	21/03/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SDS027	21/03/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SDS038	16/02/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDS040	16/02/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDS135	15/03/2024	Active	94,780,172	mxn	94,780,172	94,780,172	
SDS138	15/03/2024	Active	94,780,172	mxn	94,780,172	94,780,172	
SDS144	15/03/2024	Active	94,780,172	mxn	94,780,172	94,780,172	
SDS236	25/03/2024	Active	4,100,000	mxn	4,100,000	4,100,000	
SDS268	08/03/2024	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	
SDS272	08/03/2024	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	
SDS306	25/03/2024	Active	4,100,000	mxn	4,100,000	4,100,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDS408	25/01/2024	Active	352,500	mxn	352,500	352,500	
SDS413	25/01/2024	Active	1,657,500	mxn	1,657,500	1,657,500	
SDS419	31/01/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDS421	25/01/2024	Active	352,500	mxn	352,500	352,500	
SDS422	25/01/2024	Active	1,657,500	mxn	1,657,500	1,657,500	
SDS423	31/01/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDS441	24/01/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDS443	24/01/2024	Active	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SDS465	24/01/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDS478	07/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDS486	07/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDS516	22/03/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SDS607	19/02/2024	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SDS613	19/02/2024	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SDS616	19/02/2024	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SDS625	09/02/2024	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SDS626	12/02/2024	Active	10,931,299	mxn	10,931,299	10,931,299	
SDS629	12/02/2024	Active	10,931,299	mxn	10,931,299	10,931,299	
SDS630	09/02/2024	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	
SDS667	22/03/2024	Active	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	3,000,000,000	
SDS693	22/02/2024	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SDS740	22/03/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SDS745	25/01/2024	Active	8,400,000	mxn	8,400,000	8,400,000	
SDS760	25/01/2024	Active	8,400,000	mxn	8,400,000	8,400,000	
SDS767	28/02/2024	Active	600,000	usd	600,000	600,000	
SDS771	27/03/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS780	28/02/2024	Active	600,000	usd	600,000	600,000	
SDS845	27/03/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS848	21/03/2024	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SDS851	21/03/2024	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SDS853	21/03/2024	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SDS980	24/03/2024	Active	1,333,333	mxn	1,333,333	1,333,333	
SDS981	24/03/2024	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	
SDS988	24/03/2024	Active	1,333,333	mxn	1,333,333	1,333,333	
SDS997	24/03/2024	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	
SDT068	25/03/2024	Active	29,200,000	mxn	29,200,000	29,200,000	
SDT072	25/03/2024	Active	29,200,000	mxn	29,200,000	29,200,000	
SDT155	29/03/2024	Active	920,000,000	mxn	920,000,000	920,000,000	
SDT623	22/03/2024	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	
SDT624	15/01/2024	Active	22,900,000	mxn	22,900,000	22,900,000	
SDT647	22/03/2024	Active	1,333,333	mxn	1,333,333	1,333,333	
SDT648	15/01/2024	Active	22,900,000	mxn	22,900,000	22,900,000	
SDT656	15/01/2024	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SDT661	15/01/2024	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SDT665	15/01/2024	Active	7,100,000	mxn	7,100,000	7,100,000	
SDT681	15/01/2024	Active	7,100,000	mxn	7,100,000	7,100,000	
SDT739	08/01/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SDT741	22/03/2024	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	
SDT742	22/03/2024	Active	1,333,333	mxn	1,333,333	1,333,333	
SDT755	08/01/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SDT758	29/02/2024	Active	1,210,410	mxn	1,210,410	1,210,410	
SDT800	12/01/2024	Active	48,769,161	mxn	48,769,161	48,769,161	
SDT801	12/01/2024	Active	48,769,161	mxn	48,769,161	48,769,161	
SDT832	14/01/2024	Active	7,247,254	mxn	7,247,254	7,247,254	
SDT833	14/01/2024	Active	7,247,254	mxn	7,247,254	7,247,254	
SDT838	12/01/2024	Active	48,769,161	mxn	48,769,161	48,769,161	
SDT878	29/02/2024	Active	1,210,410	mxn	1,210,410	1,210,410	
SDT887	26/02/2024	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SDT926	23/02/2024	Active	1,421,290,000	mxn	1,421,290,000	1,421,290,000	
SDT928	23/02/2024	Active	1,421,290,000	mxn	1,421,290,000	1,421,290,000	
SDT976	22/02/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU001	22/01/2024	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SDU011	26/01/2024	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	
SDU042	26/01/2024	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDU206	08/01/2024	Active	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SDU213	08/01/2024	Active	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SDU221	08/01/2024	Active	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SDU322	03/01/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU342	08/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDU375	03/01/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU435	02/01/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU601	24/01/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU661	19/01/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU688	10/03/2024	Active	101,813	usd	101,813	101,813	
SDU707	10/03/2024	Active	101,813	usd	101,813	101,813	
SDU734	23/01/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU841	26/03/2024	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	
SDU852	08/03/2024	Active	13,291,177	mxn	13,291,177	13,291,177	
SDU873	26/03/2024	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	
SDU885	08/03/2024	Active	13,291,177	mxn	13,291,177	13,291,177	
SDV103	08/02/2024	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SDV111	08/02/2024	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SDV158	25/03/2024	Active	18,695,000	mxn	18,695,000	18,695,000	
SDV221	25/03/2024	Active	27,205,000	mxn	27,205,000	27,205,000	
SDV233	25/03/2024	Active	18,695,000	mxn	18,695,000	18,695,000	
SDV318	25/03/2024	Active	27,205,000	mxn	27,205,000	27,205,000	
SDV344	15/02/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV355	15/02/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV403	11/03/2024	Active	5,585,556	mxn	5,585,556	5,585,556	
SDV412	11/03/2024	Active	5,585,556	mxn	5,585,556	5,585,556	
SDV471	15/01/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDV520	29/02/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDV538	29/02/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDV545	29/02/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDV549	29/02/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDV556	15/02/2024	Active	175,000,000	mxn	175,000,000	175,000,000	
SDV561	15/02/2024	Active	175,000,000	mxn	175,000,000	175,000,000	
SDV565	29/02/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDV566	29/02/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDV573	29/02/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDV617	23/02/2024	Active	3,405,732	mxn	3,405,732	3,405,732	
SDV634	23/02/2024	Active	3,405,732	mxn	3,405,732	3,405,732	
SDV684	13/03/2024	Active	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	
SDV725	19/03/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW949	29/02/2024	Active	353,458,355	mxn	353,458,355	353,458,355	
SDW950	29/02/2024	Active	353,458,355	mxn	353,458,355	353,458,355	
SDX152	02/01/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDX163	01/02/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX183	01/02/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX188	08/02/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDX191	20/02/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDX204	19/02/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX209	22/02/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX210	26/02/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX213	27/02/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX216	22/02/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX244	05/03/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SDX246	06/03/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX252	29/02/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDX256	20/02/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SDX262	08/03/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX271	08/03/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDX275	19/03/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDX276	05/03/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX280	19/03/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX286	20/03/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDX298	21/03/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX301	06/03/2024	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDX327	27/03/2024	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SDX337	27/03/2024	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SDZ686	19/01/2024	Active	64,583,333	mxn	64,583,333	64,583,333	
SDZ750	19/01/2024	Active	64,583,333	mxn	64,583,333	64,583,333	
SFS689	02/01/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SFU007	11/01/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SFU798	18/01/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SFV211	19/01/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SFV396	22/01/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SFV397	22/01/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SFW407	24/01/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SFW967	26/01/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SFX178	29/01/2024	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SFY421	08/02/2024	Active	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SFY430	08/02/2024	Active	165,000,000	mxn	165,000,000	165,000,000	
SFY571	19/01/2024	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000	
SFY610	19/01/2024	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000	
SFY655	09/02/2024	Active	170,000,000	mxn	170,000,000	170,000,000	
SFY656	09/02/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SFY668	09/02/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SFY843	12/02/2024	Active	170,000,000	mxn	170,000,000	170,000,000	
SFY854	12/02/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SFZ858	21/02/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SFZ859	21/02/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SGA145	22/02/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SGA149	22/02/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SGA377	23/02/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGB380	01/03/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SGD560	11/03/2024	Active	570,000,000	mxn	570,000,000	570,000,000	
SGE161	13/03/2024	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SGE380	14/03/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SGE546	15/03/2024	Active	560,000,000	mxn	560,000,000	560,000,000	
SGE762	19/03/2024	Active	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SGE774	08/02/2024	Active	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000	
SGE775	08/02/2024	Active	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000	
SGF124	20/03/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SGF302	21/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGG139	26/03/2024	Active	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SGG844	27/03/2024	Active	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SGW931	15/03/2024	Active	2,949,035	mxn	2,949,035	2,949,035	
SGW932	15/03/2024	Active	2,949,035	mxn	2,949,035	2,949,035	
SHS502	01/02/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHU473	09/01/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHU692	10/01/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHU916	10/01/2024	Active	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000	
SHU941	10/01/2024	Active	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000	
SHV978	18/01/2024	Active	630,000,000	mxn	630,000,000	630,000,000	
SHX478	30/01/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SHX479	30/01/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SHY065	02/02/2024	Active	190,000,000	mxn	190,000,000	190,000,000	
SHY066	02/02/2024	Active	190,000,000	mxn	190,000,000	190,000,000	
SHY662	07/02/2024	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SHZ262	08/02/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHZ332	08/02/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHZ946	13/02/2024	Active	195,000,000	mxn	195,000,000	195,000,000	
SHZ947	13/02/2024	Active	195,000,000	mxn	195,000,000	195,000,000	
SIA310	15/02/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIA315	15/02/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIA316	15/02/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIA347	15/02/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIA843	21/02/2024	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	
SIB243	22/02/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIB248	22/02/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SIB252	22/02/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SIB324	22/02/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SIB423	21/02/2024	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	
SIB573	26/02/2024	Active	880,000,000	mxn	880,000,000	880,000,000	
SIB930	27/02/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SIB934	27/02/2024	Active	390,000,000	mxn	390,000,000	390,000,000	
SIB935	27/02/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SIC470	29/02/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SIC487	29/02/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIC788	01/03/2024	Active	480,000,000	mxn	480,000,000	480,000,000	
SIC911	01/03/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SID505	07/03/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SID611	08/03/2024	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SID650	08/03/2024	Active	290,000,000	mxn	290,000,000	290,000,000	
SID651	08/03/2024	Active	290,000,000	mxn	290,000,000	290,000,000	
SID680	08/03/2024	Active	290,000,000	mxn	290,000,000	290,000,000	
SIE259	12/03/2024	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SIE302	15/03/2024	Active	50,000,000	usd	50,000,000	50,000,000	
SIE515	16/03/2024	Active	19,700,000	usd	19,700,000	19,700,000	
SIE516	16/03/2024	Active	29,500,000	usd	29,500,000	29,500,000	
SIE518	13/03/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIE639	13/03/2024	Active	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SIE737	13/03/2024	Active	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SIF035	14/03/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SIF060	14/03/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SIF315	15/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SIF360	15/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SIF361	15/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SIF366	15/03/2024	Active	190,000,000	mxn	190,000,000	190,000,000	
SIF367	15/03/2024	Active	190,000,000	mxn	190,000,000	190,000,000	
SIF416	15/03/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SIF471	15/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SIF472	15/03/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SIF480	15/03/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SIF541	21/03/2024	Active	49,700,000	usd	49,700,000	49,700,000	
SIF542	21/03/2024	Active	49,700,000	usd	49,700,000	49,700,000	
SIG062	20/03/2024	Active	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	
SIG064	20/03/2024	Active	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	
SIG147	20/03/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SIH304	26/03/2024	Active	580,000,000	mxn	580,000,000	580,000,000	
SIH489	27/03/2024	Active	960,000,000	mxn	960,000,000	960,000,000	
SIH493	27/03/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SIH494	27/03/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SIH763	28/03/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIH934	29/03/2024	Active	950,000,000	mxn	950,000,000	950,000,000	
SIH965	29/03/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SIH966	29/03/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SII103	28/03/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIM230	02/01/2024	Active	800,000,000	mxn	800,000,000	800,000,000	
SIM754	05/01/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIM910	05/01/2024	Active	2,040,000,000	mxn	2,040,000,000	2,040,000,000	
SIN615	11/01/2024	Active	325,000,000	mxn	325,000,000	325,000,000	
SIP278	23/01/2024	Active	765,000,000	mxn	765,000,000	765,000,000	
SIP950	26/01/2024	Active	2,350,000,000	mxn	2,350,000,000	2,350,000,000	
SIP976	26/01/2024	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	
SIQ005	26/01/2024	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	
SIQ006	26/01/2024	Active	1,350,000,000	mxn	1,350,000,000	1,350,000,000	
SIQ007	26/01/2024	Active	800,000,000	mxn	800,000,000	800,000,000	
SJB076	30/01/2024	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	
SJD129	14/02/2024	Active	525,000,000	mxn	525,000,000	525,000,000	
SJD705	19/02/2024	Active	2,190,000,000	mxn	2,190,000,000	2,190,000,000	
SJD709	19/02/2024	Active	257,500,000	mxn	257,500,000	257,500,000	
SJD711	19/02/2024	Active	257,500,000	mxn	257,500,000	257,500,000	
SJF212	31/01/2024	Active	12,840,814	mxn	12,840,814	12,840,814	
SJF264	31/01/2024	Active	12,840,814	mxn	12,840,814	12,840,814	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SJG070	05/03/2024	Active	515,000,000	mxn	515,000,000	515,000,000	
SJG898	08/03/2024	Active	1,020,000,000	mxn	1,020,000,000	1,020,000,000	
SJG906	08/03/2024	Active	2,050,000,000	mxn	2,050,000,000	2,050,000,000	
SJG907	08/03/2024	Active	1,020,000,000	mxn	1,020,000,000	1,020,000,000	
SJG908	08/03/2024	Active	1,020,000,000	mxn	1,020,000,000	1,020,000,000	
SJH399	14/03/2024	Active	770,000,000	mxn	770,000,000	770,000,000	
SJH754	15/03/2024	Active	520,000,000	mxn	520,000,000	520,000,000	
SJH991	05/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJI005	05/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJI612	09/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJI619	09/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJI691	22/03/2024	Active	765,000,000	mxn	765,000,000	765,000,000	
SJI829	25/03/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJI972	12/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJJ012	12/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJJ424	04/01/2024	Active	740,000,000	mxn	740,000,000	740,000,000	
SJJ471	16/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJJ479	16/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJJ842	30/01/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SJJ844	30/01/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SJJ867	15/01/2024	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SJJ868	11/01/2024	Active	2,500,000	usd	2,500,000	2,500,000	
SJJ877	15/01/2024	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SJJ880	11/01/2024	Active	2,500,000	usd	2,500,000	2,500,000	
SJK026	20/02/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SJK031	20/02/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SJK726	15/01/2024	Active	2,220,000,000	mxn	2,220,000,000	2,220,000,000	
SJL667	19/01/2024	Active	580,000,000	mxn	580,000,000	580,000,000	
SJL934	24/01/2024	Active	1,909,090	mxn	1,909,090	1,909,090	
SJL935	30/01/2024	Active	10,722,726	mxn	10,722,726	10,722,726	
SJL943	30/01/2024	Active	38,545,448	mxn	38,545,448	38,545,448	
SJL950	23/01/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SJL952	24/01/2024	Active	1,909,090	mxn	1,909,090	1,909,090	
SJL953	30/01/2024	Active	10,722,726	mxn	10,722,726	10,722,726	
SJL954	30/01/2024	Active	38,545,448	mxn	38,545,448	38,545,448	
SJM345	07/02/2024	Active	2,199,272	mxn	2,199,272	2,199,272	
SJM369	07/02/2024	Active	2,199,272	mxn	2,199,272	2,199,272	
SJM744	08/02/2024	Active	10,988,723	mxn	10,988,723	10,988,723	
SJM749	06/01/2024	Active	5,500,000	mxn	5,500,000	5,500,000	
SJM760	08/02/2024	Active	10,988,723	mxn	10,988,723	10,988,723	
SJM762	06/01/2024	Active	5,500,000	mxn	5,500,000	5,500,000	
SJM814	29/01/2024	Active	800,000,000	mxn	800,000,000	800,000,000	
SJM979	12/02/2024	Active	7,846,062	mxn	7,846,062	7,846,062	
SJM989	12/02/2024	Active	7,846,062	mxn	7,846,062	7,846,062	
SJN072	30/01/2024	Active	216,755,567	mxn	216,755,567	216,755,567	
SJN211	09/02/2024	Active	93,302,125	mxn	93,302,125	93,302,125	
SJN256	09/02/2024	Active	93,302,125	mxn	93,302,125	93,302,125	
SJN645	15/03/2024	Active	17,000,000	mxn	17,000,000	17,000,000	
SJN669	15/03/2024	Active	17,000,000	mxn	17,000,000	17,000,000	
SJN764	05/02/2024	Active	1,130,000,000	mxn	1,130,000,000	1,130,000,000	
SJO171	12/03/2024	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SJO575	12/03/2024	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SJP670	16/02/2024	Active	4,522,727	mxn	4,522,727	4,522,727	
SJP677	16/02/2024	Active	4,522,727	mxn	4,522,727	4,522,727	
SJP884	27/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJP905	27/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJP961	15/02/2024	Active	1,850,000,000	mxn	1,850,000,000	1,850,000,000	
SJQ356	28/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJQ369	28/01/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJQ486	03/01/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJQ507	03/01/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJQ545	02/02/2024	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SJQ549	02/02/2024	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SJQ721	31/01/2024	Active	10,900,000	mxn	10,900,000	10,900,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SJQ800	31/01/2024	Active	10,900,000	mxn	10,900,000	10,900,000	
SJR206	05/01/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJR239	05/01/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJR532	02/02/2024	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SJR564	02/02/2024	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SJR874	09/02/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJR875	08/03/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJR879	09/02/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJR881	08/03/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJS043	09/02/2024	Active	3,000,000	mxn	3,000,000	3,000,000	
SJS096	09/02/2024	Active	3,000,000	mxn	3,000,000	3,000,000	
SJS438	13/03/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SJS452	13/03/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SJS467	04/03/2024	Active	1,900,000,000	mxn	1,900,000,000	1,900,000,000	
SJU047	11/03/2024	Active	1,900,000,000	mxn	1,900,000,000	1,900,000,000	
SJV869	26/01/2024	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SJW362	26/01/2024	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SJX087	20/03/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SJX145	01/03/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SJX153	01/03/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SJX214	21/03/2024	Active	535,000,000	mxn	535,000,000	535,000,000	
SJX215	21/03/2024	Active	535,000,000	mxn	535,000,000	535,000,000	
SJX394	03/01/2024	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
SJX406	03/01/2024	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
SJX478	01/03/2024	Active	21,000,000	mxn	21,000,000	21,000,000	
SJX545	01/03/2024	Active	21,000,000	mxn	21,000,000	21,000,000	
SJX668	05/01/2024	Active	3,500,000	usd	3,500,000	3,500,000	
SJX669	05/01/2024	Active	3,500,000	usd	3,500,000	3,500,000	
SJY331	12/03/2024	Active	37,996,102	mxn	37,996,102	37,996,102	
SJY349	12/03/2024	Active	37,996,102	mxn	37,996,102	37,996,102	
SJY447	09/02/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJY453	09/02/2024	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SJZ987	14/02/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SKA027	17/01/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SKA665	27/03/2024	Active	27,005,084	mxn	27,005,084	27,005,084	
SKA667	27/03/2024	Active	27,005,084	mxn	27,005,084	27,005,084	
SKA857	25/03/2024	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	
SKA858	25/03/2024	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	
SKB514	29/01/2024	Active	2,500,000,000	mxn	2,500,000,000	2,500,000,000	
SKB847	31/01/2024	Active	3,865,000,000	mxn	3,865,000,000	3,865,000,000	
SKB856	31/01/2024	Active	1,930,000,000	mxn	1,930,000,000	1,930,000,000	
SKC408	04/03/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SKC484	05/02/2024	Active	3,800,000,000	mxn	3,800,000,000	3,800,000,000	
SKC485	05/02/2024	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	
SKE047	15/02/2024	Active	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	3,000,000,000	
SKE510	20/02/2024	Active	1,600,000,000	mxn	1,600,000,000	1,600,000,000	
SKI454	08/03/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SKI539	08/03/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SKK193	27/03/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SKK290	27/03/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024022803427	BO	CHFMXN	02/29/2024	1,000,000	19.45213	(19,452,132)
2024010203445	S	EURUSD	01/04/2024	(35,000,000)	1.09544	38,340,400
2024010403135	B	EURUSD	01/08/2024	1,000,000	1.09593	(1,095,930)
2024010403095	S	EURUSD	01/08/2024	(1,000,000)	1.0964	1,096,400
2024010803022	B	EURUSD	01/10/2024	1,000,000	1.09566	(1,095,660)
2024010803167	S	EURUSD	01/10/2024	(1,000,000)	1.097	1,097,000
2024010903438	BO	EURUSD	01/10/2024	1,500,000	1.09361	(1,640,409)
2024010903091	B	EURUSD	01/11/2024	1,000,000	1.09431	(1,094,310)
2024010903092	B	EURUSD	01/11/2024	1,000,000	1.09432	(1,094,320)
2024010903269	B	EURUSD	01/11/2024	1,000,000	1.09315	(1,093,150)
2024010903170	S	EURUSD	01/11/2024	(1,000,000)	1.09241	1,092,410
2024010903181	S	EURUSD	01/11/2024	(1,000,000)	1.092	1,092,000
2024010903245	S	EURUSD	01/11/2024	(1,000,000)	1.0929	1,092,900
2024011003041	B	EURUSD	01/12/2024	1,000,000	1.09358	(1,093,580)
2024011003109	B	EURUSD	01/12/2024	1,000,000	1.09596	(1,095,960)
2024011003216	B	EURUSD	01/12/2024	1,000,000	1.09592	(1,095,920)
2024011003245	B	EURUSD	01/12/2024	1,000,000	1.09546	(1,095,460)
2024011003487	B	EURUSD	01/12/2024	1,000,000	1.09699	(1,096,990)
2024011003489	B	EURUSD	01/12/2024	1,000,000	1.09698	(1,096,980)
2024011003046	S	EURUSD	01/12/2024	(1,000,000)	1.09328	1,093,280
2024011003064	S	EURUSD	01/12/2024	(1,000,000)	1.09399	1,093,990
2024011003070	S	EURUSD	01/12/2024	(1,000,000)	1.09443	1,094,430
2024011003254	S	EURUSD	01/12/2024	(1,000,000)	1.09572	1,095,720
2024011003286	S	EURUSD	01/12/2024	(1,000,000)	1.09631	1,096,310
2024011003340	S	EURUSD	01/12/2024	(1,000,000)	1.09665	1,096,650
2024010303215	BO	EURMXN	01/16/2024	93,960	18.65361	(1,752,694)
2024011103122	B	EURUSD	01/16/2024	1,000,000	1.09366	(1,093,660)
2024011103160	S	EURUSD	01/16/2024	(1,000,000)	1.09434	1,094,340
2024011203348	B	EURUSD	01/16/2024	1,000,000	1.09566	(1,095,660)
2024011203380	B	EURUSD	01/16/2024	1,000,000	1.09544	(1,095,440)
2024011203121	S	EURMXN	01/16/2024	(50,000)	18.52307	926,153
2024011203558	S	EURUSD	01/16/2024	(1,000,000)	1.09574	1,095,740
2024011203604	S	EURUSD	01/16/2024	(1,000,000)	1.09602	1,096,020
2024011603822	S	EURMXN	01/17/2024	(50,000,000)	18.7129	935,645,200
2023102603600	BO	EURMXN	01/18/2024	205,200	19.51988	(4,005,479)
2024011603055	B	EURUSD	01/18/2024	1,000,000	1.0878	(1,087,800)
2024011603544	B	EURUSD	01/18/2024	1,000,000	1.08699	(1,086,990)
2024011603597	B	EURUSD	01/18/2024	1,000,000	1.08688	(1,086,880)
2024011603076	S	EURUSD	01/18/2024	(1,000,000)	1.08723	1,087,230
2024011603556	S	EURUSD	01/18/2024	(1,000,000)	1.08739	1,087,390
2024011603799	S	EURUSD	01/18/2024	(1,000,000)	1.08708	1,087,080
2023110303473	B	EURMXN	01/19/2024	1,161,200	18.98673	(22,047,396)
2023111503571	BO	EURMXN	01/19/2024	200,000	19.04056	(3,808,111)
2024011703055	B	EURUSD	01/19/2024	1,000,000	1.08678	(1,086,780)
2024011703079	B	EURUSD	01/19/2024	1,000,000	1.08533	(1,085,330)
2024011703146	B	EURUSD	01/19/2024	1,000,000	1.0865	(1,086,500)
2024011703297	B	EURUSD	01/19/2024	1,000,000	1.08541	(1,085,410)
2024011703041	S	EURUSD	01/19/2024	(1,000,000)	1.08623	1,086,230
2024011703127	S	EURUSD	01/19/2024	(1,000,000)	1.0855	1,085,500
2024011703139	S	EURUSD	01/19/2024	(1,000,000)	1.08597	1,085,970
2024011703290	S	EURUSD	01/19/2024	(1,000,000)	1.0859	1,085,900
2024011803048	B	EURUSD	01/22/2024	1,000,000	1.0855	(1,085,500)
2024011803142	B	EURUSD	01/22/2024	1,000,000	1.086	(1,086,000)
2024011803101	S	EURUSD	01/22/2024	(1,000,000)	1.086	1,086,000
2024011803117	S	EURUSD	01/22/2024	(1,000,000)	1.08621	1,086,210
2024011903835	BO	EURMXN	01/22/2024	3,000,000	18.61841	(55,855,227)
2024011903032	B	EURUSD	01/23/2024	1,000,000	1.08769	(1,087,690)
2024011903113	B	EURUSD	01/23/2024	1,000,000	1.08772	(1,087,720)
2024011903413	B	EURUSD	01/23/2024	1,000,000	1.08881	(1,088,810)
2024011903034	S	EURUSD	01/23/2024	(1,000,000)	1.08748	1,087,480
2024011903102	S	EURUSD	01/23/2024	(1,000,000)	1.0877	1,087,700
2024011903251	S	EURUSD	01/23/2024	(1,000,000)	1.08835	1,088,350
2024012203158	B	EURUSD	01/24/2024	1,000,000	1.08861	(1,088,610)
2024012203255	B	EURUSD	01/24/2024	1,000,000	1.08891	(1,088,910)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024012203442	B	EURUSD	01/24/2024	1,000,000	1.08875	(1,088,750)
2024012203130	S	EURUSD	01/24/2024	(1,000,000)	1.08924	1,089,240
2024012203244	S	EURUSD	01/24/2024	(1,000,000)	1.08906	1,089,060
2024012203526	S	EURUSD	01/24/2024	(1,000,000)	1.08809	1,088,090
2024012303094	B	EURUSD	01/25/2024	1,000,000	1.08524	(1,085,240)
2024012303098	S	EURUSD	01/25/2024	(1,000,000)	1.08475	1,084,750
2024012603140	B	EURUSD	01/30/2024	1,000,000	1.08605	(1,086,050)
2024012603353	S	EURUSD	01/30/2024	(1,000,000)	1.08682	1,086,820
2024012903173	B	EURUSD	01/31/2024	1,000,000	1.07998	(1,079,980)
2024012903188	B	EURUSD	01/31/2024	1,000,000	1.07981	(1,079,810)
2024012903656	B	EURUSD	01/31/2024	1,000,000	1.08187	(1,081,870)
2024012903657	B	EURUSD	01/31/2024	1,000,000	1.08187	(1,081,870)
2024012903231	S	EURUSD	01/31/2024	(1,000,000)	1.08038	1,080,380
2024012903247	S	EURUSD	01/31/2024	(1,000,000)	1.08033	1,080,330
2024012903342	S	EURUSD	01/31/2024	(1,000,000)	1.08067	1,080,670
2024012903350	S	EURUSD	01/31/2024	(1,000,000)	1.08103	1,081,030
2024013003036	B	EURUSD	02/01/2024	1,000,000	1.08557	(1,085,570)
2024013003037	B	EURUSD	02/01/2024	1,000,000	1.08557	(1,085,570)
2024013003034	S	EURUSD	02/01/2024	(1,000,000)	1.08477	1,084,770
2024013003052	S	EURUSD	02/01/2024	(1,000,000)	1.0852	1,085,200
2024020103257	B	EURUSD	02/05/2024	1,000,000	1.08626	(1,086,260)
2024020103309	B	EURUSD	02/05/2024	1,000,000	1.08711	(1,087,110)
2024020103237	S	EURUSD	02/05/2024	(1,000,000)	1.08478	1,084,780
2024020103239	S	EURUSD	02/05/2024	(1,000,000)	1.0849	1,084,900
2024020603215	B	EURUSD	02/08/2024	1,000,000	1.07442	(1,074,420)
2024020603252	S	EURUSD	02/08/2024	(1,000,000)	1.0743	1,074,300
2024020703112	B	EURUSD	02/09/2024	1,000,000	1.07685	(1,076,850)
2024020703230	S	EURUSD	02/09/2024	(1,000,000)	1.07635	1,076,350
2024020803109	B	EURUSD	02/12/2024	1,000,000	1.07639	(1,076,390)
2024020803117	B	EURUSD	02/12/2024	1,000,000	1.07552	(1,075,520)
2024020803038	S	EURUSD	02/12/2024	(1,000,000)	1.07574	1,075,740
2024020803145	S	EURUSD	02/12/2024	(1,000,000)	1.07631	1,076,310
2024020803250	S	EURMXN	02/12/2024	(125,000)	18.4257	2,303,213
2024020803253	S	EURMXN	02/12/2024	(125,000)	18.4248	2,303,100
2024020803255	S	EURMXN	02/12/2024	(125,000)	18.4272	2,303,400
2024020803257	S	EURMXN	02/12/2024	(125,000)	18.4273	2,303,413
2024020803261	S	EURMXN	02/12/2024	(125,000)	18.4273	2,303,413
2024020803264	S	EURMXN	02/12/2024	(125,000)	18.4265	2,303,313
2024020803266	S	EURMXN	02/12/2024	(125,000)	18.4276	2,303,450
2024020803268	S	EURMXN	02/12/2024	(125,000)	18.4281	2,303,513
2024020903424	BO	EURUSD	02/12/2024	2,500,000	1.07854	(2,696,345)
2024020903165	B	EURUSD	02/13/2024	1,000,000	1.0783	(1,078,300)
2024020903296	S	EURUSD	02/13/2024	(1,000,000)	1.07796	1,077,960
2024021203110	B	EURUSD	02/14/2024	1,000,000	1.07682	(1,076,820)
2024021203149	S	EURUSD	02/14/2024	(1,000,000)	1.0765	1,076,500
2024012603778	BO	EURMXN	02/15/2024	500,000	18.68341	(9,341,704)
2024021303117	B	EURUSD	02/15/2024	1,000,000	1.07103	(1,071,030)
2024021303118	B	EURUSD	02/15/2024	1,000,000	1.07103	(1,071,030)
2024021303379	B	EURUSD	02/15/2024	1,000,000	1.07137	(1,071,370)
2024021303067	S	EURUSD	02/15/2024	(1,000,000)	1.07152	1,071,520
2024021303071	S	EURUSD	02/15/2024	(1,000,000)	1.07156	1,071,560
2024021303154	S	EURUSD	02/15/2024	(1,000,000)	1.07254	1,072,540
2023111503572	BO	EURMXN	02/16/2024	230,000	19.15326	(4,405,249)
2024011603823	B	EURMXN	02/16/2024	50,000,000	18.83033	(941,516,450)
2024021403236	B	EURUSD	02/16/2024	1,000,000	1.07269	(1,072,690)
2024021403462	S	EURUSD	02/16/2024	(1,000,000)	1.0733	1,073,300
2024021503374	BO	EURMXN	02/16/2024	2,300,000	18.35422	(42,214,700)
2024021503576	BO	EURUSD	02/16/2024	500,000	1.0765	(538,249)
2024021503624	BO	EURUSD	02/16/2024	500,000	1.0765	(538,249)
2024021503816	BO	EURMXN	02/16/2024	2,300,000	18.35422	(42,214,700)
2024021503820	BO	EURMXN	02/16/2024	2,300,000	18.35422	(42,214,700)
2024021503586	S	EURMXN	02/16/2024	(25,000,000)	18.34554	458,638,455
2024021503896	S	EURMXN	02/16/2024	(25,000,000)	18.34554	458,638,455
2023110303475	B	EURMXN	02/20/2024	1,107,700	19.11607	(21,174,874)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024011203122	B	EURMXN	02/20/2024	50,000	18.65634	(932,817)
2024021503205	B	EURUSD	02/20/2024	2,000,000	1.07629	(2,152,580)
2024021503791	B	EURUSD	02/20/2024	2,000,000	1.07629	(2,152,580)
2024021503244	S	EURUSD	02/20/2024	(1,000,000)	1.07567	1,075,670
2024021503317	S	EURUSD	02/20/2024	(1,000,000)	1.07556	1,075,560
2024021503808	S	EURUSD	02/20/2024	(1,000,000)	1.07567	1,075,670
2024021503812	S	EURUSD	02/20/2024	(1,000,000)	1.07556	1,075,560
2024021603170	B	EURUSD	02/20/2024	1,000,000	1.07706	(1,077,060)
2024021603174	B	EURUSD	02/20/2024	1,000,000	1.07725	(1,077,250)
2024021603102	S	EURUSD	02/20/2024	(1,000,000)	1.07525	1,075,250
2024021603130	S	EURUSD	02/20/2024	(1,000,000)	1.07709	1,077,090
2024021603800	S	EURMXN	02/21/2024	(10,700,000)	18.3792	196,657,440
2024021603803	S	EURMXN	02/21/2024	(9,300,000)	18.3787	170,921,910
2024021503587	B	EURMXN	02/23/2024	25,000,000	18.372	(459,299,978)
2024021503897	B	EURMXN	02/23/2024	25,000,000	18.372	(459,299,978)
2024022103119	B	EURUSD	02/23/2024	1,000,000	1.0812	(1,081,200)
2024022103180	B	EURUSD	02/23/2024	1,000,000	1.08045	(1,080,450)
2024022103322	B	EURUSD	02/23/2024	1,000,000	1.08129	(1,081,290)
2024022103160	S	EURUSD	02/23/2024	(1,000,000)	1.08067	1,080,670
2024022103195	S	EURUSD	02/23/2024	(1,000,000)	1.08115	1,081,150
2024022103222	S	EURUSD	02/23/2024	(1,000,000)	1.08132	1,081,320
2024022203328	BO	EURUSD	02/23/2024	1,000,000	1.08117	(1,081,165)
2024022203116	S	EURMXN	02/26/2024	(5,000,000)	18.5327	92,663,500
2024022603140	B	EURUSD	02/28/2024	1,000,000	1.08436	(1,084,360)
2024022603168	S	EURUSD	02/28/2024	(1,000,000)	1.08458	1,084,580
2024022703039	B	EURUSD	02/29/2024	1,000,000	1.08445	(1,084,450)
2024022703064	B	EURUSD	02/29/2024	1,000,000	1.08371	(1,083,710)
2024022703422	B	EURUSD	02/29/2024	1,000,000	1.08516	(1,085,160)
2024022703050	S	EURUSD	02/29/2024	(1,000,000)	1.08377	1,083,770
2024022703067	S	EURUSD	02/29/2024	(1,000,000)	1.08364	1,083,640
2024022703239	S	EURUSD	02/29/2024	(1,000,000)	1.08494	1,084,940
2024022703499	S	EURMXN	02/29/2024	(6,200,000)	18.5239	114,848,180
2024022803145	B	EURUSD	03/01/2024	1,000,000	1.08362	(1,083,620)
2024022803158	B	EURUSD	03/01/2024	1,000,000	1.08328	(1,083,280)
2024022803130	S	EURUSD	03/01/2024	(1,000,000)	1.08278	1,082,780
2024022803131	S	EURUSD	03/01/2024	(1,000,000)	1.0827	1,082,700
2024022903946	BO	EURUSD	03/01/2024	5,000,000	1.08057	(5,402,835)
2024022903078	B	EURUSD	03/04/2024	1,000,000	1.08525	(1,085,250)
2024022903212	B	EURUSD	03/04/2024	2,000,000	1.08221	(2,164,420)
2024022903642	B	EURUSD	03/04/2024	1,000,000	1.08033	(1,080,330)
2024022903030	S	EURUSD	03/04/2024	(1,000,000)	1.08461	1,084,610
2024022903309	S	EURUSD	03/04/2024	(1,000,000)	1.08108	1,081,080
2024022903391	S	EURUSD	03/04/2024	(1,000,000)	1.0808	1,080,800
2024022903657	S	EURUSD	03/04/2024	(1,000,000)	1.08058	1,080,580
2023120503275	B	EURMXN	03/05/2024	25,000,000	19.20006	(480,001,620)
2023122203290	B	EURUSD	03/05/2024	65,000,000	1.10504	(71,827,425)
2024010203446	B	EURUSD	03/05/2024	35,000,000	1.09812	(38,434,130)
2024030103136	B	EURUSD	03/05/2024	1,000,000	1.08409	(1,084,090)
2024030103137	B	EURUSD	03/05/2024	1,000,000	1.08406	(1,084,060)
2024030103189	B	EURUSD	03/05/2024	1,000,000	1.0834	(1,083,400)
2024030103094	S	EURUSD	03/05/2024	(1,000,000)	1.08153	1,081,530
2024030103114	S	EURUSD	03/05/2024	(1,000,000)	1.08192	1,081,920
2024030103275	S	EURUSD	03/05/2024	(1,000,000)	1.0831	1,083,100
2024030103311	S	EURUSD	03/05/2024	(100,000,000)	1.08304	108,304,000
2024030503095	B	EURUSD	03/07/2024	1,000,000	1.08667	(1,086,670)
2024030503217	B	EURUSD	03/07/2024	1,000,000	1.08647	(1,086,470)
2024030503290	B	EURUSD	03/07/2024	1,000,000	1.08606	(1,086,060)
2024030503099	S	EURUSD	03/07/2024	(1,000,000)	1.08741	1,087,410
2024030503557	S	EURUSD	03/07/2024	(1,000,000)	1.08515	1,085,150
2024030503672	S	EURUSD	03/07/2024	(1,000,000)	1.08527	1,085,270
2024030603197	B	EURUSD	03/08/2024	1,000,000	1.09043	(1,090,430)
2024030603285	S	EURUSD	03/08/2024	(1,000,000)	1.09097	1,090,970
2024030703698	BO	EURUSD	03/08/2024	3,000,000	1.09467	(3,284,022)
2024030803281	B	EURUSD	03/12/2024	1,000,000	1.0951	(1,095,100)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024030803380	S	EURUSD	03/12/2024	(1,000,000)	1.09389	1,093,890
2024031103139	B	EURUSD	03/13/2024	1,000,000	1.0918	(1,091,800)
2024031103436	B	EURUSD	03/13/2024	2,000,000	1.09233	(2,184,660)
2024031103083	S	EURUSD	03/13/2024	(1,000,000)	1.09233	1,092,330
2024031103243	S	EURUSD	03/13/2024	(2,000,000)	1.09267	2,185,340
2024031203522	B	EURUSD	03/14/2024	2,000,000	1.09227	(2,184,540)
2024031203237	S	EURUSD	03/14/2024	(2,000,000)	1.09172	2,183,440
2024031303205	B	EURUSD	03/15/2024	2,000,000	1.09397	(2,187,940)
2024031303228	S	EURUSD	03/15/2024	(2,000,000)	1.0945	2,189,000
2024031403286	BO	EURMXN	03/15/2024	3,000,000	18.1545	(54,463,503)
2024031903160	B	EURUSD	03/21/2024	1,000,000	1.08538	(1,085,380)
2024031903161	B	EURUSD	03/21/2024	1,000,000	1.08537	(1,085,370)
2024031903730	B	EURUSD	03/21/2024	2,000,000	1.08647	(2,172,940)
2024031903280	S	EURUSD	03/21/2024	(1,000,000)	1.086	1,086,000
2024031903281	S	EURUSD	03/21/2024	(1,000,000)	1.08601	1,086,010
2024031903407	S	EURUSD	03/21/2024	(1,000,000)	1.08645	1,086,450
2023111503575	BO	EURMXN	03/22/2024	40,000	19.29536	(771,814)
2024031903974	S	EURMXN	03/22/2024	(2,000,000)	18.24898	36,497,960
2024032003030	B	EURUSD	03/22/2024	1,000,000	1.08514	(1,085,140)
2024032003250	S	EURMXN	03/22/2024	(1,000,000)	18.1874	18,187,400
2024032003282	S	EURMXN	03/22/2024	(60,000,000)	18.1774	1,090,644,000
2024031203651	BO	EURMXN	03/27/2024	134,229	18.39982	(2,469,790)
2024031903840	BO	EURMXN	03/27/2024	134,229	18.29704	(2,455,994)
2024011503099	BO	JPYMXN	01/16/2024	25,000,000	0.115864	(2,896,600)
2024020903124	BO	JPYMXN	02/13/2024	17,000,000	0.114409	(1,944,956)
2024022703193	BO	JPYMXN	02/28/2024	10,000,000	0.113467	(1,134,670)
2023011203000	BO	USDMXN	01/02/2024	3,000,000	20.17975	(60,539,235)
2023011203004	BO	USDMXN	01/02/2024	3,000,000	20.17528	(60,525,825)
2023011203009	BO	USDMXN	01/02/2024	700,000	20.18605	(14,130,232)
2023011203013	BO	USDMXN	01/02/2024	200,000	20.1971	(4,039,419)
2023021403135	BO	USDMXN	01/02/2024	5,000,000	19.73735	(98,686,740)
2023021403136	BO	USDMXN	01/02/2024	5,000,000	19.73567	(98,678,370)
2023021403137	BO	USDMXN	01/02/2024	5,000,000	19.73501	(98,675,065)
2023021403139	BO	USDMXN	01/02/2024	15,000,000	19.73059	(295,958,895)
2023021403589	BO	USDMXN	01/02/2024	382,824	19.70272	(7,542,667)
2023061903072	BO	USDMXN	01/02/2024	100,000	17.77232	(1,777,232)
2023062703684	BO	USDMXN	01/02/2024	2,254	17.69782	(39,894)
2023100503388	SO	USDMXN	01/02/2024	(100,000)	18.44867	1,844,867
2023110603630	BO	USDMXN	01/02/2024	1,000,000	17.6914	(17,691,396)
2023110603717	B	USDMXN	01/02/2024	1,000,000	17.69269	(17,692,690)
2023110603725	B	USDMXN	01/02/2024	2,100,000	17.6991	(37,168,113)
2023112703225	BO	USDMXN	01/02/2024	70,000	17.26158	(1,208,311)
2023120103360	BO	USDMXN	01/02/2024	500,000	17.39969	(8,699,843)
2023120103420	BO	USDMXN	01/02/2024	775,000	17.2678	(13,382,541)
2023120403390	S	USDMXN	01/02/2024	(500,000)	17.55247	8,776,234
2023120603346	B	USDMXN	01/02/2024	787,500	17.35587	(13,667,744)
2023120803496	B	USDMXN	01/02/2024	787,500	17.41813	(13,716,774)
2023121503625	SO	USDMXN	01/02/2024	(3,000)	17.26328	51,790
2023121803751	B	USDMXN	01/02/2024	2,000,000	17.20208	(34,404,150)
2023122203559	BO	USDMXN	01/02/2024	50,000	16.98594	(849,297)
2023122703056	B	USDMXN	01/02/2024	50,000,000	16.965	(848,250,000)
2023122703376	SON	USDMXN	01/02/2024	(70,880,095)	16.93	1,200,000,000
2023122803418	BON	USDMXN	01/02/2024	70,880,095	16.93	(1,200,000,000)
2023122803419	SO	USDMXN	01/02/2024	0	16.8645	4,642,646
2023122903178	BO	USDMXN	01/02/2024	5,000,000	16.90049	(84,502,438)
2023122903391	B	USDMXN	01/02/2024	1,700,000	16.939	(28,796,300)
2024010203562	B	USDMXN	01/02/2024	35,194,744	17.048	(600,000,000)
2024010203553	S	USDMXN	01/02/2024	(50,000,000)	17.03	851,500,000
2024010203557	S	USDMXN	01/02/2024	(35,194,744)	17.048	600,000,000
2023072003388	SO	USDMXN	01/03/2024	(161,017)	17.38322	2,798,989
2023072703365	SO	USDMXN	01/03/2024	(162,781)	17.219	2,802,930
2023081403016	SO	USDMXN	01/03/2024	(160,412)	17.5661	2,817,821
2023092603744	BO	USDMXN	01/03/2024	15,200	17.84452	(271,237)
2023100303170	SO	USDMXN	01/03/2024	(154,143)	18.15851	2,799,008

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023100903430	BO	USDMXN	01/03/2024	56,496	18.45927	(1,042,875)
2023101003385	S	USDMXN	01/03/2024	(153,357)	18.23775	2,796,887
2023101103171	BO	USDMXN	01/03/2024	125,000	18.05673	(2,257,092)
2023101703405	S	USDMXN	01/03/2024	(154,177)	18.15564	2,799,189
2023101903403	B	USDMXN	01/03/2024	92,800	18.44194	(1,711,412)
2023102403336	BO	USDMXN	01/03/2024	38,200	18.30608	(699,292)
2023102603633	BO	USDMXN	01/03/2024	34,400	18.38046	(632,288)
2023103103449	B	USDMXN	01/03/2024	35,000,000	18.1992	(636,972,000)
2023110303666	B	USDMXN	01/03/2024	300,000	17.59252	(5,277,755)
2023110303839	BO	USDMXN	01/03/2024	60,400	17.61379	(1,063,873)
2023111003509	BO	USDMXN	01/03/2024	235,200	17.78244	(4,182,431)
2023111403603	B	USDMXN	01/03/2024	125,600	17.51187	(2,199,491)
2023111503499	B	USDMXN	01/03/2024	58,800	17.46993	(1,027,232)
2023112103697	BO	USDMXN	01/03/2024	48,800	17.3331	(845,855)
2023112103755	BO	USDMXN	01/03/2024	48,800	17.33369	(845,884)
2023112203432	B	USDMXN	01/03/2024	45,200	17.30307	(782,099)
2023112703321	BO	USDMXN	01/03/2024	40,000	17.26737	(690,695)
2023112703481	BO	USDMXN	01/03/2024	800	17.24415	(13,795)
2023112703653	BO	USDMXN	01/03/2024	41,000	17.23764	(706,743)
2023112903100	SO	USDMXN	01/03/2024	(259,498)	17.26878	4,481,213
2023113003762	BO	USDMXN	01/03/2024	72,500	17.47412	(1,266,874)
2023120103414	BO	USDMXN	01/03/2024	304,800	17.27595	(5,265,712)
2023120403604	BO	USDMXN	01/03/2024	51,600	17.54185	(905,160)
2023120703728	B	USDMXN	01/03/2024	153,600	17.53754	(2,693,766)
2023121403175	SO	USDMXN	01/03/2024	(197,000)	17.34239	3,416,451
2023121503651	SO	USDMXN	01/03/2024	(818)	17.25865	14,118
2023121903578	SO	USDMXN	01/03/2024	(347,547)	17.11262	5,947,440
2024010203558	B	USDMXN	01/03/2024	35,189,687	17.05045	(600,000,000)
2024010203604	B	USDMXN	01/03/2024	50,000,000	17.04	(852,000,000)
2024010203563	S	USDMXN	01/03/2024	(35,189,687)	17.05045	600,000,000
2024013103821	B	USDMXN	01/03/2024	35,000,000	16.92	(592,200,000)
2023062003623	BO	USDMXN	01/04/2024	63,000	17.87305	(1,126,002)
2023101703445	BO	USDMXN	01/04/2024	60,000	18.16557	(1,089,934)
2023103003362	BO	USDMXN	01/04/2024	520,000	18.17062	(9,448,720)
2023110303495	B	USDMXN	01/04/2024	60,000	17.57846	(1,054,708)
2023110303609	BO	USDMXN	01/04/2024	20,000	17.61174	(352,235)
2023111603432	BO	USDMXN	01/04/2024	500,000	17.37385	(8,686,927)
2023112703226	BO	USDMXN	01/04/2024	70,000	17.26922	(1,208,845)
2023112703243	BO	USDMXN	01/04/2024	3,840	17.26261	(66,289)
2023112903099	SO	USDMXN	01/04/2024	(86,000)	17.2668	1,484,945
2023112903190	SO	USDMXN	01/04/2024	(575)	17.28362	9,944
2023113003030	SO	USDMXN	01/04/2024	(57,111)	17.48655	998,676
2023113003041	SO	USDMXN	01/04/2024	(518,000)	17.55075	9,091,287
2023113003242	SO	USDMXN	01/04/2024	(765)	17.46765	13,363
2023120403603	SO	USDMXN	01/04/2024	(133,839)	17.53352	2,346,668
2023120503376	BO	USDMXN	01/04/2024	15,093	17.45881	(263,506)
2023120703336	BO	USDMXN	01/04/2024	34,519	17.49595	(603,943)
2023120703338	BO	USDMXN	01/04/2024	31,930	17.49515	(558,620)
2023120803360	B	USDMXN	01/04/2024	250,000	17.42083	(4,355,209)
2023121403658	B	USDMXN	01/04/2024	500,000	17.19926	(8,599,630)
2023122203560	BO	USDMXN	01/04/2024	50,000	16.96993	(848,496)
2023122703034	BO	USDMXN	01/04/2024	500,000	16.97062	(8,485,312)
2024010203554	B	USDMXN	01/04/2024	50,000,000	17.034	(851,700,000)
2024010203605	S	USDMXN	01/04/2024	(50,000,000)	17.0427	852,135,000
2023010603067	BO	USDMXN	01/05/2024	3,015,000	20.45161	(61,661,593)
2023031003783	S	USDMXN	01/05/2024	(36,250)	19.54982	708,681
2023071803216	B	USDMXN	01/05/2024	1,052,737	17.28291	(18,194,355)
2023091103603	B	USDMXN	01/05/2024	100,000	17.65829	(1,765,829)
2023110303584	B	USDMXN	01/05/2024	500,000	17.62618	(8,813,092)
2023121403559	SO	USDMXN	01/05/2024	(330,000)	17.25274	5,693,404
2023121503598	S	USDMXN	01/05/2024	(429,000)	17.27173	7,409,571
2023121503629	SO	USDMXN	01/05/2024	(553)	17.27108	9,557
2023121903526	SO	USDMXN	01/05/2024	(305,000)	17.12158	5,222,080
2023121903527	SO	USDMXN	01/05/2024	(205,000)	17.12088	3,509,779

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121903559	SO	USDMXN	01/05/2024	(221,000)	17.12188	3,783,934
2023121903950	SO	USDMXN	01/05/2024	(1,094)	17.11071	18,726
2023122203561	BO	USDMXN	01/05/2024	50,000	16.97201	(848,601)
2024010303282	B	USDMXN	01/05/2024	2,771,524	17.0479	(47,248,667)
2024010303285	B	USDMXN	01/05/2024	7,933,128	17.0492	(135,253,492)
2024010303326	B	USDMXN	01/05/2024	1,000,000	17.05025	(17,050,250)
2024010303436	B	USDMXN	01/05/2024	163,705	17.0523	(2,791,552)
2024010303287	S	USDMXN	01/05/2024	(2,150,112)	17.0452	36,649,092
2024010303289	S	USDMXN	01/05/2024	(1,027,986)	17.046	17,523,057
2024010303291	S	USDMXN	01/05/2024	(290,259)	17.046	4,947,758
2024010303293	S	USDMXN	01/05/2024	(3,833,616)	17.0459	65,347,430
2024010303381	S	USDMXN	01/05/2024	(1,000,000)	17.0413	17,041,300
2024010303383	S	USDMXN	01/05/2024	(1,000,000)	17.042	17,042,000
2024010303433	S	USDMXN	01/05/2024	(3,000,000)	17.055	51,165,000
2024010303657	S	USDMXN	01/05/2024	(67,075)	17.03844	1,142,854
2023062703685	BO	USDMXN	01/08/2024	986	17.71774	(17,464)
2023070303411	BO	USDMXN	01/08/2024	1,270	17.65764	(22,426)
2023121103592	BO	USDMXN	01/08/2024	53,000	17.47498	(926,174)
2023121103143	SO	USDMXN	01/08/2024	(195,362)	17.53245	3,425,175
2023121503626	BO	USDMXN	01/08/2024	1,493	17.28595	(25,814)
2023121903563	BO	USDMXN	01/08/2024	100,000	17.14079	(1,714,079)
2023122003691	S	USDMXN	01/08/2024	(430,000)	17.17656	7,385,920
2023122003698	SO	USDMXN	01/08/2024	(189,834)	17.17542	3,260,478
2024010303656	BO	USDMXN	01/08/2024	2,000	17.05077	(34,105)
2024010403094	B	USDMXN	01/08/2024	1,000,000	17.04205	(17,042,050)
2024010403297	S	USDMXN	01/08/2024	(1,000,000)	17.03711	17,037,110
2024010403570	S	USDMXN	01/08/2024	(470)	17.01391	7,991
2024010803275	BO	USDMXN	01/08/2024	3,000,000	16.80175	(50,405,250)
2024010803279	BO	USDMXN	01/08/2024	3,000,000	16.79679	(50,390,370)
2024010803284	BO	USDMXN	01/08/2024	3,000,000	16.79509	(50,385,270)
2024010803321	BO	USDMXN	01/08/2024	3,000,000	16.80223	(50,406,675)
2022122303387	B	USDMXN	01/09/2024	1,491,731	20.7385	(30,936,263)
2023011303505	B	USDMXN	01/09/2024	745,866	20.01918	(14,931,628)
2023020103223	B	USDMXN	01/09/2024	2,800,000	19.92096	(55,778,688)
2023041803077	BO	USDMXN	01/09/2024	149,173	18.95782	(2,827,995)
2023050203557	BO	USDMXN	01/09/2024	298,346	18.80477	(5,610,327)
2023050303542	B	USDMXN	01/09/2024	149,173	18.77695	(2,801,013)
2023050503574	B	USDMXN	01/09/2024	149,173	18.6731	(2,785,522)
2023060703246	SO	USDMXN	01/09/2024	(204,941)	18.05371	3,699,939
2023061903071	BO	USDMXN	01/09/2024	100,000	17.79654	(1,779,654)
2023062103494	SO	USDMXN	01/09/2024	(207,638)	17.77634	3,691,037
2023092703288	SO	USDMXN	01/09/2024	(244,038)	18.04149	4,402,809
2023100503389	SO	USDMXN	01/09/2024	(100,000)	18.48065	1,848,065
2023101103191	SO	USDMXN	01/09/2024	(243,107)	18.12264	4,405,742
2023101803219	SO	USDMXN	01/09/2024	(237,581)	18.52271	4,400,643
2023102703511	BO	USDMXN	01/09/2024	3,000,000	18.31928	(54,957,846)
2023102703276	SO	USDMXN	01/09/2024	(240,937)	18.26499	4,400,712
2023111403362	S	USDMXN	01/09/2024	(250,534)	17.57716	4,403,677
2023113003245	BO	USDMXN	01/09/2024	310	17.49415	(5,423)
2023113003042	SO	USDMXN	01/09/2024	(220,000)	17.57027	3,865,460
2023113003207	SO	USDMXN	01/09/2024	(220,000)	17.46753	3,842,856
2023113003239	SO	USDMXN	01/09/2024	(40,912)	17.48993	715,548
2023113003240	SO	USDMXN	01/09/2024	(310)	17.48993	5,422
2023113003243	SO	USDMXN	01/09/2024	(310)	17.48893	5,422
2023120503142	BO	USDMXN	01/09/2024	100	17.51513	(1,752)
2023120703783	SO	USDMXN	01/09/2024	(500,000)	17.57578	8,787,890
2023122203616	SO	USDMXN	01/09/2024	(172,418)	17.00936	2,932,720
2024010303452	SO	USDMXN	01/09/2024	(130,000)	17.10858	2,224,116
2024010503005	B	USDMXN	01/09/2024	1,000,000	16.99761	(16,997,610)
2024010503006	B	USDMXN	01/09/2024	1,000,000	16.99866	(16,998,660)
2024010503008	S	USDMXN	01/09/2024	(1,000,000)	16.9799	16,979,900
2023062703150	BO	USDMXN	01/10/2024	300,000	17.70269	(5,310,807)
2023072403300	B	USDMXN	01/10/2024	500,000	17.35318	(8,676,590)
2023072703106	BO	USDMXN	01/10/2024	250,000	17.29559	(4,323,898)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023072703108	BO	USDMXN	01/10/2024	250,000	17.28615	(4,321,539)
2023073103210	B	USDMXN	01/10/2024	250,000	17.2419	(4,310,475)
2023081003232	B	USDMXN	01/10/2024	400,000	17.41862	(6,967,447)
2023082103227	B	USDMXN	01/10/2024	500,000	17.47174	(8,735,870)
2023090103178	SO	USDMXN	01/10/2024	(150,000)	17.50958	2,626,438
2023091903448	B	USDMXN	01/10/2024	50,000	17.41904	(870,952)
2023100903432	BO	USDMXN	01/10/2024	56,496	18.47442	(1,043,731)
2023101103172	BO	USDMXN	01/10/2024	125,000	18.07534	(2,259,418)
2023101903405	B	USDMXN	01/10/2024	92,800	18.46572	(1,713,619)
2023102403337	BO	USDMXN	01/10/2024	38,200	18.32583	(700,047)
2023110303644	B	USDMXN	01/10/2024	300,000	17.61057	(5,283,170)
2023110703525	B	USDMXN	01/10/2024	2,594,516	17.63768	(45,761,240)
2023111403605	B	USDMXN	01/10/2024	125,600	17.53181	(2,201,995)
2023111503503	B	USDMXN	01/10/2024	58,800	17.48962	(1,028,390)
2023112103156	BO	USDMXN	01/10/2024	120,000	17.321	(2,078,520)
2023112103698	BO	USDMXN	01/10/2024	48,800	17.3497	(846,665)
2023112903643	B	USDMXN	01/10/2024	150,000	17.31596	(2,597,394)
2023113003682	SO	USDMXN	01/10/2024	(380,339)	17.49792	6,655,141
2023120103415	BO	USDMXN	01/10/2024	28,000	17.29497	(484,259)
2023120503567	B	USDMXN	01/10/2024	142,831	17.51673	(2,501,932)
2023120703730	B	USDMXN	01/10/2024	46,800	17.55526	(821,586)
2023120803630	BO	USDMXN	01/10/2024	81,600	17.43712	(1,422,869)
2023121503631	BO	USDMXN	01/10/2024	1,750	17.29363	(30,271)
2023121803719	BO	USDMXN	01/10/2024	142,400	17.22818	(2,453,293)
2023121903564	BO	USDMXN	01/10/2024	100,000	17.15052	(1,715,052)
2024010303500	BO	USDMXN	01/10/2024	8,975	17.07251	(153,226)
2024010303283	S	USDMXN	01/10/2024	(2,771,524)	17.06119	47,285,511
2024010803021	B	USDMXN	01/10/2024	1,000,000	16.88371	(16,883,710)
2024010803091	B	USDMXN	01/10/2024	1,000,000	16.86273	(16,862,730)
2024010803193	B	USDMXN	01/10/2024	1,000,000	16.80813	(16,808,130)
2024010803200	B	USDMXN	01/10/2024	2,000,000	16.805	(33,610,000)
2024010803589	B	USDMXN	01/10/2024	2,000,000	16.8397	(33,679,400)
2024010803082	S	USDMXN	01/10/2024	(1,000,000)	16.87304	16,873,040
2024010803143	S	USDMXN	01/10/2024	(1,000,000)	16.84461	16,844,610
2024010803144	S	USDMXN	01/10/2024	(1,000,000)	16.8446	16,844,600
2024010803150	S	USDMXN	01/10/2024	(1,000,000)	16.84431	16,844,310
2024010803172	S	USDMXN	01/10/2024	(1,000,000)	16.82675	16,826,750
2024010803201	S	USDMXN	01/10/2024	(20,000,000)	16.8049	336,098,000
2024010803280	S	USDMXN	01/10/2024	(10,000,000)	16.802	168,020,000
2024010803297	S	USDMXN	01/10/2024	(234,595)	16.8062	3,942,650
2024010803307	S	USDMXN	01/10/2024	(113,879)	16.8037	1,913,589
2024010803352	S	USDMXN	01/10/2024	(20,000,000)	16.808	336,160,000
2024010803355	S	USDMXN	01/10/2024	(10,000,000)	16.808	168,080,000
2024010803662	S	USDMXN	01/10/2024	(300,000)	16.8087	5,042,610
2024010803664	S	USDMXN	01/10/2024	(300,000)	16.8082	5,042,460
2024010803700	S	USDMXN	01/10/2024	(103,000)	16.8221	1,732,676
2024010803702	S	USDMXN	01/10/2024	(79,000)	16.82083	1,328,846
2024010803704	S	USDMXN	01/10/2024	(1,182,239)	16.82043	19,885,768
2024010803705	S	USDMXN	01/10/2024	(35,761)	16.82084	601,530
2024010803829	S	USDMXN	01/10/2024	(2,340)	16.82117	39,362
2023062003624	BO	USDMXN	01/11/2024	63,000	17.89662	(1,127,487)
2023071203621	BO	USDMXN	01/11/2024	38,462	17.47096	(671,960)
2023101703446	BO	USDMXN	01/11/2024	60,000	18.18454	(1,091,072)
2023110303496	B	USDMXN	01/11/2024	60,000	17.59672	(1,055,803)
2023110303626	BO	USDMXN	01/11/2024	66,920	17.61954	(1,179,100)
2023110803427	BO	USDMXN	01/11/2024	14,650	17.70387	(259,362)
2023111603431	BO	USDMXN	01/11/2024	500,000	17.39222	(8,696,108)
2023112703244	BO	USDMXN	01/11/2024	3,840	17.28143	(66,361)
2023113003031	SO	USDMXN	01/11/2024	(1,180)	17.50917	20,662
2023120103057	SO	USDMXN	01/11/2024	(138,000)	17.32592	2,390,977
2023120403602	SO	USDMXN	01/11/2024	(126,607)	17.55528	2,222,622
2023120503141	SO	USDMXN	01/11/2024	(369)	17.51421	6,469
2023120803362	B	USDMXN	01/11/2024	250,000	17.44017	(4,360,043)
2023121403663	B	USDMXN	01/11/2024	500,000	17.22726	(8,613,632)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121503652	BO	USDMXN	01/11/2024	100	17.29	(1,729)
2023121503617	SO	USDMXN	01/11/2024	(58,687)	17.28856	1,014,606
2024010303503	BO	USDMXN	01/11/2024	18,372	17.0749	(313,700)
2024010303453	SO	USDMXN	01/11/2024	(40,000)	17.11396	684,559
2024010903101	B	USDMXN	01/11/2024	30,000,000	16.891	(506,730,000)
2024010903134	B	USDMXN	01/11/2024	10,000,000	16.89	(168,900,000)
2024010903184	B	USDMXN	01/11/2024	1,000,000	16.94975	(16,949,750)
2024010903363	B	USDMXN	01/11/2024	1,000,000	16.97921	(16,979,210)
2024010903365	B	USDMXN	01/11/2024	1,000,000	16.975	(16,975,000)
2024010903369	B	USDMXN	01/11/2024	1,000,000	16.97	(16,970,000)
2024010903376	B	USDMXN	01/11/2024	1,135,517	16.96727	(19,266,623)
2024010903726	B	USDMXN	01/11/2024	980	16.96623	(16,630)
2024010903168	S	USDMXN	01/11/2024	(1,000,000)	16.95149	16,951,490
2024010903389	S	USDMXN	01/11/2024	(265,504)	16.9618	4,503,429
2024010903393	S	USDMXN	01/11/2024	(1,901,700)	16.9622	32,257,011
2024010903395	S	USDMXN	01/11/2024	(1,968,313)	16.9624	33,387,312
2024010903725	S	USDMXN	01/11/2024	(5,510)	16.96397	93,479
2022101303472	BO	USDMXN	01/12/2024	750	21.68558	(16,264)
2022101303200	SO	USDMXN	01/12/2024	(158,000)	21.8246	3,448,286
2022101403371	SO	USDMXN	01/12/2024	(1,500)	21.75835	32,638
2023031003624	SO	USDMXN	01/12/2024	(175,000)	19.58403	3,427,205
2023031003780	S	USDMXN	01/12/2024	(36,250)	19.57743	709,682
2023031403134	SO	USDMXN	01/12/2024	(175,000)	20.23214	3,540,624
2023091103601	B	USDMXN	01/12/2024	100,000	17.68003	(1,768,003)
2023110603381	B	USDMXN	01/12/2024	350,000	17.71269	(6,199,440)
2023111603107	BO	USDMXN	01/12/2024	620,098	17.39825	(10,788,623)
2023121903566	BO	USDMXN	01/12/2024	100,000	17.15189	(1,715,189)
2023122203829	SO	USDMXN	01/12/2024	(320,000)	17.02455	5,447,856
2024010303504	BO	USDMXN	01/12/2024	33,382	17.07868	(570,119)
2024010303454	SO	USDMXN	01/12/2024	(128,000)	17.11665	2,190,932
2024010403496	BO	USDMXN	01/12/2024	50,000	17.04812	(852,406)
2024011003063	B	USDMXN	01/12/2024	1,000,000	17.00902	(17,009,020)
2024011003217	B	USDMXN	01/12/2024	1,000,000	16.98005	(16,980,050)
2024011003486	B	USDMXN	01/12/2024	1,000,000	17.0007	(17,000,700)
2024011003686	B	USDMXN	01/12/2024	1,350,000	16.985	(22,929,750)
2024011003687	B	USDMXN	01/12/2024	150,000	16.98778	(2,548,167)
2024011003054	S	USDMXN	01/12/2024	(1,000,000)	17.01694	17,016,940
2024011003095	S	USDMXN	01/12/2024	(5,000,000)	16.99	84,950,000
2024011003329	S	USDMXN	01/12/2024	(1,000,000)	16.998	16,998,000
2024011003491	S	USDMXN	01/12/2024	(1,000,000)	16.99735	16,997,350
2024011003682	S	USDMXN	01/12/2024	(16,490)	16.98463	280,077
2024011003685	S	USDMXN	01/12/2024	(1,500,000)	16.98436	25,476,540
2023042403074	BO	USDMXN	01/16/2024	375,103	18.97033	(7,115,828)
2023051603150	B	USDMXN	01/16/2024	375,103	18.3478	(6,882,315)
2023061903073	BO	USDMXN	01/16/2024	100,000	17.82076	(1,782,076)
2023070303413	BO	USDMXN	01/16/2024	2,256	17.68199	(39,883)
2023071203619	BO	USDMXN	01/16/2024	38,462	17.4864	(672,554)
2023071303105	BO	USDMXN	01/16/2024	375,000	17.53341	(6,575,030)
2023071303569	BO	USDMXN	01/16/2024	103	17.43719	(1,796)
2023080403555	B	USDMXN	01/16/2024	187,000	17.61769	(3,294,509)
2023083103415	SO	USDMXN	01/16/2024	(200,000)	17.38628	3,477,256
2023091203675	BO	USDMXN	01/16/2024	125,000	17.6275	(2,203,438)
2023091403295	BO	USDMXN	01/16/2024	375,000	17.45508	(6,545,655)
2023091403461	BO	USDMXN	01/16/2024	103	17.4515	(1,798)
2023100503390	SO	USDMXN	01/16/2024	(100,000)	18.50392	1,850,392
2023101003717	B	USDMXN	01/16/2024	3,440,574	18.22175	(62,693,270)
2023101103476	B	USDMXN	01/16/2024	200,000	18.13926	(3,627,853)
2023102603550	B	USDMXN	01/16/2024	2,960,000	18.42777	(54,546,185)
2023103103565	BO	USDMXN	01/16/2024	1,700,000	18.24995	(31,024,923)
2023110703527	B	USDMXN	01/16/2024	1,230,770	17.65566	(21,730,053)
2023111503787	BO	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	17.4772	(17,477,196)
2023111603627	S	USDMXN	01/16/2024	(424,994)	17.40664	7,397,716
2023112103600	B	USDMXN	01/16/2024	463,876	17.38351	(8,063,801)
2023120503569	B	USDMXN	01/16/2024	448,422	17.53286	(7,862,121)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121503372	S	USDMXN	01/16/2024	(136,484)	17.26971	2,357,039
2023121903846	B	USDMXN	01/16/2024	53,163	17.14437	(911,449)
2023122203604	BO	USDMXN	01/16/2024	50,000	17.02618	(851,310)
2023122703542	SO	USDMXN	01/16/2024	(72,000)	16.96982	1,221,827
2023122703558	SO	USDMXN	01/16/2024	(427,000)	16.96381	7,243,549
2023122803723	SO	USDMXN	01/16/2024	(283,000)	16.98553	4,806,905
2024010303286	S	USDMXN	01/16/2024	(7,933,128)	17.07889	135,489,042
2024010303616	SO	USDMXN	01/16/2024	(1,558)	17.05852	26,576
2024010503606	BO	USDMXN	01/16/2024	2,806,361	16.92049	(47,485,003)
2024011103003	B	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	17.01315	(17,013,150)
2024011103007	B	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	16.99511	(16,995,110)
2024011103008	B	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	16.99694	(16,996,940)
2024011103058	B	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	17.00035	(17,000,350)
2024011103163	B	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	17.01	(17,010,000)
2024011103217	B	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	16.99487	(16,994,870)
2024011103223	B	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	16.99376	(16,993,760)
2024011103686	B	USDMXN	01/16/2024	222,021	16.92283	(3,757,224)
2024011103692	B	USDMXN	01/16/2024	250,000	16.9877	(4,246,925)
2024011103715	B	USDMXN	01/16/2024	180,942	16.92123	(3,061,761)
2024011103013	S	USDMXN	01/16/2024	(1,000,000)	17.035	17,035,000
2024011103015	S	USDMXN	01/16/2024	(1,000,000)	17.03607	17,036,070
2024011103017	S	USDMXN	01/16/2024	(1,000,000)	17.03507	17,035,070
2024011103075	S	USDMXN	01/16/2024	(1,000,000)	16.99411	16,994,110
2024011103091	S	USDMXN	01/16/2024	(20,000,000)	17.001	340,020,000
2024011103143	S	USDMXN	01/16/2024	(1,000,000)	17.0369	17,036,900
2024011103449	S	USDMXN	01/16/2024	(1,000,000)	16.96681	16,966,810
2024011103480	S	USDMXN	01/16/2024	(1,000,000)	16.95894	16,958,940
2024011103578	S	USDMXN	01/16/2024	(1,000,000)	16.93469	16,934,690
2024011103589	S	USDMXN	01/16/2024	(1,000,000)	16.92604	16,926,040
2024011103615	S	USDMXN	01/16/2024	(250,000)	16.93096	4,232,740
2024011103714	S	USDMXN	01/16/2024	(250,000)	16.91782	4,229,455
2024011103717	S	USDMXN	01/16/2024	(235,441)	16.91806	3,983,205
2024011103720	S	USDMXN	01/16/2024	(167,522)	16.9177	2,834,087
2023072003389	SO	USDMXN	01/17/2024	(160,643)	17.43047	2,800,076
2023080303429	SO	USDMXN	01/17/2024	(157,180)	17.81778	2,800,595
2023081103551	SO	USDMXN	01/17/2024	(160,023)	17.49542	2,799,669
2023090603282	S	USDMXN	01/17/2024	(208,333)	17.99444	3,748,842
2023090803325	SO	USDMXN	01/17/2024	(125,000)	17.99159	2,248,949
2023092603745	BO	USDMXN	01/17/2024	15,200	17.88788	(271,899)
2023092603220	SO	USDMXN	01/17/2024	(166,667)	17.84263	2,973,772
2023100303169	SO	USDMXN	01/17/2024	(153,950)	18.20784	2,803,096
2023100303493	SO	USDMXN	01/17/2024	(166,667)	18.23145	3,038,575
2023100903434	BO	USDMXN	01/17/2024	56,496	18.49561	(1,044,928)
2023101003383	S	USDMXN	01/17/2024	(153,146)	18.28596	2,800,426
2023101103173	BO	USDMXN	01/17/2024	125,000	18.09448	(2,261,810)
2023101103230	B	USDMXN	01/17/2024	50,000	18.14554	(907,277)
2023101703662	SO	USDMXN	01/17/2024	(833,333)	18.29455	15,245,459
2023102403338	BO	USDMXN	01/17/2024	38,200	18.34558	(700,801)
2023110303259	BO	USDMXN	01/17/2024	300,000	17.59849	(5,279,547)
2023110803535	B	USDMXN	01/17/2024	500,000	17.71309	(8,856,547)
2023111503505	B	USDMXN	01/17/2024	58,800	17.50852	(1,029,501)
2023112103700	BO	USDMXN	01/17/2024	48,800	17.36831	(847,574)
2023112203235	SO	USDMXN	01/17/2024	(166,993)	17.35929	2,898,879
2023120803479	BO	USDMXN	01/17/2024	65,440	17.45932	(1,142,538)
2023120803628	BO	USDMXN	01/17/2024	105,200	17.45737	(1,836,516)
2023121503620	SO	USDMXN	01/17/2024	(25,600)	17.30665	443,050
2023121803805	BO	USDMXN	01/17/2024	118,100	17.25415	(2,037,715)
2023121903568	BO	USDMXN	01/17/2024	100,000	17.16297	(1,716,297)
2023122203825	BO	USDMXN	01/17/2024	105,200	17.05277	(1,793,951)
2024010303507	SO	USDMXN	01/17/2024	(33,333)	17.08704	569,554
2024010803317	BO	USDMXN	01/17/2024	1,000,000	16.82626	(16,826,262)
2024010903503	BO	USDMXN	01/17/2024	36,126	16.98751	(613,691)
2024011203080	B	USDMXN	01/17/2024	30,000,000	16.8724	(506,172,000)
2024011203163	B	USDMXN	01/17/2024	30,000,000	16.865	(505,950,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024011203169	B	USDMXN	01/17/2024	1,000,000	16.86404	(16,864,040)
2024011203170	B	USDMXN	01/17/2024	1,000,000	16.86386	(16,863,860)
2024011203194	B	USDMXN	01/17/2024	1,000,000	16.85148	(16,851,480)
2024011203376	B	USDMXN	01/17/2024	30,000,000	16.855	(505,650,000)
2024011203038	S	USDMXN	01/17/2024	(1,000,000)	16.879	16,879,000
2024011203042	S	USDMXN	01/17/2024	(1,000,000)	16.88193	16,881,930
2024011203165	S	USDMXN	01/17/2024	(30,000,000)	16.865	505,950,000
2024011203278	S	USDMXN	01/17/2024	(1,000,000)	16.85497	16,854,970
2024011203647	S	USDMXN	01/17/2024	(58,910)	16.8565	993,016
2024011203649	S	USDMXN	01/17/2024	(60,904)	16.8564	1,026,622
2024011203651	S	USDMXN	01/17/2024	(66,859)	16.8566	1,127,015
2024011203655	S	USDMXN	01/17/2024	(65,405)	16.8564	1,102,493
2024011203658	S	USDMXN	01/17/2024	(74,586)	16.8564	1,257,251
2024011203661	S	USDMXN	01/17/2024	(76,095)	16.8567	1,282,711
2024011203663	S	USDMXN	01/17/2024	(75,733)	16.8569	1,276,624
2024011203665	S	USDMXN	01/17/2024	(78,724)	16.8564	1,327,003
2024011203669	S	USDMXN	01/17/2024	(58,267)	16.8568	982,195
2024011203671	S	USDMXN	01/17/2024	(58,325)	16.8567	983,167
2024011203673	S	USDMXN	01/17/2024	(82,737)	16.8569	1,394,689
2024011203675	S	USDMXN	01/17/2024	(67,653)	16.8564	1,140,386
2024011203747	S	USDMXN	01/17/2024	(200,000)	16.86308	3,372,616
2024011203852	S	USDMXN	01/17/2024	(20,732)	16.86927	349,738
2024011503157	S	USDMXN	01/17/2024	(620,000)	16.88964	10,471,577
2024011503221	S	USDMXN	01/17/2024	(36,800)	16.9001	621,924
2024011503223	S	USDMXN	01/17/2024	(204,400)	16.89999	3,454,358
2024011603059	S	USDMXN	01/17/2024	(37,152,000)	17.075	634,370,400
2024011603061	S	USDMXN	01/17/2024	(87,847,000)	17.075	1,499,987,525
2024011703240	S	USDMXN	01/17/2024	(1,700,000)	17.27	29,359,000
2023062003625	BO	USDMXN	01/18/2024	55,000	17.92018	(985,610)
2023062003626	BO	USDMXN	01/18/2024	8,000	17.92798	(143,424)
2023110303492	B	USDMXN	01/18/2024	60,000	17.61743	(1,057,046)
2023110303625	BO	USDMXN	01/18/2024	44,613	17.6379	(786,880)
2023110803433	BO	USDMXN	01/18/2024	29,300	17.72706	(519,403)
2023111303480	B	USDMXN	01/18/2024	587,598	17.77603	(10,445,161)
2023111603433	BO	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.41058	(8,705,289)
2023112903181	BO	USDMXN	01/18/2024	2,660	17.32725	(46,090)
2023120803364	B	USDMXN	01/18/2024	250,000	17.46006	(4,365,014)
2023121403669	B	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.24337	(8,621,683)
2023121903439	B	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.17103	(8,585,514)
2023122003755	B	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.2032	(8,601,600)
2024010303509	SO	USDMXN	01/18/2024	(36,035)	17.09041	615,853
2024010403187	SO	USDMXN	01/18/2024	(205,000)	17.07911	3,501,217
2024010403231	SO	USDMXN	01/18/2024	(146,480)	17.08443	2,502,527
2024010403232	SO	USDMXN	01/18/2024	(908)	17.08443	15,513
2024010403236	SO	USDMXN	01/18/2024	(360)	17.08393	6,150
2024011603060	B	USDMXN	01/18/2024	37,152,000	17.07795	(634,479,998)
2024011603062	B	USDMXN	01/18/2024	87,847,000	17.07795	(1,500,246,674)
2024011603209	B	USDMXN	01/18/2024	200,000	17.1401	(3,428,020)
2024011603211	B	USDMXN	01/18/2024	200,000	17.1399	(3,427,980)
2024011603213	B	USDMXN	01/18/2024	200,000	17.1416	(3,428,320)
2024011603215	B	USDMXN	01/18/2024	200,000	17.1419	(3,428,380)
2024011603217	B	USDMXN	01/18/2024	200,000	17.1417	(3,428,340)
2024011603219	B	USDMXN	01/18/2024	200,000	17.1409	(3,428,180)
2024011603221	B	USDMXN	01/18/2024	200,000	17.1404	(3,428,080)
2024011603223	B	USDMXN	01/18/2024	200,000	17.14002	(3,428,004)
2024011603225	B	USDMXN	01/18/2024	200,000	17.1406	(3,428,120)
2024011603231	B	USDMXN	01/18/2024	400,000	17.13511	(6,854,044)
2024011603262	B	USDMXN	01/18/2024	1,000,000	17.18491	(17,184,910)
2024011603263	B	USDMXN	01/18/2024	1,000,000	17.18464	(17,184,640)
2024011603264	B	USDMXN	01/18/2024	1,000,000	17.18388	(17,183,880)
2024011603361	B	USDMXN	01/18/2024	1,000,000	17.15771	(17,157,710)
2024011603709	B	USDMXN	01/18/2024	49,207	17.2081	(846,759)
2024011603720	B	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.1887	(8,594,350)
2024011603837	B	USDMXN	01/18/2024	1,000,000	17.21655	(17,216,550)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024011603838	B	USDMXN	01/18/2024	500,000	17.2185	(8,609,250)
2024011603066	S	USDMXN	01/18/2024	(500,000)	17.13382	8,566,910
2024011603109	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.13987	17,139,870
2024011603114	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.14288	17,142,880
2024011603227	S	USDMXN	01/18/2024	(200,000)	17.1356	3,427,120
2024011603285	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.16826	17,168,260
2024011603292	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.1707	17,170,700
2024011603296	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.17535	17,175,350
2024011603379	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.1817	17,181,700
2024011603705	S	USDMXN	01/18/2024	(2,104,112)	17.2065	36,204,403
2024011603707	S	USDMXN	01/18/2024	(1,431,003)	17.206	24,621,838
2024011603712	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.19646	17,196,460
2024011603713	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.19202	17,192,020
2024011603716	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.18012	17,180,120
2024011603724	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.18052	17,180,520
2024011603731	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.18023	17,180,230
2024011603736	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.17724	17,177,240
2024011603738	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.18521	17,185,210
2024011603739	S	USDMXN	01/18/2024	(3,000,000)	17.19	51,570,000
2024011603763	S	USDMXN	01/18/2024	(1,000,000)	17.19491	17,194,910
2024011703235	B	USDMXN	01/18/2024	3,910,782	17.27	(67,539,200)
2024011703241	B	USDMXN	01/18/2024	1,700,000	17.2728	(29,363,760)
2024011703664	B	USDMXN	01/18/2024	1,000,000	17.22153	(17,221,530)
2024011703666	B	USDMXN	01/18/2024	1,000,000	17.22222	(17,222,220)
2024011703283	S	USDMXN	01/18/2024	(4,060,722)	17.25003	70,047,551
2024011803489	B	USDMXN	01/18/2024	50,000,000	17.183	(859,150,000)
2024011803487	S	USDMXN	01/18/2024	(50,000,000)	17.18	859,000,000
2022101903200	SO	USDMXN	01/19/2024	(158,000)	21.85468	3,453,039
2022101903202	SO	USDMXN	01/19/2024	(750)	21.84385	16,383
2023031003778	S	USDMXN	01/19/2024	(36,250)	19.60256	710,593
2023080303284	BO	USDMXN	01/19/2024	180,000	17.88173	(3,218,711)
2023091103599	B	USDMXN	01/19/2024	100,000	17.69941	(1,769,941)
2023111603111	BO	USDMXN	01/19/2024	2,501,821	17.41661	(43,573,249)
2023121803803	B	USDMXN	01/19/2024	90,955	17.25075	(1,569,042)
2023121903927	BO	USDMXN	01/19/2024	330,000	17.16018	(5,662,859)
2024010203394	BO	USDMXN	01/19/2024	585,000	17.06163	(9,981,056)
2024010303458	SO	USDMXN	01/19/2024	(59,000)	17.08603	1,008,076
2024010503508	BO	USDMXN	01/19/2024	50,000	16.94265	(847,133)
2024010503640	BO	USDMXN	01/19/2024	50,000	16.91355	(845,678)
2024010803449	BO	USDMXN	01/19/2024	50,000	16.8176	(840,880)
2024010903215	SO	USDMXN	01/19/2024	(410,000)	16.94923	6,949,183
2024011103419	BO	USDMXN	01/19/2024	63,017	16.98063	(1,070,069)
2024011203744	BO	USDMXN	01/19/2024	330,000	16.87155	(5,567,611)
2024011603933	B	USDMXN	01/19/2024	500,000	17.22484	(8,612,420)
2024011703011	B	USDMXN	01/19/2024	1,000,000	17.31848	(17,318,480)
2024011703063	B	USDMXN	01/19/2024	1,000,000	17.34911	(17,349,110)
2024011703125	B	USDMXN	01/19/2024	1,000,000	17.34344	(17,343,440)
2024011703126	B	USDMXN	01/19/2024	1,000,000	17.34671	(17,346,710)
2024011703141	B	USDMXN	01/19/2024	1,000,000	17.32619	(17,326,190)
2024011703147	B	USDMXN	01/19/2024	1,000,000	17.32177	(17,321,770)
2024011703246	B	USDMXN	01/19/2024	1,000,000	17.25747	(17,257,470)
2024011703247	B	USDMXN	01/19/2024	1,000,000	17.25935	(17,259,350)
2024011703284	B	USDMXN	01/19/2024	4,060,722	17.2531	(70,060,038)
2024011703917	B	USDMXN	01/19/2024	18,488	17.2065	(318,118)
2024011703013	S	USDMXN	01/19/2024	(1,000,000)	17.33202	17,332,020
2024011703073	S	USDMXN	01/19/2024	(1,000,000)	17.37	17,370,000
2024011703133	S	USDMXN	01/19/2024	(1,000,000)	17.34468	17,344,680
2024011703136	S	USDMXN	01/19/2024	(1,000,000)	17.33737	17,337,370
2024011703173	S	USDMXN	01/19/2024	(2,000,000)	17.35	34,700,000
2024011703236	S	USDMXN	01/19/2024	(3,910,114)	17.27295	67,539,200
2024011703370	S	USDMXN	01/19/2024	(2,000,000)	17.29	34,580,000
2024011703867	S	USDMXN	01/19/2024	(92,654)	17.21157	1,594,721
2024011703869	S	USDMXN	01/19/2024	(93,633)	17.21157	1,611,571
2024011703871	S	USDMXN	01/19/2024	(4,668)	17.21153	80,343

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024011903106	BO	USDMXN	01/19/2024	5,000,000	17.12806	(85,640,313)
2024011903133	BO	USDMXN	01/19/2024	5,000,000	17.12846	(85,642,313)
2023070303414	BO	USDMXN	01/22/2024	2,253	17.70105	(39,886)
2023071203620	BO	USDMXN	01/22/2024	38,462	17.50547	(673,287)
2023080303670	S	USDMXN	01/22/2024	(19,950,000)	17.82886	355,685,737
2023121903569	BO	USDMXN	01/22/2024	100,000	17.17655	(1,717,655)
2024010303441	SO	USDMXN	01/22/2024	(403,000)	17.09864	6,890,752
2024010803154	BO	USDMXN	01/22/2024	500,000	16.86602	(8,433,011)
2024010803450	BO	USDMXN	01/22/2024	40,000	16.82613	(673,045)
2024010903227	SO	USDMXN	01/22/2024	(75,000)	16.96247	1,272,185
2024010903594	SO	USDMXN	01/22/2024	(88,339)	17.00438	1,502,150
2024011803033	B	USDMXN	01/22/2024	1,000,000	17.20335	(17,203,350)
2024011803078	B	USDMXN	01/22/2024	1,000,000	17.21	(17,210,000)
2024011803152	B	USDMXN	01/22/2024	1,000,000	17.19088	(17,190,880)
2024011803488	B	USDMXN	01/22/2024	50,000,000	17.1904	(859,520,000)
2024011803702	B	USDMXN	01/22/2024	6,232	17.17052	(107,002)
2024011803037	S	USDMXN	01/22/2024	(1,000,000)	17.22	17,220,000
2024011803049	S	USDMXN	01/22/2024	(1,000,000)	17.22498	17,224,980
2024011803192	S	USDMXN	01/22/2024	(1,000,000)	17.21	17,210,000
2024011803370	S	USDMXN	01/22/2024	(30,000,000)	17.22	516,600,000
2024011803490	S	USDMXN	01/22/2024	(50,000,000)	17.1943	859,715,000
2024011803634	S	USDMXN	01/22/2024	(1,000,000)	17.187	17,187,000
2024012203281	B	USDMXN	01/22/2024	20,000,000	17.15054	(343,010,750)
2022122303394	B	USDMXN	01/23/2024	1,491,731	20.7815	(31,000,408)
2023011303503	B	USDMXN	01/23/2024	745,866	20.06412	(14,965,142)
2023041803078	BO	USDMXN	01/23/2024	149,713	19.00831	(2,845,792)
2023041903027	SO	USDMXN	01/23/2024	(540)	19.09782	10,313
2023050203558	BO	USDMXN	01/23/2024	298,346	18.8576	(5,626,088)
2023050303544	B	USDMXN	01/23/2024	149,173	18.82723	(2,808,515)
2023050503576	B	USDMXN	01/23/2024	149,173	18.7233	(2,793,011)
2023053103369	S	USDMXN	01/23/2024	(199,364)	18.53383	3,694,982
2023060703251	SO	USDMXN	01/23/2024	(204,454)	18.10342	3,701,313
2023061903074	BO	USDMXN	01/23/2024	100,000	17.8449	(1,784,490)
2023062103495	SO	USDMXN	01/23/2024	(207,120)	17.81947	3,690,777
2023100403162	SO	USDMXN	01/23/2024	(240,031)	18.32739	4,399,141
2023100503391	SO	USDMXN	01/23/2024	(100,000)	18.52572	1,852,572
2023101103192	SO	USDMXN	01/23/2024	(242,479)	18.1694	4,405,697
2023101803178	SO	USDMXN	01/23/2024	(237,120)	18.56325	4,401,717
2023102703314	SO	USDMXN	01/23/2024	(240,188)	18.31838	4,399,856
2023110703156	SO	USDMXN	01/23/2024	(247,762)	17.76401	4,401,248
2023111403360	S	USDMXN	01/23/2024	(249,861)	17.62445	4,403,664
2023112103406	S	USDMXN	01/23/2024	(253,019)	17.42733	4,409,444
2023112803582	B	USDMXN	01/23/2024	136,914	17.30113	(2,368,767)
2023120703638	S	USDMXN	01/23/2024	(115,578)	17.61898	2,036,366
2023122203603	BO	USDMXN	01/23/2024	50,000	17.04502	(852,251)
2024010403476	SO	USDMXN	01/23/2024	(131,000)	17.07167	2,236,389
2024010503599	BO	USDMXN	01/23/2024	213,400	16.94583	(3,616,240)
2024010903593	SO	USDMXN	01/23/2024	(204,450)	17.00771	3,477,226
2024011003204	SO	USDMXN	01/23/2024	(187,000)	17.00796	3,180,488
2024011003372	SO	USDMXN	01/23/2024	(91,125)	17.02059	1,551,001
2024011003373	SO	USDMXN	01/23/2024	(75,594)	17.02059	1,286,654
2024011003374	SO	USDMXN	01/23/2024	(420)	17.01989	7,148
2024011803503	SO	USDMXN	01/23/2024	(1,047,802)	17.18508	18,006,556
2024011803506	S	USDMXN	01/23/2024	(282,361)	17.18577	4,852,591
2024011903101	B	USDMXN	01/23/2024	1,000,000	17.14491	(17,144,910)
2024011903142	B	USDMXN	01/23/2024	1,000,000	17.13471	(17,134,710)
2024011903205	B	USDMXN	01/23/2024	1,000,000	17.11616	(17,116,160)
2024011903539	B	USDMXN	01/23/2024	663,312	17.09	(11,336,000)
2024011903544	B	USDMXN	01/23/2024	336,688	17.09	(5,754,000)
2024011903611	B	USDMXN	01/23/2024	25,000	17.1091	(427,728)
2024011903114	S	USDMXN	01/23/2024	(1,000,000)	17.16052	17,160,520
2024011903139	S	USDMXN	01/23/2024	(30,000,000)	17.14	514,200,000
2024011903156	S	USDMXN	01/23/2024	(1,000,000)	17.13588	17,135,880
2024011903532	S	USDMXN	01/23/2024	(1,000,000)	17.0923	17,092,300

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024011903843	S	USDMXN	01/23/2024	(14,309)	17.08609	244,479
2022111503667	B	USDMXN	01/24/2024	525,765	20.89585	(10,986,307)
2022111703251	BO	USDMXN	01/24/2024	1,364,777	20.97554	(28,626,929)
2022111703773	B	USDMXN	01/24/2024	2,219,596	20.97354	(46,552,788)
2022111803512	B	USDMXN	01/24/2024	452,523	21.01918	(9,511,660)
2022112903740	B	USDMXN	01/24/2024	135,707	20.76974	(2,818,599)
2023010403602	BO	USDMXN	01/24/2024	815,267	20.7593	(16,924,372)
2023011903689	BO	USDMXN	01/24/2024	68,458	20.3673	(1,394,304)
2023012603557	B	USDMXN	01/24/2024	574,921	20.10812	(11,560,572)
2023020103219	B	USDMXN	01/24/2024	2,800,000	19.9697	(55,915,160)
2023020103666	B	USDMXN	01/24/2024	80,076	19.86386	(1,590,619)
2023021003704	BO	USDMXN	01/24/2024	1,147,878	19.9697	(22,922,780)
2023022103724	BO	USDMXN	01/24/2024	193,178	19.68353	(3,802,425)
2023032903478	BO	USDMXN	01/24/2024	75,482	19.22236	(1,450,947)
2023041303267	B	USDMXN	01/24/2024	256,446	19.0556	(4,886,733)
2023042003537	B	USDMXN	01/24/2024	186,653	19.05269	(3,556,241)
2023051703570	B	USDMXN	01/24/2024	84,713	18.46396	(1,564,138)
2023060603499	B	USDMXN	01/24/2024	500,000	18.186	(9,092,999)
2023061603184	B	USDMXN	01/24/2024	400,000	17.81018	(7,124,072)
2023070303345	BO	USDMXN	01/24/2024	300,000	17.72684	(5,318,051)
2023071803046	BO	USDMXN	01/24/2024	250,000	17.33461	(4,333,652)
2023072103305	B	USDMXN	01/24/2024	800,000	17.54148	(14,033,184)
2023080903295	BO	USDMXN	01/24/2024	350,000	17.59567	(6,158,483)
2023100903433	BO	USDMXN	01/24/2024	56,496	18.51781	(1,046,182)
2023101103174	BO	USDMXN	01/24/2024	125,000	18.11683	(2,264,604)
2023101203180	B	USDMXN	01/24/2024	1,371,671	18.22204	(24,994,650)
2023102403340	BO	USDMXN	01/24/2024	38,200	18.36532	(701,555)
2023110303258	BO	USDMXN	01/24/2024	300,000	17.62055	(5,286,164)
2023110803537	BO	USDMXN	01/24/2024	500,000	17.73795	(8,868,973)
2023111503488	B	USDMXN	01/24/2024	500,000	17.53966	(8,769,832)
2023111503556	B	USDMXN	01/24/2024	250,000	17.52296	(4,380,741)
2023112903808	B	USDMXN	01/24/2024	46,800	17.41847	(815,184)
2023120103416	BO	USDMXN	01/24/2024	28,000	17.33536	(485,390)
2023120703732	B	USDMXN	01/24/2024	61,400	17.59421	(1,080,285)
2023120803480	BO	USDMXN	01/24/2024	36,800	17.47891	(643,224)
2023120803481	BO	USDMXN	01/24/2024	36,800	17.47871	(643,217)
2023121503360	B	USDMXN	01/24/2024	1,100,000	17.29085	(19,019,938)
2023121903570	BO	USDMXN	01/24/2024	100,000	17.18287	(1,718,287)
2023121903755	BO	USDMXN	01/24/2024	46,400	17.16758	(796,576)
2023122103626	BO	USDMXN	01/24/2024	37,800	17.13172	(647,579)
2023122203826	BO	USDMXN	01/24/2024	105,200	17.07145	(1,795,917)
2024010303510	SO	USDMXN	01/24/2024	(26,650)	17.10821	455,934
2024010403393	BO	USDMXN	01/24/2024	74,400	17.08409	(1,271,057)
2024010403396	BO	USDMXN	01/24/2024	35,504	17.08399	(606,550)
2024010403394	SO	USDMXN	01/24/2024	(37,200)	17.07983	635,370
2024010503507	BO	USDMXN	01/24/2024	35,744	16.95672	(606,101)
2024010503864	BO	USDMXN	01/24/2024	35,744	16.91927	(604,763)
2024010903504	BO	USDMXN	01/24/2024	34,868	17.0084	(593,049)
2024010903705	BO	USDMXN	01/24/2024	36,712	17.00646	(624,341)
2024011003471	SO	USDMXN	01/24/2024	(477,482)	17.03029	8,131,658
2024011203196	BO	USDMXN	01/24/2024	89,600	16.87046	(1,511,593)
2024011503156	SO	USDMXN	01/24/2024	(195,000)	16.90772	3,297,005
2024011603228	B	USDMXN	01/24/2024	200,000	17.15353	(3,430,706)
2024011603232	S	USDMXN	01/24/2024	(400,000)	17.15216	6,860,866
2024011703782	SO	USDMXN	01/24/2024	(163,597)	17.24591	2,821,379
2024011903844	SO	USDMXN	01/24/2024	(3,156)	17.08817	53,927
2024012203157	B	USDMXN	01/24/2024	1,000,000	17.14175	(17,141,750)
2024012203254	B	USDMXN	01/24/2024	1,000,000	17.16021	(17,160,210)
2024012203450	B	USDMXN	01/24/2024	1,000,000	17.184	(17,184,000)
2024012203702	B	USDMXN	01/24/2024	9,880	17.18891	(169,826)
2024012203132	S	USDMXN	01/24/2024	(1,000,000)	17.09477	17,094,770
2024012203243	S	USDMXN	01/24/2024	(1,000,000)	17.13665	17,136,650
2024012203282	S	USDMXN	01/24/2024	(20,000,000)	17.1559	343,118,000
2024012203322	S	USDMXN	01/24/2024	(10,000,000)	17.135	171,350,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024012203424	S	USDMXN	01/24/2024	(5,000,000)	17.14	85,700,000
2024012203443	S	USDMXN	01/24/2024	(1,000,000)	17.16487	17,164,870
2024012303033	B	USDMXN	01/24/2024	10,000,000	17.3	(173,000,000)
2024012403043	BO	USDMXN	01/24/2024	3,000,000	17.1691	(51,507,297)
2024012403046	B	USDMXN	01/24/2024	2,600,000	17.17291	(44,649,563)
2023030303600	BO	USDMXN	01/25/2024	100,000	19.13919	(1,913,919)
2023062003627	BO	USDMXN	01/25/2024	63,000	17.95121	(1,130,926)
2023110303500	B	USDMXN	01/25/2024	60,000	17.63874	(1,058,325)
2023110303623	BO	USDMXN	01/25/2024	52,024	17.66046	(918,768)
2023110803434	BO	USDMXN	01/25/2024	14,650	17.74896	(260,022)
2023111603434	BO	USDMXN	01/25/2024	500,000	17.42993	(8,714,965)
2023112703247	BO	USDMXN	01/25/2024	3,840	17.32085	(66,512)
2023112903183	SO	USDMXN	01/25/2024	(1,180)	17.34442	20,467
2023120803366	B	USDMXN	01/25/2024	250,000	17.47972	(4,369,931)
2023121403671	B	USDMXN	01/25/2024	500,000	17.26512	(8,632,560)
2023121903441	B	USDMXN	01/25/2024	500,000	17.19098	(8,595,490)
2023122003757	B	USDMXN	01/25/2024	500,000	17.22271	(8,611,355)
2024010303511	SO	USDMXN	01/25/2024	(29,784)	17.11024	509,611
2024011603549	SO	USDMXN	01/25/2024	(275,000)	17.20444	4,731,221
2024011603554	SO	USDMXN	01/25/2024	(147,000)	17.20404	2,528,994
2024011903845	BO	USDMXN	01/25/2024	16,163	17.09531	(276,319)
2024012303026	B	USDMXN	01/25/2024	1,000,000	17.29213	(17,292,130)
2024012303089	B	USDMXN	01/25/2024	1,000,000	17.28822	(17,288,220)
2024012303187	B	USDMXN	01/25/2024	1,000,000	17.33945	(17,339,450)
2024012303639	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.3146	(865,730)
2024012303641	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.3139	(865,695)
2024012303643	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.3139	(865,695)
2024012303645	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.3139	(865,695)
2024012303647	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.314	(865,700)
2024012303649	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.3148	(865,740)
2024012303651	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.3152	(865,760)
2024012303653	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.3161	(865,805)
2024012303656	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.3185	(865,925)
2024012303658	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.316	(865,800)
2024012303660	B	USDMXN	01/25/2024	50,000	17.3164	(865,820)
2024012303022	S	USDMXN	01/25/2024	(1,000,000)	17.29615	17,296,150
2024012303034	S	USDMXN	01/25/2024	(10,000,000)	17.30288	173,028,750
2024012303130	S	USDMXN	01/25/2024	(1,000,000)	17.31533	17,315,330
2024012303182	S	USDMXN	01/25/2024	(1,000,000)	17.35897	17,358,970
2024012303339	S	USDMXN	01/25/2024	(29,569)	17.3703	513,622
2024012303345	S	USDMXN	01/25/2024	(77,761)	17.3762	1,351,198
2024012303347	S	USDMXN	01/25/2024	(218,909)	17.3768	3,803,943
2024012303349	S	USDMXN	01/25/2024	(226,409)	17.3754	3,933,953
2024012303351	S	USDMXN	01/25/2024	(238,607)	17.3741	4,145,590
2024012303353	S	USDMXN	01/25/2024	(251,504)	17.3735	4,369,505
2024012303355	S	USDMXN	01/25/2024	(248,827)	17.3724	4,322,727
2024012303358	S	USDMXN	01/25/2024	(194,455)	17.3723	3,378,133
2024012303360	S	USDMXN	01/25/2024	(213,426)	17.3711	3,707,441
2024012303363	S	USDMXN	01/25/2024	(190,235)	17.3701	3,304,403
2024012303367	S	USDMXN	01/25/2024	(155,513)	17.3697	2,701,219
2024012303369	S	USDMXN	01/25/2024	(179,208)	17.3692	3,112,704
2024012303372	S	USDMXN	01/25/2024	(224,369)	17.3699	3,897,259
2024012303375	S	USDMXN	01/25/2024	(133,416)	17.3677	2,317,129
2024012303491	S	USDMXN	01/25/2024	(2,000,000)	17.34	34,680,000
2024012303496	S	USDMXN	01/25/2024	(2,000,000)	17.34	34,680,000
2024012303518	S	USDMXN	01/25/2024	(2,000,000)	17.34	34,680,000
2024012303519	S	USDMXN	01/25/2024	(1,000,000)	17.34	17,340,000
2024012303521	S	USDMXN	01/25/2024	(119,772)	17.34232	2,077,118
2024012303618	S	USDMXN	01/25/2024	(30,000,000)	17.345	520,350,000
2024012303635	S	USDMXN	01/25/2024	(614,413)	17.3112	10,636,219
2024012303637	S	USDMXN	01/25/2024	(265,816)	17.3116	4,601,697
2024012303664	S	USDMXN	01/25/2024	(2,657,297)	17.3177	46,018,272
2024012303674	S	USDMXN	01/25/2024	(175,200)	17.3139	3,033,395
2024012303676	S	USDMXN	01/25/2024	(126,649)	17.3143	2,192,839

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024012303678	S	USDMXN	01/25/2024	(126,649)	17.3145	2,192,864
2024012303680	S	USDMXN	01/25/2024	(126,649)	17.3141	2,192,813
2024012303682	S	USDMXN	01/25/2024	(126,649)	17.3161	2,193,067
2024012403047	S	USDMXN	01/25/2024	(2,600,000)	17.17556	44,656,450
2024012403065	S	USDMXN	01/25/2024	(5,402,097)	17.18	92,808,025
2023031003776	S	USDMXN	01/26/2024	(36,250)	19.62815	711,520
2023051603553	B	USDMXN	01/26/2024	110,000	18.3688	(2,020,568)
2023091103597	B	USDMXN	01/26/2024	100,000	17.72165	(1,772,165)
2024010803703	B	USDMXN	01/26/2024	79,000	16.86668	(1,332,468)
2024010903489	SO	USDMXN	01/26/2024	(298,000)	16.96404	5,055,283
2024010903727	SO	USDMXN	01/26/2024	(24,000)	17.0023	408,055
2024011103418	BO	USDMXN	01/26/2024	63,017	17.00047	(1,071,318)
2024011203197	BO	USDMXN	01/26/2024	100,000	16.87611	(1,687,611)
2024011603567	SO	USDMXN	01/26/2024	(552,000)	17.21607	9,503,269
2024011903846	BO	USDMXN	01/26/2024	48,324	17.09851	(826,274)
2024011903576	SO	USDMXN	01/26/2024	(171,000)	17.09702	2,923,591
2024012403056	B	USDMXN	01/26/2024	1,000,000	17.18497	(17,184,970)
2024012403057	B	USDMXN	01/26/2024	1,000,000	17.18563	(17,185,630)
2024012403058	B	USDMXN	01/26/2024	1,000,000	17.18755	(17,187,550)
2024012403066	B	USDMXN	01/26/2024	5,401,201	17.18285	(92,808,025)
2024012403626	B	USDMXN	01/26/2024	1,000,000	17.21876	(17,218,760)
2024012403149	S	USDMXN	01/26/2024	(1,000,000)	17.16933	17,169,330
2024012403155	S	USDMXN	01/26/2024	(1,000,000)	17.16076	17,160,760
2024012403156	S	USDMXN	01/26/2024	(1,000,000)	17.15706	17,157,060
2024012403211	S	USDMXN	01/26/2024	(30,000,000)	17.186	515,580,000
2024012403224	S	USDMXN	01/26/2024	(1,000,000)	17.15	17,150,000
2024012403225	S	USDMXN	01/26/2024	(1,000,000)	17.155	17,155,000
2024012403226	S	USDMXN	01/26/2024	(1,000,000)	17.155	17,155,000
2024012403232	S	USDMXN	01/26/2024	(1,000,000)	17.155	17,155,000
2024012403234	S	USDMXN	01/26/2024	(2,000,000)	17.16	34,320,000
2023070303415	BO	USDMXN	01/29/2024	2,251	17.72313	(39,888)
2023071203622	BO	USDMXN	01/29/2024	38,462	17.52772	(674,143)
2023112703315	S	USDMXN	01/29/2024	(10,000,000)	17.34268	173,426,838
2023122203487	B	USDMXN	01/29/2024	50,000,000	17.06165	(853,082,625)
2023122203608	BO	USDMXN	01/29/2024	50,000	17.06106	(853,053)
2024011003376	SO	USDMXN	01/29/2024	(410,000)	17.04019	6,986,478
2024011603083	SO	USDMXN	01/29/2024	(131,000)	17.11367	2,241,891
2024011603566	SO	USDMXN	01/29/2024	(375,000)	17.22425	6,459,094
2024011903617	SO	USDMXN	01/29/2024	(98,897)	17.12134	1,693,250
2024011903619	SO	USDMXN	01/29/2024	(32,408)	17.12094	554,856
2024012203337	BON	USDMXN	01/29/2024	200,000,000	17.17	(3,434,000,000)
2024012203379	SON	USDMXN	01/29/2024	(100,000,000)	17.175	1,717,500,000
2024012203380	SON	USDMXN	01/29/2024	(100,000,000)	17.175	1,717,500,000
2024012203615	SON	USDMXN	01/29/2024	(100,000,000)	17.175	1,717,500,000
2024012503212	BON	USDMXN	01/29/2024	100,000,000	17.175	(1,717,500,000)
2024012503214	BO	USDMXN	01/29/2024	0	17.2475	(7,250,000)
2024012503213	BON	USDMXN	01/29/2024	100,000,000	17.175	(1,717,500,000)
2024012503215	BO	USDMXN	01/29/2024	0	17.2475	(7,250,000)
2024012503210	SON	USDMXN	01/29/2024	(200,000,000)	17.17	3,434,000,000
2024012503211	SO	USDMXN	01/29/2024	0	17.2475	15,500,000
2023031003626	SO	USDMXN	01/30/2024	(125,000)	19.64898	2,456,123
2023031403133	SO	USDMXN	01/30/2024	(125,000)	20.3021	2,537,763
2023061903075	BO	USDMXN	01/30/2024	100,000	17.8685	(1,786,850)
2023082303247	BO	USDMXN	01/30/2024	200,000	17.29473	(3,458,946)
2023082903261	SO	USDMXN	01/30/2024	(200,000)	17.29615	3,459,229
2023083103700	S	USDMXN	01/30/2024	(100,000)	17.45342	1,745,342
2023102403547	B	USDMXN	01/30/2024	2,307,929	18.55714	(42,828,574)
2023103103663	BO	USDMXN	01/30/2024	1,000,000	18.26025	(18,260,250)
2023103103666	BO	USDMXN	01/30/2024	3,122,216	18.25995	(57,011,510)
2023110603383	B	USDMXN	01/30/2024	250,000	17.7665	(4,441,626)
2023110703529	B	USDMXN	01/30/2024	830,509	17.69884	(14,699,041)
2023111403560	B	USDMXN	01/30/2024	200,000	17.58502	(3,517,005)
2023113003798	S	USDMXN	01/30/2024	(271,021)	17.53289	4,751,782
2023120503571	B	USDMXN	01/30/2024	308,866	17.5711	(5,427,115)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023120703653	S	USDMXN	01/30/2024	(1,423,779)	17.64488	25,122,402
2023121503362	B	USDMXN	01/30/2024	207,800	17.30786	(3,596,573)
2024010503600	BO	USDMXN	01/30/2024	242,126	16.9588	(4,106,166)
2024011103721	B	USDMXN	01/30/2024	167,522	16.95789	(2,840,820)
2024011603710	S	USDMXN	01/30/2024	(49,207)	17.24225	848,439
2024012303668	SO	USDMXN	01/30/2024	(200,000)	17.3318	3,466,360
2024012603176	B	USDMXN	01/30/2024	1,000,000	17.16811	(17,168,110)
2024012603401	B	USDMXN	01/30/2024	30,000,000	17.183	(515,490,000)
2024012603405	B	USDMXN	01/30/2024	10,000,000	17.1465	(171,465,000)
2024012603530	B	USDMXN	01/30/2024	1,000,000	17.14132	(17,141,320)
2024012603801	B	USDMXN	01/30/2024	296,376	17.14751	(5,082,110)
2024012603354	S	USDMXN	01/30/2024	(1,000,000)	17.14397	17,143,970
2024012603782	S	USDMXN	01/30/2024	(100,000)	17.1442	1,714,420
2024012603797	S	USDMXN	01/30/2024	(1,000,000)	17.14396	17,143,960
2024013003221	BO	USDMXN	01/30/2024	5,000,000	17.19307	(85,965,363)
2024013003225	BO	USDMXN	01/30/2024	10,000,000	17.18825	(171,882,540)
2022110103586	B	USDMXN	01/31/2024	4,230,000	21.40851	(90,557,993)
2023051503289	B	USDMXN	01/31/2024	1,000,000	18.48713	(18,487,132)
2023070303481	B	USDMXN	01/31/2024	192,800	17.7319	(3,418,710)
2023080303431	SO	USDMXN	01/31/2024	(156,784)	17.86353	2,800,710
2023081103548	SO	USDMXN	01/31/2024	(159,635)	17.54154	2,800,244
2023090803656	S	USDMXN	01/31/2024	(50,000)	18.04012	902,006
2023091303524	B	USDMXN	01/31/2024	48,000	17.55945	(842,854)
2023100903435	BO	USDMXN	01/31/2024	56,496	18.54	(1,047,436)
2023101003381	S	USDMXN	01/31/2024	(152,764)	18.33072	2,800,265
2023101703403	S	USDMXN	01/31/2024	(153,526)	18.23984	2,800,282
2023102403339	BO	USDMXN	01/31/2024	38,200	18.38666	(702,370)
2023110103517	BO	USDMXN	01/31/2024	40,000	18.14555	(725,822)
2023111503483	S	USDMXN	01/31/2024	(165,082)	17.55438	2,897,912
2023120703734	B	USDMXN	01/31/2024	61,600	17.6143	(1,085,041)
2023120803475	BO	USDMXN	01/31/2024	32,720	17.50001	(572,600)
2023120803483	BO	USDMXN	01/31/2024	36,800	17.49951	(643,982)
2023121303977	BO	USDMXN	01/31/2024	140,000	17.41157	(2,437,619)
2023121503509	B	USDMXN	01/31/2024	787,500	17.31244	(13,633,546)
2023121803718	B	USDMXN	01/31/2024	1,575,000	17.28394	(27,222,201)
2023121903756	BO	USDMXN	01/31/2024	46,400	17.18721	(797,487)
2023121903930	B	USDMXN	01/31/2024	1,575,000	17.18989	(27,074,081)
2023121903933	B	USDMXN	01/31/2024	300,000	17.18916	(5,156,747)
2023122003695	B	USDMXN	01/31/2024	787,500	17.24064	(13,577,002)
2023122203827	BO	USDMXN	01/31/2024	122,200	17.09019	(2,088,421)
2024010303602	BO	USDMXN	01/31/2024	107,600	17.10472	(1,840,468)
2024010303692	BO	USDMXN	01/31/2024	120,000	17.11304	(2,053,565)
2024010303726	BO	USDMXN	01/31/2024	19,400	17.1068	(331,872)
2024010303512	SO	USDMXN	01/31/2024	(9,285)	17.12776	159,025
2024010903519	BO	USDMXN	01/31/2024	268,702	17.01295	(4,571,412)
2024010903706	BO	USDMXN	01/31/2024	172,600	17.02542	(2,938,588)
2024011503222	B	USDMXN	01/31/2024	36,800	16.94039	(623,406)
2024011603226	S	USDMXN	01/31/2024	(200,000)	17.17751	3,435,502
2024012903232	B	USDMXN	01/31/2024	20,000,000	17.2	(344,000,000)
2024012903243	B	USDMXN	01/31/2024	2,000,000	17.22	(34,440,000)
2024012903244	B	USDMXN	01/31/2024	10,000,000	17.196	(171,960,000)
2024012903340	B	USDMXN	01/31/2024	1,000,000	17.26798	(17,267,980)
2024012903341	B	USDMXN	01/31/2024	1,000,000	17.26806	(17,268,060)
2024012903364	B	USDMXN	01/31/2024	1,000,000	17.24918	(17,249,180)
2024012903422	B	USDMXN	01/31/2024	30,000,000	17.249	(517,470,000)
2024012903578	B	USDMXN	01/31/2024	620,000	17.23274	(10,684,299)
2024012903587	B	USDMXN	01/31/2024	1,010,472	17.2298	(17,410,230)
2024012903174	S	USDMXN	01/31/2024	(1,000,000)	17.21402	17,214,020
2024012903187	S	USDMXN	01/31/2024	(1,000,000)	17.24087	17,240,870
2024012903297	S	USDMXN	01/31/2024	(787,500)	17.24178	13,577,902
2024012903484	S	USDMXN	01/31/2024	(1,000,000)	17.26	17,260,000
2024012903488	S	USDMXN	01/31/2024	(1,000,000)	17.26	17,260,000
2024012903628	S	USDMXN	01/31/2024	(620,000)	17.2383	10,687,746
2024012903705	S	USDMXN	01/31/2024	(2,329,445)	17.2153	40,102,095

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024013003001	BO	USDMXN	01/31/2024	1,000,000	17.21078	(17,210,776)
2024013003136	B	USDMXN	01/31/2024	20,000,000	17.23	(344,600,000)
2024013103030	B	USDMXN	01/31/2024	4,000,000	17.10447	(68,417,870)
2024013103331	BO	USDMXN	01/31/2024	5,000,000	17.17695	(85,884,750)
2023110303621	BO	USDMXN	02/01/2024	44,613	17.68261	(788,874)
2023110803435	BO	USDMXN	02/01/2024	14,650	17.76995	(260,330)
2023111603435	BO	USDMXN	02/01/2024	500,000	17.4506	(8,725,299)
2023120103361	BO	USDMXN	02/01/2024	500,000	17.50375	(8,751,877)
2024010203625	BO	USDMXN	02/01/2024	620,000	17.10894	(10,607,544)
2024010203677	BO	USDMXN	02/01/2024	620,000	17.13102	(10,621,230)
2024010303382	B	USDMXN	02/01/2024	1,000,000	17.11775	(17,117,753)
2024010303409	BO	USDMXN	02/01/2024	620,000	17.12375	(10,616,727)
2024010303513	BO	USDMXN	02/01/2024	13,205	17.13196	(226,227)
2024011503158	B	USDMXN	02/01/2024	620,000	16.9327	(10,498,275)
2024011503629	BO	USDMXN	02/01/2024	620,000	16.93508	(10,499,747)
2024011703665	S	USDMXN	02/01/2024	(1,000,000)	17.26164	17,261,641
2024011903575	SO	USDMXN	02/01/2024	(203,000)	17.11461	3,474,266
2024012203700	BO	USDMXN	02/01/2024	39,336	17.2135	(677,112)
2024012203077	SO	USDMXN	02/01/2024	(210,000)	17.1051	3,592,072
2024012203316	SO	USDMXN	02/01/2024	(8,700)	17.17135	149,391
2024012603479	BO	USDMXN	02/01/2024	20,000	17.18297	(343,659)
2024012903831	S	USDMXN	02/01/2024	(500,000)	17.21793	8,608,965
2024012903837	S	USDMXN	02/01/2024	(500,000)	17.2179	8,608,950
2024013003033	B	USDMXN	02/01/2024	1,000,000	17.21612	(17,216,120)
2024013003099	B	USDMXN	02/01/2024	1,000,000	17.22975	(17,229,750)
2024013003241	B	USDMXN	02/01/2024	1,000,000	17.18606	(17,186,060)
2024013003290	B	USDMXN	02/01/2024	1,000,000	17.1896	(17,189,600)
2024013003357	B	USDMXN	02/01/2024	1,000,000	17.18409	(17,184,090)
2024013003463	B	USDMXN	02/01/2024	1,000,000	17.16555	(17,165,550)
2024013003560	B	USDMXN	02/01/2024	900,000	17.17	(15,453,000)
2024013003137	S	USDMXN	02/01/2024	(20,000,000)	17.23283	344,656,500
2024013003145	S	USDMXN	02/01/2024	(1,000,000)	17.22376	17,223,760
2024013003168	S	USDMXN	02/01/2024	(1,000,000)	17.20999	17,209,990
2024013003530	S	USDMXN	02/01/2024	(2,000,000)	17.18	34,360,000
2024013003534	S	USDMXN	02/01/2024	(1,000,000)	17.17955	17,179,550
2024013003542	S	USDMXN	02/01/2024	(1,000,000)	17.18	17,180,000
2024013003757	S	USDMXN	02/01/2024	(30,000,000)	17.16	514,800,000
2024013003807	S	USDMXN	02/01/2024	(10,000,000)	17.162	171,620,000
2024013103097	B	USDMXN	02/01/2024	20,000,000	17.14	(342,800,000)
2024013103031	S	USDMXN	02/01/2024	(4,000,000)	17.10721	68,428,850
2024020103007	B	USDMXN	02/01/2024	2,000,000	17.17231	(34,344,627)
2023031003773	S	USDMXN	02/02/2024	(39,000)	19.65348	766,486
2023071803219	B	USDMXN	02/02/2024	619,363	17.36965	(10,758,115)
2023071803222	SO	USDMXN	02/02/2024	(619,363)	17.36585	10,755,766
2023090703380	SO	USDMXN	02/02/2024	(39,000)	17.9845	701,396
2023111603108	BO	USDMXN	02/02/2024	1,047,905	17.45703	(18,293,315)
2024010803706	B	USDMXN	02/02/2024	35,761	16.88601	(603,861)
2024010803725	BO	USDMXN	02/02/2024	100,000	16.89361	(1,689,361)
2024010803812	BO	USDMXN	02/02/2024	500,000	16.89706	(8,448,532)
2024011103423	BO	USDMXN	02/02/2024	63,017	17.02018	(1,072,561)
2024011503092	SO	USDMXN	02/02/2024	(274,000)	16.94688	4,643,446
2024012203315	SO	USDMXN	02/02/2024	(318,149)	17.17556	5,464,386
2024012303137	SO	USDMXN	02/02/2024	(232,000)	17.36785	4,029,341
2024012303515	SO	USDMXN	02/02/2024	(274,000)	17.38527	4,763,563
2024012603481	BO	USDMXN	02/02/2024	80,000	17.18594	(1,374,875)
2024013103066	B	USDMXN	02/02/2024	1,000,000	17.18024	(17,180,240)
2024013103077	B	USDMXN	02/02/2024	1,000,000	17.16267	(17,162,670)
2024013103091	B	USDMXN	02/02/2024	20,000,000	17.12	(342,400,000)
2024013103402	B	USDMXN	02/02/2024	1,000,000	17.16705	(17,167,050)
2024013103914	B	USDMXN	02/02/2024	1,000,000	17.1806	(17,180,600)
2024013103033	S	USDMXN	02/02/2024	(1,000,000)	17.1218	17,121,800
2024013103045	S	USDMXN	02/02/2024	(1,000,000)	17.11182	17,111,820
2024013103098	S	USDMXN	02/02/2024	(20,000,000)	17.14285	342,857,000
2024013103491	S	USDMXN	02/02/2024	(30,000,000)	17.16	514,800,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024013103621	S	USDMXN	02/02/2024	(200,000)	17.1881	3,437,620
2024013103885	S	USDMXN	02/02/2024	(1,000,000)	17.19827	17,198,270
2024020103052	B	USDMXN	02/02/2024	90,000,000	17.15	(1,543,500,000)
2024020103676	BO	USDMXN	02/02/2024	3,000,000	17.07976	(51,239,269)
2024020103698	BO	USDMXN	02/02/2024	3,000,000	17.07836	(51,235,067)
2024020103008	S	USDMXN	02/02/2024	(2,000,000)	17.17501	34,350,027
2024020203166	B	USDMXN	02/02/2024	2,500,000	17.14016	(42,850,406)
2023010403349	B	USDMXN	02/06/2024	738,719	20.77422	(15,346,308)
2023011303501	B	USDMXN	02/06/2024	369,361	20.10844	(7,427,275)
2023041803079	BO	USDMXN	02/06/2024	73,872	19.05829	(1,407,874)
2023050203560	BO	USDMXN	02/06/2024	103,308	18.90337	(1,952,870)
2023050203569	B	USDMXN	02/06/2024	44,436	19.00286	(844,411)
2023050303546	B	USDMXN	02/06/2024	73,872	18.87812	(1,394,564)
2023050503579	B	USDMXN	02/06/2024	73,872	18.77251	(1,386,763)
2023070303416	BO	USDMXN	02/06/2024	2,248	17.74876	(39,891)
2023071203632	BO	USDMXN	02/06/2024	38,462	17.5569	(675,265)
2023101803179	SO	USDMXN	02/06/2024	(236,521)	18.60696	4,400,936
2023111403329	BO	USDMXN	02/06/2024	6,000,000	17.65876	(105,952,563)
2023111403358	S	USDMXN	02/06/2024	(249,391)	17.66709	4,406,014
2023112103402	S	USDMXN	02/06/2024	(252,656)	17.4525	4,409,479
2023112803297	S	USDMXN	02/06/2024	(253,954)	17.33135	4,401,367
2023120503348	SO	USDMXN	02/06/2024	(249,895)	17.56292	4,388,886
2023122203609	BO	USDMXN	02/06/2024	50,000	17.08435	(854,218)
2024010303514	BO	USDMXN	02/06/2024	26,763	17.14405	(458,828)
2024010803701	B	USDMXN	02/06/2024	103,000	16.90684	(1,741,404)
2024010803731	BO	USDMXN	02/06/2024	100,000	16.90449	(1,690,449)
2024011603568	SO	USDMXN	02/06/2024	(900,000)	17.24627	15,521,645
2024012303513	SO	USDMXN	02/06/2024	(237,000)	17.38687	4,120,687
2024020103138	B	USDMXN	02/06/2024	1,000,000	17.1417	(17,141,700)
2024020103139	B	USDMXN	02/06/2024	1,000,000	17.14151	(17,141,510)
2024020103255	B	USDMXN	02/06/2024	10,000,000	17.13	(171,300,000)
2024020103269	B	USDMXN	02/06/2024	30,000,000	17.137	(514,110,000)
2024020103277	B	USDMXN	02/06/2024	20,000,000	17.135	(342,700,000)
2024020103053	S	USDMXN	02/06/2024	(90,000,000)	17.1612	1,544,508,000
2024020103191	S	USDMXN	02/06/2024	(1,000,000)	17.13455	17,134,550
2024020103196	S	USDMXN	02/06/2024	(1,000,000)	17.14142	17,141,420
2024020103243	S	USDMXN	02/06/2024	(20,000,000)	17.1262	342,524,000
2024020103275	S	USDMXN	02/06/2024	(20,000,000)	17.135	342,700,000
2024020103716	S	USDMXN	02/06/2024	(1,500,000)	17.08949	25,634,235
2024020103733	S	USDMXN	02/06/2024	(500,000)	17.08791	8,543,955
2024020103735	S	USDMXN	02/06/2024	(416,000)	17.08895	7,109,003
2024020203161	B	USDMXN	02/06/2024	108,000,000	17.12	(1,848,960,000)
2024020203164	B	USDMXN	02/06/2024	42,000,000	17.12	(719,040,000)
2024020203167	S	USDMXN	02/06/2024	(2,500,000)	17.15079	42,876,969
2024020603039	S	USDMXN	02/06/2024	(6,868,573)	17.07087	117,252,542
2023082103229	B	USDMXN	02/07/2024	500,000	17.55934	(8,779,668)
2023100903436	BO	USDMXN	02/07/2024	56,496	18.5622	(1,048,690)
2023102403341	BO	USDMXN	02/07/2024	38,200	18.40864	(703,210)
2023120703736	B	USDMXN	02/07/2024	61,600	17.63408	(1,086,259)
2023121903757	BO	USDMXN	02/07/2024	46,400	17.20745	(798,426)
2023121903935	B	USDMXN	02/07/2024	300,000	17.20944	(5,162,831)
2023122103625	BO	USDMXN	02/07/2024	92,800	17.17015	(1,593,389)
2023122203828	BO	USDMXN	02/07/2024	210,400	17.10873	(3,599,677)
2024010303601	BO	USDMXN	02/07/2024	47,200	17.12239	(808,177)
2024010303727	BO	USDMXN	02/07/2024	65,950	17.12709	(1,129,532)
2024010803608	BO	USDMXN	02/07/2024	82,500	16.90707	(1,394,834)
2024010803726	BO	USDMXN	02/07/2024	100,000	16.90721	(1,690,721)
2024011503224	B	USDMXN	02/07/2024	204,400	16.95968	(3,466,559)
2024011603224	S	USDMXN	02/07/2024	(200,000)	17.19718	3,439,435
2024011703778	BO	USDMXN	02/07/2024	38,000	17.29014	(657,025)
2024012203698	BO	USDMXN	02/07/2024	68,568	17.23077	(1,181,479)
2024012203699	BO	USDMXN	02/07/2024	35,212	17.23045	(606,712)
2024012203314	SO	USDMXN	02/07/2024	(590,098)	17.19171	10,144,793
2024012203493	SO	USDMXN	02/07/2024	(249,422)	17.22541	4,296,396

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024020203177	B	USDMXN	02/07/2024	30,000,000	17.158	(514,740,000)
2024020203195	B	USDMXN	02/07/2024	1,000,000	17.13851	(17,138,510)
2024020203226	B	USDMXN	02/07/2024	1,000,000	17.13989	(17,139,890)
2024020203666	B	USDMXN	02/07/2024	1,000,000	17.143	(17,143,000)
2024020203115	S	USDMXN	02/07/2024	(2,000,000)	17.15213	34,304,260
2024020203162	S	USDMXN	02/07/2024	(108,000,000)	17.1227	1,849,251,600
2024020203165	S	USDMXN	02/07/2024	(42,000,000)	17.1227	719,153,400
2024020203260	S	USDMXN	02/07/2024	(2,000,000)	17.16	34,320,000
2024020203409	S	USDMXN	02/07/2024	(10,000,000)	17.16	171,600,000
2024020203680	S	USDMXN	02/07/2024	(737,500)	17.14013	12,640,846
2024020603040	B	USDMXN	02/07/2024	6,868,573	17.07395	(117,273,646)
2024020603711	B	USDMXN	02/07/2024	75,000,000	17.05	(1,278,750,000)
2023110303622	BO	USDMXN	02/08/2024	44,546	17.70361	(788,625)
2023110803436	BO	USDMXN	02/08/2024	14,650	17.79134	(260,643)
2023111603436	BO	USDMXN	02/08/2024	500,000	17.47127	(8,735,634)
2023112903184	BO	USDMXN	02/08/2024	2,660	17.38731	(46,250)
2023121503364	S	USDMXN	02/08/2024	(310,794)	17.33459	5,387,486
2024010303384	B	USDMXN	02/08/2024	1,000,000	17.13768	(17,137,679)
2024010303617	BO	USDMXN	02/08/2024	464	17.12761	(7,951)
2024010803729	BO	USDMXN	02/08/2024	100,000	16.90994	(1,690,994)
2024010903513	SO	USDMXN	02/08/2024	(500,000)	16.98079	8,490,394
2024010903514	SO	USDMXN	02/08/2024	(500,000)	16.94044	8,470,221
2024011703667	S	USDMXN	02/08/2024	(1,000,000)	17.28266	17,282,661
2024011903573	S	USDMXN	02/08/2024	(126,000)	17.13134	2,158,549
2024011903615	SO	USDMXN	02/08/2024	(310,956)	17.14877	5,332,514
2024012203701	BO	USDMXN	02/08/2024	14,597	17.23356	(251,557)
2024012203492	SO	USDMXN	02/08/2024	(421,715)	17.22352	7,263,415
2024012603781	BO	USDMXN	02/08/2024	50,000	17.17434	(858,717)
2024020203012	B	USDMXN	02/08/2024	10,000,000	17.105	(171,050,000)
2024020603128	B	USDMXN	02/08/2024	30,000,000	17.04	(511,200,000)
2024020603189	B	USDMXN	02/08/2024	1,000,000	17.03929	(17,039,290)
2024020603194	B	USDMXN	02/08/2024	1,000,000	17.04208	(17,042,080)
2024020603262	B	USDMXN	02/08/2024	1,000,000	17.04687	(17,046,870)
2024020603633	B	USDMXN	02/08/2024	600,000	17.05	(10,230,000)
2024020603718	B	USDMXN	02/08/2024	30,800	17.05849	(525,401)
2024020603719	B	USDMXN	02/08/2024	13,500	17.05853	(230,290)
2024020603092	S	USDMXN	02/08/2024	(1,000,000)	17.04737	17,047,370
2024020603124	S	USDMXN	02/08/2024	(1,000,000)	17.04763	17,047,630
2024020603126	S	USDMXN	02/08/2024	(30,000,000)	17.04	511,200,000
2024020603512	S	USDMXN	02/08/2024	(450,000)	17.03092	7,663,914
2024020603516	S	USDMXN	02/08/2024	(20,000,000)	17.017	340,340,000
2024020603712	S	USDMXN	02/08/2024	(75,000,000)	17.05282	1,278,961,500
2024020703525	BO	USDMXN	02/08/2024	3,000,000	17.06558	(51,196,748)
2024020803007	B	USDMXN	02/08/2024	4,085,371	17.075	(69,757,716)
2023031003771	S	USDMXN	02/09/2024	(39,000)	19.67953	767,502
2023090703381	SO	USDMXN	02/09/2024	(39,000)	18.00686	702,268
2024010803724	BO	USDMXN	02/09/2024	100,000	16.91266	(1,691,266)
2024011103426	BO	USDMXN	02/09/2024	63,017	17.03963	(1,073,787)
2024012203409	SO	USDMXN	02/09/2024	(274,000)	17.19582	4,711,656
2024012303719	SO	USDMXN	02/09/2024	(512,855)	17.35606	8,901,142
2024020703034	B	USDMXN	02/09/2024	1,000,000	17.06311	(17,063,110)
2024020703036	B	USDMXN	02/09/2024	1,000,000	17.06045	(17,060,450)
2024020703193	B	USDMXN	02/09/2024	1,000,000	17.03188	(17,031,880)
2024020703199	B	USDMXN	02/09/2024	1,000,000	17.03195	(17,031,950)
2024020703225	B	USDMXN	02/09/2024	1,000,000	17.03543	(17,035,430)
2024020703575	B	USDMXN	02/09/2024	2,000,000	17.0493	(34,098,600)
2024020703043	S	USDMXN	02/09/2024	(1,000,000)	17.05	17,050,000
2024020703286	S	USDMXN	02/09/2024	(2,000,000)	17.05	34,100,000
2024020703336	S	USDMXN	02/09/2024	(2,000,000)	17.05	34,100,000
2024020703337	S	USDMXN	02/09/2024	(1,000,000)	17.05976	17,059,760
2024020703351	S	USDMXN	02/09/2024	(100,000)	17.07071	1,707,071
2024020703460	S	USDMXN	02/09/2024	(10,000,000)	17.061	170,610,000
2024020703571	S	USDMXN	02/09/2024	(1,000,000)	17.07462	17,074,620
2024020703576	S	USDMXN	02/09/2024	(1,000,000)	17.07061	17,070,610

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024020703656	S	USDMXN	02/09/2024	(737,500)	17.06233	12,583,468
2024020803008	S	USDMXN	02/09/2024	(4,085,371)	17.07757	69,768,195
2024020903199	S	USDMXN	02/09/2024	(1,700,000)	17.08	29,036,000
2023070303417	BO	USDMXN	02/12/2024	2,245	17.76759	(39,894)
2023071203623	BO	USDMXN	02/12/2024	38,462	17.57222	(675,855)
2023090103177	SO	USDMXN	02/12/2024	(100,000)	17.55672	1,755,673
2023092603643	S	USDMXN	02/12/2024	(1,000,000)	17.95927	17,959,268
2023110803145	B	USDMXN	02/12/2024	30,000,000	17.775	(533,250,000)
2023112403609	B	USDMXN	02/12/2024	100,000	17.34816	(1,734,816)
2024010803730	BO	USDMXN	02/12/2024	100,000	16.92082	(1,692,082)
2024011803371	B	USDMXN	02/12/2024	30,000,000	17.28	(518,400,000)
2024012403442	SO	USDMXN	02/12/2024	(132,000)	17.24854	2,276,807
2024020803173	B	USDMXN	02/12/2024	1,000,000	17.11144	(17,111,440)
2024020803193	B	USDMXN	02/12/2024	1,000,000	17.09359	(17,093,590)
2024020803194	B	USDMXN	02/12/2024	507,921	17.09	(8,680,370)
2024020803196	B	USDMXN	02/12/2024	1,000,000	17.09361	(17,093,610)
2024020803717	B	USDMXN	02/12/2024	1,000,000	17.1652	(17,165,200)
2024020803730	B	USDMXN	02/12/2024	20,000,000	17.145	(342,900,000)
2024020803733	B	USDMXN	02/12/2024	30,000,000	17.16	(514,800,000)
2024020803739	B	USDMXN	02/12/2024	1,000,000	17.1674	(17,167,400)
2024020803097	S	USDMXN	02/12/2024	(15,000,000)	17.08	256,200,000
2024020803116	S	USDMXN	02/12/2024	(1,000,000)	17.09416	17,094,160
2024020803154	S	USDMXN	02/12/2024	(1,000,000)	17.09231	17,092,310
2024020803238	S	USDMXN	02/12/2024	(20,000,000)	17.107	342,140,000
2024020803599	S	USDMXN	02/12/2024	(1,300,000)	17.12203	22,258,639
2024020803659	S	USDMXN	02/12/2024	(1,000,000)	17.14128	17,141,280
2024020803660	S	USDMXN	02/12/2024	(1,000,000)	17.14184	17,141,840
2024020803763	S	USDMXN	02/12/2024	(737,500)	17.16289	12,657,631
2024020903102	B	USDMXN	02/12/2024	100,000,000	17.105	(1,710,500,000)
2024020903200	B	USDMXN	02/12/2024	1,700,000	17.0881	(29,049,770)
2023081403652	BO	USDMXN	02/13/2024	650,513	17.63346	(11,470,787)
2023122203602	BO	USDMXN	02/13/2024	50,000	17.10407	(855,204)
2024010803732	BO	USDMXN	02/13/2024	100,000	16.92377	(1,692,377)
2024011603718	SO	USDMXN	02/13/2024	(500,000)	17.23208	8,616,042
2024011603721	S	USDMXN	02/13/2024	(500,000)	17.26267	8,631,337
2024012603090	SO	USDMXN	02/13/2024	(373,000)	17.21576	6,421,479
2024012603484	SO	USDMXN	02/13/2024	(574)	17.19239	9,868
2024013003496	SO	USDMXN	02/13/2024	(132,000)	17.19783	2,270,114
2024020103734	B	USDMXN	02/13/2024	500,000	17.10881	(8,554,405)
2024020903141	B	USDMXN	02/13/2024	1,000,000	17.085	(17,085,000)
2024020903244	B	USDMXN	02/13/2024	2,000,000	17.096	(34,192,000)
2024020903251	B	USDMXN	02/13/2024	30,000,000	17.096	(512,880,000)
2024020903258	B	USDMXN	02/13/2024	10,000,000	17.09	(170,900,000)
2024020903484	B	USDMXN	02/13/2024	25,000	17.0943	(427,358)
2024020903503	B	USDMXN	02/13/2024	761,647	17.0883	(13,015,252)
2024020903506	B	USDMXN	02/13/2024	295,087	17.0907	(5,043,243)
2024020903508	B	USDMXN	02/13/2024	301,000	17.0907	(5,144,301)
2024020903510	B	USDMXN	02/13/2024	394,000	17.0911	(6,733,893)
2024020903594	B	USDMXN	02/13/2024	10,000,000	17.083	(170,830,000)
2024020903720	B	USDMXN	02/13/2024	5,000,000	17.08991	(85,449,550)
2024020903040	S	USDMXN	02/13/2024	(1,000,000)	17.10068	17,100,680
2024020903103	S	USDMXN	02/13/2024	(100,000,000)	17.10775	1,710,775,000
2024020903240	S	USDMXN	02/13/2024	(10,000,000)	17.0948	170,948,000
2024020903614	S	USDMXN	02/13/2024	(1,350,000)	17.095	23,078,250
2024020903617	S	USDMXN	02/13/2024	(426,734)	17.0855	7,290,964
2024020903619	S	USDMXN	02/13/2024	(140,000)	17.09005	2,392,607
2024020903715	S	USDMXN	02/13/2024	(1,000,000)	17.08279	17,082,790
2023061403060	BO	USDMXN	02/14/2024	800,000	17.96924	(14,375,390)
2023071203339	BO	USDMXN	02/14/2024	500,000	17.53079	(8,765,394)
2023071803047	BO	USDMXN	02/14/2024	600,000	17.40146	(10,440,878)
2023072703105	BO	USDMXN	02/14/2024	500,000	17.39534	(8,697,672)
2023073103212	B	USDMXN	02/14/2024	300,000	17.35159	(5,205,478)
2023081103608	SO	USDMXN	02/14/2024	(238,854)	17.59038	4,201,525
2023090603285	S	USDMXN	02/14/2024	(208,333)	18.08373	3,767,443

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023090803323	SO	USDMXN	02/14/2024	(125,000)	18.08102	2,260,127
2023091903446	B	USDMXN	02/14/2024	50,000	17.52556	(876,278)
2023092603218	SO	USDMXN	02/14/2024	(166,667)	17.92815	2,988,025
2023100303494	SO	USDMXN	02/14/2024	(166,667)	18.32067	3,053,446
2023100903437	BO	USDMXN	02/14/2024	56,496	18.58441	(1,049,945)
2023101703663	SO	USDMXN	02/14/2024	(833,333)	18.3835	15,319,582
2023102403342	BO	USDMXN	02/14/2024	38,200	18.43061	(704,049)
2023102603552	B	USDMXN	02/14/2024	2,040,000	18.5191	(37,778,956)
2023111503508	B	USDMXN	02/14/2024	50,000	17.59291	(879,645)
2023112103158	BO	USDMXN	02/14/2024	225,000	17.42079	(3,919,678)
2023112903549	S	USDMXN	02/14/2024	(244,042)	17.42722	4,252,973
2023120603151	SO	USDMXN	02/14/2024	(245,000)	17.45668	4,276,888
2023120703738	B	USDMXN	02/14/2024	61,600	17.65221	(1,087,376)
2023120803478	BO	USDMXN	02/14/2024	32,720	17.5399	(573,906)
2023120803484	BO	USDMXN	02/14/2024	32,720	17.5386	(573,863)
2023121503634	BO	USDMXN	02/14/2024	1,530	17.3913	(26,613)
2023121803837	BO	USDMXN	02/14/2024	25,600	17.32887	(443,619)
2023121903758	BO	USDMXN	02/14/2024	46,400	17.22798	(799,378)
2023121903937	B	USDMXN	02/14/2024	300,000	17.22935	(5,168,805)
2023122103624	BO	USDMXN	02/14/2024	92,800	17.18972	(1,595,206)
2024010303695	BO	USDMXN	02/14/2024	32,000	17.15635	(549,003)
2024010303515	SO	USDMXN	02/14/2024	(80,000)	17.16613	1,373,290
2024010503481	BO	USDMXN	02/14/2024	100,000	17.01294	(1,701,294)
2024010503506	BO	USDMXN	02/14/2024	106,400	17.01644	(1,810,549)
2024010803723	BO	USDMXN	02/14/2024	100,000	16.92671	(1,692,671)
2024010903707	BO	USDMXN	02/14/2024	82,600	17.06425	(1,409,507)
2024011203757	BO	USDMXN	02/14/2024	60,700	16.94101	(1,028,319)
2024011603222	S	USDMXN	02/14/2024	(200,000)	17.21737	3,443,474
2024011703780	BO	USDMXN	02/14/2024	37,600	17.30932	(650,830)
2024011803582	BO	USDMXN	02/14/2024	69,051	17.25404	(1,191,409)
2024012203697	BO	USDMXN	02/14/2024	29,200	17.24973	(503,692)
2024012303675	B	USDMXN	02/14/2024	175,200	17.3728	(3,043,715)
2024012503400	BO	USDMXN	02/14/2024	189,400	17.22705	(3,262,803)
2024012903583	BO	USDMXN	02/14/2024	34,052	17.27271	(588,170)
2024012903343	SO	USDMXN	02/14/2024	(206,000)	17.30429	3,564,684
2024012903588	S	USDMXN	02/14/2024	(1,010,472)	17.26919	17,450,032
2024020103385	BO	USDMXN	02/14/2024	58,000	17.10929	(992,339)
2024020603825	BO	USDMXN	02/14/2024	17,600	17.0764	(300,545)
2024020703523	BO	USDMXN	02/14/2024	32,500	17.08447	(555,245)
2024021203121	B	USDMXN	02/14/2024	1,000,000	17.063	(17,063,000)
2024021203122	B	USDMXN	02/14/2024	1,000,000	17.06303	(17,063,030)
2024021203138	B	USDMXN	02/14/2024	1,000,000	17.06413	(17,064,130)
2024021203140	B	USDMXN	02/14/2024	1,000,000	17.06476	(17,064,760)
2024021203434	B	USDMXN	02/14/2024	30,000,000	17.1	(513,000,000)
2024021203109	S	USDMXN	02/14/2024	(1,000,000)	17.07847	17,078,470
2024021203111	S	USDMXN	02/14/2024	(1,000,000)	17.07817	17,078,170
2024021203181	S	USDMXN	02/14/2024	(20,000,000)	17.055	341,100,000
2024021203317	S	USDMXN	02/14/2024	(2,000,000)	17.08	34,160,000
2024021303036	B	USDMXN	02/14/2024	55,000,000	17.185	(945,175,000)
2023031003625	SO	USDMXN	02/15/2024	(175,000)	19.70842	3,448,973
2023031403135	SO	USDMXN	02/15/2024	(175,000)	20.36979	3,564,713
2023042403079	BO	USDMXN	02/15/2024	367,881	19.07352	(7,016,785)
2023051603153	B	USDMXN	02/15/2024	367,881	18.45556	(6,789,449)
2023071303108	B	USDMXN	02/15/2024	367,881	17.62188	(6,482,754)
2023082503443	SO	USDMXN	02/15/2024	(200,000)	17.29862	3,459,724
2023091403460	B	USDMXN	02/15/2024	367,881	17.54208	(6,453,399)
2023110303620	BO	USDMXN	02/15/2024	44,546	17.72557	(789,603)
2023110603385	B	USDMXN	02/15/2024	350,000	17.81338	(6,234,683)
2023110803437	BO	USDMXN	02/15/2024	14,650	17.81383	(260,973)
2023110903192	B	USDMXN	02/15/2024	652,705	17.7651	(11,595,368)
2023111303370	BON	USDMXN	02/15/2024	50,000,000	17.88	(894,000,000)
2023111303371	BON	USDMXN	02/15/2024	50,000,000	17.88	(894,000,000)
2023111303365	SON	USDMXN	02/15/2024	(100,000,000)	17.8818	1,788,180,000
2023111603437	BO	USDMXN	02/15/2024	500,000	17.49194	(8,745,968)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023112903185	BO	USDMXN	02/15/2024	2,660	17.4075	(46,304)
2023120803471	B	USDMXN	02/15/2024	200,000	17.54209	(3,508,417)
2023121903358	B	USDMXN	02/15/2024	2,044,677	17.23504	(35,240,081)
2023121903600	B	USDMXN	02/15/2024	1,813,204	17.23437	(31,249,423)
2024010303516	SO	USDMXN	02/15/2024	(82,859)	17.16963	1,422,658
2024010803733	BO	USDMXN	02/15/2024	100,000	16.92965	(1,692,965)
2024012903627	SO	USDMXN	02/15/2024	(19,579)	17.27942	338,314
2024013003497	SO	USDMXN	02/15/2024	(176,000)	17.20339	3,027,796
2024013003507	SO	USDMXN	02/15/2024	(29,000)	17.21109	499,122
2024020703512	SO	USDMXN	02/15/2024	(89,381)	17.08651	1,527,209
2024020803351	BON	USDMXN	02/15/2024	100,000,000	17.14	(1,714,000,000)
2024020803118	SO	USDMXN	02/15/2024	(40,675)	17.10169	695,611
2024020803278	SO	USDMXN	02/15/2024	(53,210)	17.12729	911,343
2024020803363	SON	USDMXN	02/15/2024	(100,000,000)	17.145	1,714,500,000
2024020803373	SO	USDMXN	02/15/2024	(340,000)	17.13384	5,825,505
2024021303116	B	USDMXN	02/15/2024	1,000,000	17.21347	(17,213,470)
2024021303155	B	USDMXN	02/15/2024	1,000,000	17.19958	(17,199,580)
2024021303198	BON	USDMXN	02/15/2024	100,000,000	17.8818	(1,788,180,000)
2024021303202	BO	USDMXN	02/15/2024	0	17.203	(33,850,000)
2024021303204	BO	USDMXN	02/15/2024	0	17.203	(33,850,000)
2024021303205	BON	USDMXN	02/15/2024	100,000,000	17.145	(1,714,500,000)
2024021303207	BO	USDMXN	02/15/2024	0	17.203	(5,800,000)
2024021303389	B	USDMXN	02/15/2024	635,133	17.21507	(10,933,859)
2024021303392	B	USDMXN	02/15/2024	633,545	17.21367	(10,905,635)
2024021303394	B	USDMXN	02/15/2024	31,322	17.20868	(539,010)
2024021303545	B	USDMXN	02/15/2024	250,000	17.214	(4,303,500)
2024021303553	B	USDMXN	02/15/2024	1,790,000	17.19238	(30,774,360)
2024021303037	S	USDMXN	02/15/2024	(55,000,000)	17.18783	945,330,375
2024021303041	S	USDMXN	02/15/2024	(5,000,000)	17.16857	85,842,850
2024021303043	S	USDMXN	02/15/2024	(5,000,000)	17.16915	85,845,750
2024021303079	S	USDMXN	02/15/2024	(30,000,000)	17.174	515,220,000
2024021303113	S	USDMXN	02/15/2024	(1,000,000)	17.19649	17,196,490
2024021303151	S	USDMXN	02/15/2024	(30,000,000)	17.174	515,220,000
2024021303200	SO	USDMXN	02/15/2024	0	17.203	67,880,000
2024021303199	SON	USDMXN	02/15/2024	(50,000,000)	17.88	894,000,000
2024021303201	SON	USDMXN	02/15/2024	(50,000,000)	17.88	894,000,000
2024021303203	SON	USDMXN	02/15/2024	(100,000,000)	17.14	1,714,000,000
2024021303206	SO	USDMXN	02/15/2024	0	17.203	6,300,000
2024021303351	S	USDMXN	02/15/2024	(2,300,000)	17.22	39,606,000
2024021303581	S	USDMXN	02/15/2024	(250,000)	17.20894	4,302,235
2024021303688	S	USDMXN	02/15/2024	(300,000)	17.19718	5,159,154
2024021303690	S	USDMXN	02/15/2024	(15,000)	17.19684	257,953
2024021503161	S	USDMXN	02/15/2024	(10,000,000)	17.06	170,600,000
2024021503765	S	USDMXN	02/15/2024	(20,000,000)	17.046	340,920,000
2024021503779	S	USDMXN	02/15/2024	(10,000,000)	17.06	170,600,000
2023031003769	S	USDMXN	02/16/2024	(39,000)	19.70578	768,525
2023083103416	SO	USDMXN	02/16/2024	(200,000)	17.38615	3,477,229
2023090703379	SO	USDMXN	02/16/2024	(39,000)	18.02929	703,143
2023092703565	B	USDMXN	02/16/2024	1,000,000	18.12671	(18,126,709)
2023092703604	SO	USDMXN	02/16/2024	(2,000,000)	18.0894	36,178,797
2023111403825	B	USDMXN	02/16/2024	1,047,556	17.64227	(18,481,259)
2023111603109	BO	USDMXN	02/16/2024	836,292	17.49847	(14,633,819)
2023112103602	B	USDMXN	02/16/2024	906,975	17.47319	(15,847,744)
2023121903848	B	USDMXN	02/16/2024	2,622,980	17.23234	(45,200,086)
2024010303288	B	USDMXN	02/16/2024	2,150,112	17.16332	(36,903,059)
2024010803298	B	USDMXN	02/16/2024	234,595	16.91049	(3,967,116)
2024010803734	BO	USDMXN	02/16/2024	100,000	16.9326	(1,693,260)
2024010903390	B	USDMXN	02/16/2024	265,504	17.06353	(4,530,440)
2024011103092	B	USDMXN	02/16/2024	20,000,000	17.08745	(341,749,050)
2024011103428	BO	USDMXN	02/16/2024	63,017	17.05902	(1,075,008)
2024011503004	BO	USDMXN	02/16/2024	320,000	16.96757	(5,429,621)
2024011703697	BO	USDMXN	02/16/2024	80,000	17.30555	(1,384,444)
2024011703156	SO	USDMXN	02/16/2024	(80,000)	17.40316	1,392,253
2024012903473	SO	USDMXN	02/16/2024	(275,000)	17.24773	4,743,125

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024020603134	BO	USDMXN	02/16/2024	50,000	17.07164	(853,582)
2024020803639	SO	USDMXN	02/16/2024	(234,399)	17.11775	4,012,384
2024020903167	SO	USDMXN	02/16/2024	(112,000)	17.09343	1,914,464
2024020903511	S	USDMXN	02/16/2024	(394,000)	17.09909	6,737,043
2024021403273	B	USDMXN	02/16/2024	20,000,000	17.108	(342,160,000)
2024021403372	B	USDMXN	02/16/2024	2,000,000	17.1	(34,200,000)
2024021403511	B	USDMXN	02/16/2024	53,868	17.10971	(921,666)
2024021403235	S	USDMXN	02/16/2024	(1,000,000)	17.09606	17,096,060
2024021403347	S	USDMXN	02/16/2024	(1,000,000)	17.11	17,110,000
2024021403509	S	USDMXN	02/16/2024	(1,700,000)	17.11	29,087,000
2024021403558	S	USDMXN	02/16/2024	(500,000)	17.11115	8,555,575
2024021403567	S	USDMXN	02/16/2024	(500,000)	17.11598	8,557,990
2024021503766	B	USDMXN	02/16/2024	20,000,000	17.04885	(340,977,000)
2023010403351	B	USDMXN	02/20/2024	738,718	20.81851	(15,379,005)
2023011303499	B	USDMXN	02/20/2024	369,360	20.14957	(7,442,446)
2023041803080	BO	USDMXN	02/20/2024	73,872	19.10826	(1,411,565)
2023050203573	B	USDMXN	02/20/2024	147,744	19.05309	(2,814,979)
2023050303548	B	USDMXN	02/20/2024	73,872	18.92421	(1,397,969)
2023050503581	B	USDMXN	02/20/2024	73,872	18.82143	(1,390,377)
2023053103373	S	USDMXN	02/20/2024	(209,070)	18.62389	3,893,704
2023060703271	SO	USDMXN	02/20/2024	(214,309)	18.19914	3,900,244
2023062103496	SO	USDMXN	02/20/2024	(217,403)	17.90566	3,892,751
2023070303420	BO	USDMXN	02/20/2024	2,504	17.79272	(44,561)
2023071203624	BO	USDMXN	02/20/2024	38,462	17.59658	(676,791)
2023082503639	S	USDMXN	02/20/2024	(200,000)	17.28507	3,457,013
2023100403157	SO	USDMXN	02/20/2024	(239,132)	18.41137	4,402,747
2023101103227	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000)	18.25189	912,594
2023101103229	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000)	18.25201	912,600
2023101103231	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000)	18.25279	912,639
2023101103245	S	USDMXN	02/20/2024	(91,151)	18.27229	1,665,540
2023101803180	SO	USDMXN	02/20/2024	(235,938)	18.65277	4,400,897
2023111403356	S	USDMXN	02/20/2024	(248,742)	17.70904	4,404,982
2023112103399	S	USDMXN	02/20/2024	(252,091)	17.49244	4,409,686
2023112803299	S	USDMXN	02/20/2024	(253,383)	17.37268	4,401,943
2023120503347	SO	USDMXN	02/20/2024	(249,490)	17.59605	4,390,038
2023121503340	B	USDMXN	02/20/2024	10,000,000	17.36842	(173,684,162)
2023122203610	BO	USDMXN	02/20/2024	50,000	17.12368	(856,184)
2024010803736	BO	USDMXN	02/20/2024	100,000	16.94437	(1,694,437)
2024011603192	B	USDMXN	02/20/2024	30,000,000	17.23	(516,900,000)
2024013103636	BO	USDMXN	02/20/2024	255,000	17.2382	(4,395,741)
2024013103661	SO	USDMXN	02/20/2024	(277,000)	17.24464	4,776,766
2024020803325	BO	USDMXN	02/20/2024	768,237	17.14589	(13,172,105)
2024021203376	SO	USDMXN	02/20/2024	(56,000)	17.11341	958,351
2024021203581	SO	USDMXN	02/20/2024	(31,793)	17.09026	543,351
2024021503085	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.06	(17,060,000)
2024021503123	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.06241	(17,062,410)
2024021503162	B	USDMXN	02/20/2024	10,000,000	17.07425	(170,742,500)
2024021503241	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.08242	(17,082,420)
2024021503387	B	USDMXN	02/20/2024	500,000	17.06392	(8,531,960)
2024021503517	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.05435	(17,054,350)
2024021503527	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.05315	(17,053,150)
2024021503673	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.06	(17,060,000)
2024021503780	B	USDMXN	02/20/2024	10,000,000	17.07425	(170,742,500)
2024021503795	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.06241	(17,062,410)
2024021503802	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.08242	(17,082,420)
2024021503849	B	USDMXN	02/20/2024	500,000	17.06392	(8,531,960)
2024021503851	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.05435	(17,054,350)
2024021503854	B	USDMXN	02/20/2024	1,000,000	17.05315	(17,053,150)
2024021503039	S	USDMXN	02/20/2024	(1,000,000)	17.08408	17,084,080
2024021503097	S	USDMXN	02/20/2024	(1,000,000)	17.07775	17,077,750
2024021503118	S	USDMXN	02/20/2024	(20,000,000)	17.0633	341,266,000
2024021503213	S	USDMXN	02/20/2024	(1,000,000)	17.07589	17,075,890
2024021503380	S	USDMXN	02/20/2024	(20,000,000)	17.08	341,600,000
2024021503490	S	USDMXN	02/20/2024	(10,000,000)	17.06	170,600,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024021503627	S	USDMXN	02/20/2024	(1,000,000)	17.05315	17,053,150
2024021503628	S	USDMXN	02/20/2024	(1,000,000)	17.05304	17,053,040
2024021503670	S	USDMXN	02/20/2024	(1,000,000)	17.08408	17,084,080
2024021503677	S	USDMXN	02/20/2024	(1,000,000)	17.07775	17,077,750
2024021503695	S	USDMXN	02/20/2024	(20,000,000)	17.0633	341,266,000
2024021503799	S	USDMXN	02/20/2024	(1,000,000)	17.07589	17,075,890
2024021503828	S	USDMXN	02/20/2024	(20,000,000)	17.08	341,600,000
2024021503842	S	USDMXN	02/20/2024	(10,000,000)	17.06	170,600,000
2024021503855	S	USDMXN	02/20/2024	(4,000,000)	17.05	68,200,000
2024021503856	S	USDMXN	02/20/2024	(124,639)	17.04817	2,124,866
2024021603096	S	USDMXN	02/20/2024	(70,000,000)	17.09	1,196,300,000
2022111703252	BO	USDMXN	02/21/2024	32,306	21.06367	(680,483)
2022111703712	B	USDMXN	02/21/2024	2,172,976	21.06868	(45,781,727)
2022111803510	B	USDMXN	02/21/2024	80,333	21.10939	(1,695,781)
2023012603559	B	USDMXN	02/21/2024	650,785	20.20206	(13,147,192)
2023020103668	B	USDMXN	02/21/2024	18,997	19.95407	(379,067)
2023021003705	BO	USDMXN	02/21/2024	1,527,325	20.07441	(30,660,154)
2023022103723	BO	USDMXN	02/21/2024	193,945	19.78258	(3,836,733)
2023032903479	BO	USDMXN	02/21/2024	18,831	19.32989	(364,009)
2023032903481	BO	USDMXN	02/21/2024	72,834	19.35212	(1,409,496)
2023041303270	B	USDMXN	02/21/2024	244,880	19.15657	(4,691,061)
2023042003539	B	USDMXN	02/21/2024	171,966	19.15998	(3,294,866)
2023051703568	B	USDMXN	02/21/2024	70,864	18.56123	(1,315,323)
2023100903438	BO	USDMXN	02/21/2024	56,496	18.60664	(1,051,201)
2023101203183	B	USDMXN	02/21/2024	1,080,773	18.31005	(19,789,003)
2023102403344	BO	USDMXN	02/21/2024	38,200	18.45259	(704,889)
2023120803486	BO	USDMXN	02/21/2024	32,720	17.55809	(574,501)
2023121803629	BO	USDMXN	02/21/2024	634,000	17.34542	(10,996,995)
2023121903939	B	USDMXN	02/21/2024	300,000	17.24859	(5,174,578)
2024010303599	BO	USDMXN	02/21/2024	47,200	17.16231	(810,061)
2024010503505	BO	USDMXN	02/21/2024	159,600	17.03627	(2,718,988)
2024010803164	BO	USDMXN	02/21/2024	40,800	16.94229	(691,245)
2024010803738	BO	USDMXN	02/21/2024	100,000	16.94731	(1,694,731)
2024010903515	BO	USDMXN	02/21/2024	58,914	17.07119	(1,005,732)
2024010903712	BO	USDMXN	02/21/2024	25,800	17.08527	(440,800)
2024011203758	BO	USDMXN	02/21/2024	20,009	16.96045	(339,362)
2024011603220	S	USDMXN	02/21/2024	(200,000)	17.23829	3,447,658
2024011703781	BO	USDMXN	02/21/2024	34,000	17.32964	(589,208)
2024011903574	B	USDMXN	02/21/2024	126,000	17.16908	(2,163,304)
2024011903739	BO	USDMXN	02/21/2024	105,100	17.1822	(1,805,849)
2024012303340	B	USDMXN	02/21/2024	29,569	17.44947	(515,963)
2024012303346	B	USDMXN	02/21/2024	77,761	17.45532	(1,357,351)
2024012303665	B	USDMXN	02/21/2024	2,657,297	17.39683	(46,228,539)
2024012503402	BO	USDMXN	02/21/2024	122,000	17.24706	(2,104,142)
2024020203178	S	USDMXN	02/21/2024	(30,000,000)	17.1978	515,934,000
2024020603826	BO	USDMXN	02/21/2024	32,220	17.09635	(550,844)
2024020703521	BO	USDMXN	02/21/2024	129,600	17.10269	(2,216,509)
2024020703522	BO	USDMXN	02/21/2024	33,156	17.10449	(567,117)
2024020903476	BO	USDMXN	02/21/2024	18,000	17.10472	(307,885)
2024021303582	SO	USDMXN	02/21/2024	(252,545)	17.22531	4,350,166
2024021303689	SO	USDMXN	02/21/2024	(351,000)	17.21244	6,041,565
2024021603097	B	USDMXN	02/21/2024	70,000,000	17.09288	(1,196,501,250)
2024021603101	B	USDMXN	02/21/2024	1,000,000	17.07275	(17,072,750)
2024021603219	B	USDMXN	02/21/2024	20,000,000	17.07	(341,400,000)
2024021603131	S	USDMXN	02/21/2024	(1,000,000)	17.05525	17,055,250
2024021603209	S	USDMXN	02/21/2024	(20,000,000)	17.0644	341,288,000
2024021603391	S	USDMXN	02/21/2024	(2,504)	17.05845	42,714
2024021603538	S	USDMXN	02/21/2024	(1,000,000)	17.0494	17,049,400
2024021603544	S	USDMXN	02/21/2024	(1,000,000)	17.048	17,048,000
2024021603547	S	USDMXN	02/21/2024	(1,000,000)	17.0464	17,046,400
2024021603679	S	USDMXN	02/21/2024	(1,000,000)	17.03542	17,035,420
2024021603745	S	USDMXN	02/21/2024	(20,000,000)	17.05	341,000,000
2024021903151	B	USDMXN	02/21/2024	1,000,000	17.05025	(17,050,250)
2024021903073	S	USDMXN	02/21/2024	(1,000,000)	17.05466	17,054,660

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023110303187	BO	USDMXN	02/22/2024	5,000,000	17.71316	(88,565,815)
2023110303619	BO	USDMXN	02/22/2024	51,924	17.74622	(921,455)
2023110303926	B	USDMXN	02/22/2024	650,810	17.78839	(11,576,859)
2023110803438	BO	USDMXN	02/22/2024	14,650	17.8354	(261,289)
2023111603438	BO	USDMXN	02/22/2024	500,000	17.51262	(8,756,309)
2023112303504	S	USDMXN	02/22/2024	(4,274,033)	17.44415	74,556,881
2023112903186	BO	USDMXN	02/22/2024	2,660	17.42669	(46,355)
2023113003789	B	USDMXN	02/22/2024	4,258,892	17.60328	(74,970,451)
2024010303517	BO	USDMXN	02/22/2024	104,559	17.19353	(1,797,745)
2024010503477	BO	USDMXN	02/22/2024	500,000	17.11401	(8,557,003)
2024010803308	B	USDMXN	02/22/2024	113,879	16.925	(1,927,402)
2024010803737	BO	USDMXN	02/22/2024	100,000	16.95015	(1,695,015)
2024012303640	S	USDMXN	02/22/2024	(50,000)	17.39522	869,761
2024012403443	BO	USDMXN	02/22/2024	43,045	17.28175	(743,893)
2024020703378	BO	USDMXN	02/22/2024	61,200	17.09386	(1,046,144)
2024021203575	BO	USDMXN	02/22/2024	18,519	17.10076	(316,689)
2024021303080	B	USDMXN	02/22/2024	30,000,000	17.1937	(515,811,000)
2024021303152	B	USDMXN	02/22/2024	30,000,000	17.1937	(515,811,000)
2024022003076	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.001	(17,001,000)
2024022003148	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.0053	(17,005,300)
2024022003539	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.07455	(17,074,550)
2024022003552	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.0802	(17,080,200)
2024022003553	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.07772	(17,077,720)
2024022003561	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.07827	(17,078,270)
2024022003563	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.07747	(17,077,470)
2024022003568	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.0807	(17,080,700)
2024022003571	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.08281	(17,082,810)
2024022003577	B	USDMXN	02/22/2024	3,000,000	17.08	(51,240,000)
2024022003588	B	USDMXN	02/22/2024	5,000,000	17.07	(85,350,000)
2024022003604	B	USDMXN	02/22/2024	1,000,000	17.07	(17,070,000)
2024022003608	B	USDMXN	02/22/2024	14,000,000	17.07	(238,980,000)
2024022003698	B	USDMXN	02/22/2024	8,250,000	17.07	(140,827,500)
2024022003841	B	USDMXN	02/22/2024	500,000	17.06572	(8,532,860)
2024022003141	S	USDMXN	02/22/2024	(1,000,000)	17.01295	17,012,950
2024022003301	S	USDMXN	02/22/2024	(117,315)	17.048	1,999,979
2024022003306	S	USDMXN	02/22/2024	(4,000,000)	17.048	68,192,000
2024022003316	S	USDMXN	02/22/2024	(2,482,685)	17.048	42,324,821
2024022003799	S	USDMXN	02/22/2024	(1,032,019)	17.06586	17,612,292
2024022103029	S	USDMXN	02/22/2024	(80,000,000)	17.06	1,364,800,000
2023030303601	BO	USDMXN	02/23/2024	100,000	19.23491	(1,923,491)
2023031003766	S	USDMXN	02/23/2024	(39,000)	19.73239	769,563
2023080303285	BO	USDMXN	02/23/2024	260,000	17.99535	(4,678,792)
2023081003641	BO	USDMXN	02/23/2024	60,000	17.71241	(1,062,745)
2023081103102	BO	USDMXN	02/23/2024	100,000	17.58119	(1,758,119)
2023090703384	SO	USDMXN	02/23/2024	(39,000)	18.05178	704,019
2023111603110	BO	USDMXN	02/23/2024	393,884	17.51917	(6,900,521)
2023111603552	BO	USDMXN	02/23/2024	7,885	17.51819	(138,131)
2023120703656	BO	USDMXN	02/23/2024	60,000	17.73168	(1,063,901)
2023120703533	SO	USDMXN	02/23/2024	(160,000)	17.65837	2,825,339
2024010803739	BO	USDMXN	02/23/2024	100,000	16.95298	(1,695,298)
2024011103429	BO	USDMXN	02/23/2024	63,017	17.07892	(1,076,262)
2024011903140	B	USDMXN	02/23/2024	30,000,000	17.229	(516,870,000)
2024020203463	SO	USDMXN	02/23/2024	(300,000)	17.22282	5,166,848
2024020803326	BO	USDMXN	02/23/2024	930,775	17.15506	(15,967,498)
2024021303567	SO	USDMXN	02/23/2024	(61,298)	17.21843	1,055,455
2024022103030	B	USDMXN	02/23/2024	80,000,000	17.06285	(1,365,028,000)
2024022103112	B	USDMXN	02/23/2024	1,000,000	17.04726	(17,047,260)
2024022103194	B	USDMXN	02/23/2024	1,000,000	17.05318	(17,053,180)
2024022103470	B	USDMXN	02/23/2024	1,000,000	17.08576	(17,085,760)
2024022103501	B	USDMXN	02/23/2024	38,814	17.06998	(662,554)
2024022103657	B	USDMXN	02/23/2024	10,000,000	17.065	(170,650,000)
2024022103159	S	USDMXN	02/23/2024	(1,000,000)	17.06237	17,062,370
2024022103169	S	USDMXN	02/23/2024	(20,000,000)	17.05	341,000,000
2024022103181	S	USDMXN	02/23/2024	(1,000,000)	17.06575	17,065,750

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024022103260	S	USDMXN	02/23/2024	(20,000,000)	17.055	341,100,000
2024022103311	S	USDMXN	02/23/2024	(2,000,000)	17.06	34,120,000
2024022103353	S	USDMXN	02/23/2024	(415,365)	17.07	7,090,281
2024022103356	S	USDMXN	02/23/2024	(1,500,000)	17.07	25,605,000
2024022103537	S	USDMXN	02/23/2024	(30,000,000)	17.06	511,800,000
2024022203507	B	USDMXN	02/23/2024	10,000,000	17.1037	(171,036,950)
2024022303320	BO	USDMXN	02/23/2024	2,000,000	17.10545	(34,210,900)
2023071203625	BO	USDMXN	02/26/2024	38,462	17.61457	(677,484)
2023073103548	BO	USDMXN	02/26/2024	2,026	17.38078	(35,220)
2023090603180	SO	USDMXN	02/26/2024	(200,000)	18.06044	3,612,088
2024010803727	BO	USDMXN	02/26/2024	100,000	16.96147	(1,696,147)
2024020703490	SO	USDMXN	02/26/2024	(400,000)	17.11756	6,847,024
2024022103823	B	USDMXN	02/26/2024	1,000,000	17.06427	(17,064,270)
2024022203550	B	USDMXN	02/26/2024	5,000,000	17.10956	(85,547,800)
2024022203508	S	USDMXN	02/26/2024	(10,000,000)	17.11197	171,119,700
2024022203653	S	USDMXN	02/26/2024	(1,463,535)	17.12542	25,063,652
2024022203662	S	USDMXN	02/26/2024	(20,000,000)	17.12	342,400,000
2023111603548	B	USDMXN	02/27/2024	739,056	17.52805	(12,954,210)
2024010803735	BO	USDMXN	02/27/2024	100,000	16.9643	(1,696,430)
2024012603783	B	USDMXN	02/27/2024	100,000	17.22509	(1,722,509)
2024021503119	B	USDMXN	02/27/2024	20,000,000	17.08327	(341,665,380)
2024021503696	B	USDMXN	02/27/2024	20,000,000	17.08327	(341,665,380)
2024022003640	BON	USDMXN	02/27/2024	50,000,000	17.09	(854,500,000)
2024022003649	BO	USDMXN	02/27/2024	50,000,000	17.09	(854,500,000)
2024022003592	SO	USDMXN	02/27/2024	(100,000)	17.08406	1,708,406
2024022003615	SON	USDMXN	02/27/2024	(50,000,000)	17.09	854,500,000
2024022003625	SO	USDMXN	02/27/2024	(50,000,000)	17.09	854,500,000
2024022303242	BON	USDMXN	02/27/2024	50,000,000	17.09	(854,500,000)
2024022303245	BO	USDMXN	02/27/2024	0	17.139	(2,450,000)
2024022303580	B	USDMXN	02/27/2024	25,000	17.1153	(427,883)
2024022303244	SON	USDMXN	02/27/2024	(50,000,000)	17.09	854,500,000
2024022303246	SO	USDMXN	02/27/2024	0	17.139	2,450,000
2024022603076	B	USDMXN	02/27/2024	1,490,423	17.10112	(25,487,912)
2022111503670	B	USDMXN	02/28/2024	545,045	21.00611	(11,449,276)
2023031003627	SO	USDMXN	02/28/2024	(125,000)	19.75309	2,469,137
2023031403138	SO	USDMXN	02/28/2024	(125,000)	20.41889	2,552,362
2023061603187	B	USDMXN	02/28/2024	400,000	17.91952	(7,167,808)
2023072103309	B	USDMXN	02/28/2024	1,300,000	17.65132	(22,946,711)
2023081003238	BO	USDMXN	02/28/2024	700,000	17.56108	(12,292,756)
2023081103547	SO	USDMXN	02/28/2024	(238,563)	17.62905	4,205,638
2023082103110	BO	USDMXN	02/28/2024	238	17.66773	(4,206)
2023092603344	SO	USDMXN	02/28/2024	(239,848)	17.94621	4,304,362
2023100903439	BO	USDMXN	02/28/2024	56,496	18.62888	(1,052,457)
2023101003379	S	USDMXN	02/28/2024	(233,658)	18.41454	4,302,705
2023101703211	B	USDMXN	02/28/2024	576,369	18.34642	(10,574,305)
2023101703408	S	USDMXN	02/28/2024	(234,716)	18.32902	4,302,115
2023102403343	BO	USDMXN	02/28/2024	38,200	18.47449	(705,725)
2023110603387	B	USDMXN	02/28/2024	250,000	17.85431	(4,463,577)
2023110803638	BO	USDMXN	02/28/2024	90,100	17.88093	(1,611,072)
2023111503555	B	USDMXN	02/28/2024	250,000	17.62745	(4,406,863)
2023111503481	S	USDMXN	02/28/2024	(240,889)	17.63806	4,248,815
2023112103604	B	USDMXN	02/28/2024	1,346,077	17.50864	(23,567,980)
2023112203310	S	USDMXN	02/28/2024	(243,135)	17.48594	4,251,444
2023112803584	B	USDMXN	02/28/2024	1,656,950	17.40415	(28,837,813)
2023112903806	B	USDMXN	02/28/2024	55,400	17.51286	(970,213)
2023112903546	S	USDMXN	02/28/2024	(243,511)	17.4681	4,253,675
2023121403847	BO	USDMXN	02/28/2024	50,000	17.38695	(869,348)
2023121903941	B	USDMXN	02/28/2024	300,000	17.26793	(5,180,378)
2024010303290	B	USDMXN	02/28/2024	1,027,986	17.19792	(17,679,225)
2024010303694	BO	USDMXN	02/28/2024	32,000	17.19516	(550,245)
2024010503494	BO	USDMXN	02/28/2024	106,400	17.05295	(1,814,434)
2024010503601	BO	USDMXN	02/28/2024	176,122	17.04311	(3,001,667)
2024010803586	BO	USDMXN	02/28/2024	300,000	16.95902	(5,087,705)
2024010803728	BO	USDMXN	02/28/2024	100,000	16.96713	(1,696,713)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024010903516	BO	USDMXN	02/28/2024	58,914	17.09116	(1,006,909)
2024010903713	BO	USDMXN	02/28/2024	25,800	17.10519	(441,314)
2024011103718	B	USDMXN	02/28/2024	235,441	17.03966	(4,011,835)
2024011603218	S	USDMXN	02/28/2024	(200,000)	17.259	3,451,800
2024011803507	B	USDMXN	02/28/2024	282,361	17.28927	(4,881,816)
2024012303666	BO	USDMXN	02/28/2024	32,800	17.41907	(571,346)
2024012403678	BO	USDMXN	02/28/2024	87,400	17.33468	(1,515,051)
2024012503404	BO	USDMXN	02/28/2024	31,400	17.32221	(543,917)
2024012603349	BO	USDMXN	02/28/2024	83,150	17.23192	(1,432,834)
2024012903580	BO	USDMXN	02/28/2024	31,400	17.3133	(543,638)
2024012903658	BO	USDMXN	02/28/2024	353,179	17.3108	(6,113,810)
2024012903773	BO	USDMXN	02/28/2024	45,400	17.30586	(785,686)
2024020103386	BO	USDMXN	02/28/2024	32,000	17.15268	(548,886)
2024020903477	BO	USDMXN	02/28/2024	17,600	17.12526	(301,405)
2024021203578	BO	USDMXN	02/28/2024	32,976	17.11779	(564,476)
2024021203435	S	USDMXN	02/28/2024	(30,000,000)	17.139	514,170,000
2024021903485	BO	USDMXN	02/28/2024	33,872	17.06363	(577,979)
2024022003594	BO	USDMXN	02/28/2024	36,480	17.09045	(623,459)
2024022103682	BO	USDMXN	02/28/2024	37,136	17.06555	(633,746)
2024022103176	SO	USDMXN	02/28/2024	(59,494)	17.07741	1,016,004
2024022103493	SO	USDMXN	02/28/2024	(66,019)	17.07853	1,127,507
2024022103494	SO	USDMXN	02/28/2024	(82,037)	17.07941	1,401,144
2024022103495	SO	USDMXN	02/28/2024	(38,300)	17.08031	654,176
2024022103496	SO	USDMXN	02/28/2024	(12,424)	17.08151	212,221
2024022103497	SO	USDMXN	02/28/2024	(80,079)	17.08131	1,367,854
2024022103499	SO	USDMXN	02/28/2024	(279,350)	17.07841	4,770,855
2024022603196	B	USDMXN	02/28/2024	10,000,000	17.1274	(171,274,000)
2024022603288	B	USDMXN	02/28/2024	1,000,000	17.12854	(17,128,540)
2024022603379	B	USDMXN	02/28/2024	40,000,000	17.125	(685,000,000)
2024022603077	S	USDMXN	02/28/2024	(1,490,423)	17.1039	25,492,052
2024022603124	S	USDMXN	02/28/2024	(20,000,000)	17.103	342,060,000
2024022603139	S	USDMXN	02/28/2024	(1,000,000)	17.1181	17,118,100
2024022603381	S	USDMXN	02/28/2024	(20,000,000)	17.125	342,500,000
2024022603498	S	USDMXN	02/28/2024	(9,000,000)	17.105	153,945,000
2024022603520	S	USDMXN	02/28/2024	(10,000,000)	17.105	171,050,000
2022110103588	B	USDMXN	02/29/2024	4,230,000	21.50345	(90,959,610)
2023051503287	B	USDMXN	02/29/2024	1,000,000	18.59094	(18,590,941)
2023070303474	B	USDMXN	02/29/2024	192,800	17.82221	(3,436,121)
2023090803658	S	USDMXN	02/29/2024	(50,000)	18.13255	906,627
2023091303522	B	USDMXN	02/29/2024	48,100	17.64909	(848,921)
2023110103520	BO	USDMXN	02/29/2024	50,000	18.2559	(912,795)
2023110303618	BO	USDMXN	02/29/2024	44,546	17.76838	(791,510)
2023110803439	BO	USDMXN	02/29/2024	14,650	17.85727	(261,609)
2023111603439	BO	USDMXN	02/29/2024	500,000	17.53338	(8,766,689)
2023121303979	BO	USDMXN	02/29/2024	140,000	17.49166	(2,448,833)
2024010303618	BO	USDMXN	02/29/2024	4,141	17.18658	(71,170)
2024010503478	BO	USDMXN	02/29/2024	500,000	17.13396	(8,566,980)
2024010803740	BO	USDMXN	02/29/2024	100,000	16.96997	(1,696,997)
2024012403444	BO	USDMXN	02/29/2024	27,892	17.30197	(482,586)
2024012903629	B	USDMXN	02/29/2024	620,000	17.32175	(10,739,487)
2024021203569	BO	USDMXN	02/29/2024	14,597	17.12037	(249,906)
2024022703059	B	USDMXN	02/29/2024	2,000,000	17.055	(34,110,000)
2024022703060	B	USDMXN	02/29/2024	500,000	17.05625	(8,528,125)
2024022703063	B	USDMXN	02/29/2024	1,000,000	17.05625	(17,056,250)
2024022703216	B	USDMXN	02/29/2024	2,000,000	17.05	(34,100,000)
2024022703251	B	USDMXN	02/29/2024	1,000,000	17.05439	(17,054,390)
2024022703404	B	USDMXN	02/29/2024	15,000,000	17.056	(255,840,000)
2024022703474	B	USDMXN	02/29/2024	161,352	17.07703	(2,755,413)
2024022703515	B	USDMXN	02/29/2024	1,000,000	17.0665	(17,066,500)
2024022703523	B	USDMXN	02/29/2024	1,000,000	17.06482	(17,064,820)
2024022703074	S	USDMXN	02/29/2024	(1,000,000)	17.0484	17,048,400
2024022703186	S	USDMXN	02/29/2024	(1,000,000)	17.068	17,068,000
2024022703195	S	USDMXN	02/29/2024	(1,000,000)	17.06566	17,065,660
2024022703351	S	USDMXN	02/29/2024	(2,000,000)	17.07178	34,143,560

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024022703355	S	USDMXN	02/29/2024	(1,000,000)	17.07176	17,071,760
2024022703358	S	USDMXN	02/29/2024	(1,000,000)	17.0735	17,073,500
2024022703372	S	USDMXN	02/29/2024	(2,000,000)	17.07	34,140,000
2024022703581	S	USDMXN	02/29/2024	(2,000,000)	17.065	34,130,000
2024022703656	S	USDMXN	02/29/2024	(3,000,000)	17.065	51,195,000
2024022703700	S	USDMXN	02/29/2024	(2,500,000)	17.065	42,662,500
2024022703706	S	USDMXN	02/29/2024	(47,136)	17.06377	804,324
2023031003760	S	USDMXN	03/01/2024	(31,200)	19.75304	616,295
2023090703382	SO	USDMXN	03/01/2024	(31,200)	18.07427	563,917
2023112903157	S	USDMXN	03/01/2024	(10,000,000)	17.43684	174,368,375
2023122203481	B	USDMXN	03/01/2024	50,000,000	17.15633	(857,816,505)
2024011103421	BO	USDMXN	03/01/2024	63,017	17.09873	(1,077,510)
2024020203681	B	USDMXN	03/01/2024	737,500	17.20621	(12,689,576)
2024020703657	B	USDMXN	03/01/2024	737,500	17.12132	(12,626,974)
2024020803764	B	USDMXN	03/01/2024	737,500	17.2134	(12,694,882)
2024020903509	S	USDMXN	03/01/2024	(301,000)	17.13719	5,158,293
2024022603148	BO	USDMXN	03/01/2024	60,000	17.13038	(1,027,823)
2024022703918	B	USDMXN	03/01/2024	500,000	17.0652	(8,532,600)
2024022803127	B	USDMXN	03/01/2024	2,000,000	17.095	(34,190,000)
2024022803200	B	USDMXN	03/01/2024	2,000,000	17.09	(34,180,000)
2024022803043	S	USDMXN	03/01/2024	(1,000,000)	17.085	17,085,000
2024022803044	S	USDMXN	03/01/2024	(1,000,000)	17.09	17,090,000
2024022803107	S	USDMXN	03/01/2024	(30,000,000)	17.09	512,700,000
2024022803111	S	USDMXN	03/01/2024	(30,000,000)	17.09	512,700,000
2024022803623	S	USDMXN	03/01/2024	(30,000,000)	17.098	512,940,000
2024022803629	S	USDMXN	03/01/2024	(30,000,000)	17.099	512,970,000
2024022803643	S	USDMXN	03/01/2024	(3,800,000)	17.1	64,980,000
2023073103549	BO	USDMXN	03/04/2024	1,534	17.402	(26,697)
2023090503340	SO	USDMXN	03/04/2024	(100,000)	17.82259	1,782,260
2023090503341	SO	USDMXN	03/04/2024	(100,000)	17.76418	1,776,418
2023122903159	BO	USDMXN	03/04/2024	500,000	17.07378	(8,536,891)
2024021403623	SO	USDMXN	03/04/2024	(441,000)	17.15494	7,565,329
2024022903029	B	USDMXN	03/04/2024	1,000,000	17.06929	(17,069,290)
2024022903437	B	USDMXN	03/04/2024	1,000,000	17.06426	(17,064,260)
2024022903590	B	USDMXN	03/04/2024	1,000,000	17.06156	(17,061,560)
2024022903673	B	USDMXN	03/04/2024	81,359	17.04866	(1,387,062)
2024022903970	B	USDMXN	03/04/2024	160,000	17.04722	(2,727,555)
2024022903075	S	USDMXN	03/04/2024	(1,000,000)	17.05467	17,054,670
2024022903096	S	USDMXN	03/04/2024	(10,000,000)	17.07	170,700,000
2024022903655	S	USDMXN	03/04/2024	(1,000,000)	17.04525	17,045,250
2024022903665	S	USDMXN	03/04/2024	(1,000,000)	17.04661	17,046,610
2024022903824	S	USDMXN	03/04/2024	(160,000)	17.051	2,728,160
2024022904044	S	USDMXN	03/04/2024	(13,712)	17.05382	233,845
2023071203626	BO	USDMXN	03/05/2024	38,462	17.63857	(678,406)
2023091103595	B	USDMXN	03/05/2024	100,000	17.8463	(1,784,630)
2023101103247	S	USDMXN	03/05/2024	(235,131)	18.31573	4,306,591
2023102703304	SO	USDMXN	03/05/2024	(233,196)	18.44384	4,301,031
2023110703157	SO	USDMXN	03/05/2024	(240,500)	17.89098	4,302,781
2023111403354	S	USDMXN	03/05/2024	(242,445)	17.75116	4,303,679
2023112103397	S	USDMXN	03/05/2024	(245,953)	17.52961	4,311,461
2023122203605	BO	USDMXN	03/05/2024	50,000	17.16312	(858,156)
2024010303518	BO	USDMXN	03/05/2024	39,055	17.22732	(672,812)
2024020803367	SO	USDMXN	03/05/2024	(203,630)	17.19332	3,501,076
2024020903241	B	USDMXN	03/05/2024	10,000,000	17.15331	(171,533,070)
2024022203483	SO	USDMXN	03/05/2024	(142,000)	17.14499	2,434,589
2024022203743	SO	USDMXN	03/05/2024	(151,008)	17.13838	2,588,032
2024030103113	B	USDMXN	03/05/2024	2,000,000	17.02618	(34,052,360)
2024030103185	B	USDMXN	03/05/2024	2,000,000	17.01147	(34,022,940)
2024030103554	B	USDMXN	03/05/2024	1,000,000	17.02128	(17,021,280)
2024030103138	S	USDMXN	03/05/2024	(2,000,000)	17.00499	34,009,980
2024030103242	S	USDMXN	03/05/2024	(30,000,000)	17.01	510,300,000
2024030103482	S	USDMXN	03/05/2024	(30,000,000)	17.015	510,450,000
2024030103555	S	USDMXN	03/05/2024	(53,191)	17.01725	905,165
2023100903440	BO	USDMXN	03/06/2024	56,496	18.65112	(1,053,714)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121803836	BO	USDMXN	03/06/2024	25,600	17.38783	(445,129)
2023121903943	B	USDMXN	03/06/2024	300,000	17.28657	(5,185,970)
2024010903517	BO	USDMXN	03/06/2024	58,914	17.11083	(1,008,067)
2024010903714	BO	USDMXN	03/06/2024	48,000	17.12569	(822,033)
2024011003368	BO	USDMXN	03/06/2024	58,000	17.14031	(994,138)
2024011603216	S	USDMXN	03/06/2024	(200,000)	17.27911	3,455,822
2024012303677	B	USDMXN	03/06/2024	126,649	17.43405	(2,208,004)
2024012503401	BO	USDMXN	03/06/2024	59,600	17.28754	(1,030,338)
2024020103270	S	USDMXN	03/06/2024	(30,000,000)	17.2199	516,597,000
2024020603829	BO	USDMXN	03/06/2024	51,550	17.13982	(883,558)
2024020903724	BO	USDMXN	03/06/2024	114,000	17.1506	(1,955,169)
2024021503637	BO	USDMXN	03/06/2024	19,800	17.09891	(338,558)
2024021503899	BO	USDMXN	03/06/2024	19,800	17.09891	(338,558)
2024021503901	BO	USDMXN	03/06/2024	19,800	17.09891	(338,558)
2024022203742	SO	USDMXN	03/06/2024	(69,979)	17.14449	1,199,754
2024022603125	B	USDMXN	03/06/2024	20,000,000	17.1226	(342,452,000)
2024022603580	BO	USDMXN	03/06/2024	93,768	17.12416	(1,605,699)
2024022603147	SO	USDMXN	03/06/2024	(70,635)	17.14084	1,210,743
2024022803692	BO	USDMXN	03/06/2024	38,632	17.11964	(661,366)
2024030403625	B	USDMXN	03/06/2024	1,400,000	16.96376	(23,749,264)
2024030403872	B	USDMXN	03/06/2024	1,500,000	16.9634	(25,445,100)
2024030403958	B	USDMXN	03/06/2024	450,000	16.96309	(7,633,391)
2024030403959	S	USDMXN	03/06/2024	(500,000)	16.96077	8,480,385
2023110303615	BO	USDMXN	03/07/2024	44,544	17.78913	(792,399)
2023110803440	BO	USDMXN	03/07/2024	14,650	17.88193	(261,970)
2023111603440	BO	USDMXN	03/07/2024	500,000	17.55414	(8,777,070)
2023112903164	BO	USDMXN	03/07/2024	2,660	17.46399	(46,454)
2024010303521	BO	USDMXN	03/07/2024	5,266	17.23091	(90,738)
2024020203171	BO	USDMXN	03/07/2024	500,000	17.1392	(8,569,599)
2024030503079	B	USDMXN	03/07/2024	1,000,000	16.92369	(16,923,690)
2024030503086	B	USDMXN	03/07/2024	50,000,000	16.95	(847,500,000)
2024030503088	B	USDMXN	03/07/2024	50,000,000	16.952	(847,600,000)
2024030503102	B	USDMXN	03/07/2024	1,000,000	16.92	(16,920,000)
2024030503658	B	USDMXN	03/07/2024	1,000,000	16.95255	(16,952,550)
2024030503665	B	USDMXN	03/07/2024	1,000,000	16.95314	(16,953,140)
2024030503668	B	USDMXN	03/07/2024	2,300,000	16.95082	(38,986,886)
2024030503081	S	USDMXN	03/07/2024	(1,000,000)	16.92741	16,927,410
2024030503094	S	USDMXN	03/07/2024	(1,000,000)	16.9347	16,934,700
2024030503264	S	USDMXN	03/07/2024	(2,000,000)	16.92529	33,850,580
2024030503265	S	USDMXN	03/07/2024	(1,000,000)	16.92477	16,924,770
2024030503288	S	USDMXN	03/07/2024	(1,000,000)	16.9358	16,935,800
2024030503289	S	USDMXN	03/07/2024	(1,000,000)	16.9358	16,935,800
2024030503398	S	USDMXN	03/07/2024	(30,000,000)	16.93	507,900,000
2024030503437	S	USDMXN	03/07/2024	(1,000,000)	16.94	16,940,000
2024030503440	S	USDMXN	03/07/2024	(2,000,000)	16.938	33,876,000
2024030503673	S	USDMXN	03/07/2024	(126,000)	16.94779	2,135,422
2023031003755	B	USDMXN	03/08/2024	31,200	19.8194	(618,365)
2023031003758	S	USDMXN	03/08/2024	(62,400)	19.7803	1,234,291
2023090703383	SO	USDMXN	03/08/2024	(31,200)	18.09676	564,619
2024011103422	BO	USDMXN	03/08/2024	63,017	17.11842	(1,078,751)
2024011103716	S	USDMXN	03/08/2024	(180,942)	17.06511	3,087,795
2024012303636	B	USDMXN	03/08/2024	614,413	17.43677	(10,713,369)
2024020903660	BO	USDMXN	03/08/2024	68,750	17.15276	(1,179,252)
2024022203484	SO	USDMXN	03/08/2024	(299,000)	17.15335	5,128,853
2024022803651	SO	USDMXN	03/08/2024	(31,014)	17.12215	531,026
2024022803658	SO	USDMXN	03/08/2024	(32,229)	17.12035	551,772
2024030103468	BO	USDMXN	03/08/2024	50,000	17.0203	(851,015)
2024030603162	B	USDMXN	03/08/2024	40,000,000	16.865	(674,600,000)
2024030603317	B	USDMXN	03/08/2024	1,000,000	16.86276	(16,862,760)
2024030603510	B	USDMXN	03/08/2024	2,000,000	16.8689	(33,737,800)
2024030603288	S	USDMXN	03/08/2024	(1,000,000)	16.86255	16,862,550
2024030603432	S	USDMXN	03/08/2024	(1,500,000)	16.88	25,320,000
2024030603448	S	USDMXN	03/08/2024	(88,782)	16.88586	1,499,160
2024030603521	S	USDMXN	03/08/2024	(500,000)	16.8779	8,438,950

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024030603797	S	USDMXN	03/08/2024	(1,000,000)	16.87713	16,877,130
2023100603569	BO	USDMXN	03/11/2024	1,228	18.66653	(22,931)
2024010803202	B	USDMXN	03/11/2024	20,000,000	16.97647	(339,529,300)
2024010803356	B	USDMXN	03/11/2024	10,000,000	16.98032	(169,803,162)
2024022203479	SO	USDMXN	03/11/2024	(142,000)	17.14163	2,434,112
2024022203482	SO	USDMXN	03/11/2024	(299,000)	17.14163	5,125,347
2024030103472	BO	USDMXN	03/11/2024	90,000	17.02823	(1,532,541)
2023010603325	B	USDMXN	03/12/2024	1,274,293	20.64169	(26,303,556)
2023011303497	B	USDMXN	03/12/2024	637,147	20.21264	(12,878,421)
2023041803081	BO	USDMXN	03/12/2024	127,429	19.17957	(2,444,033)
2023050203577	B	USDMXN	03/12/2024	254,858	19.12951	(4,875,308)
2023050303550	B	USDMXN	03/12/2024	127,429	18.99689	(2,420,755)
2023050503583	B	USDMXN	03/12/2024	127,429	18.89683	(2,408,004)
2023071203628	BO	USDMXN	03/12/2024	38,462	17.65956	(679,214)
2023071203627	BO	USDMXN	03/12/2024	38,462	17.65956	(679,214)
2023071203641	SO	USDMXN	03/12/2024	(38,462)	17.64224	678,548
2023091103593	B	USDMXN	03/12/2024	100,000	17.86871	(1,786,871)
2023122203611	BO	USDMXN	03/12/2024	50,000	17.18295	(859,147)
2024022203744	SO	USDMXN	03/12/2024	(300,000)	17.15472	5,146,417
2024030803048	B	USDMXN	03/12/2024	1,000,000	16.81245	(16,812,450)
2024030803049	B	USDMXN	03/12/2024	1,000,000	16.8141	(16,814,100)
2024030803207	B	USDMXN	03/12/2024	2,000,000	16.775	(33,550,000)
2024030803208	B	USDMXN	03/12/2024	2,000,000	16.77271	(33,545,420)
2024030803376	B	USDMXN	03/12/2024	1,000,000	16.81866	(16,818,660)
2024030803619	B	USDMXN	03/12/2024	25,000	16.8083	(420,208)
2024030803665	B	USDMXN	03/12/2024	1,500,000	16.81	(25,215,000)
2024030803851	B	USDMXN	03/12/2024	2,000,000	16.81372	(33,627,440)
2024030803857	B	USDMXN	03/12/2024	250,000	16.8151	(4,203,775)
2024030803877	B	USDMXN	03/12/2024	3,800,000	16.812	(63,885,600)
2024030803886	B	USDMXN	03/12/2024	6,200,000	16.813	(104,240,600)
2024030803893	B	USDMXN	03/12/2024	3,000,000	16.813	(50,439,000)
2024030803894	B	USDMXN	03/12/2024	1,000,000	16.813	(16,813,000)
2024030803896	B	USDMXN	03/12/2024	515,250	16.8156	(8,664,238)
2024030803953	B	USDMXN	03/12/2024	1,226,927	16.81157	(20,626,564)
2024030803062	S	USDMXN	03/12/2024	(1,000,000)	16.79325	16,793,250
2024030803063	S	USDMXN	03/12/2024	(1,000,000)	16.791	16,791,000
2024030803280	S	USDMXN	03/12/2024	(1,000,000)	16.81144	16,811,440
2024030803365	S	USDMXN	03/12/2024	(50,000,000)	16.805	840,250,000
2024030803704	S	USDMXN	03/12/2024	(233,000)	16.807	3,916,031
2024030803707	S	USDMXN	03/12/2024	(160,282)	16.80665	2,693,803
2024031203051	B	USDMXN	03/12/2024	124,000,000	16.835	(2,087,540,000)
2024031203048	S	USDMXN	03/12/2024	(124,000,000)	16.835	2,087,540,000
2023060603197	B	USDMXN	03/13/2024	300,000	18.37464	(5,512,391)
2023061603189	B	USDMXN	03/13/2024	250,000	17.95832	(4,489,580)
2023072003611	BO	USDMXN	03/13/2024	250,000	17.66732	(4,416,829)
2023072403302	B	USDMXN	03/13/2024	500,000	17.54748	(8,773,741)
2023073103215	B	USDMXN	03/13/2024	300,000	17.43922	(5,231,765)
2023090603289	S	USDMXN	03/13/2024	(208,333)	18.17148	3,785,725
2023090803324	SO	USDMXN	03/13/2024	(125,000)	18.17206	2,271,508
2023092603219	SO	USDMXN	03/13/2024	(166,667)	18.01414	3,002,357
2023100303496	SO	USDMXN	03/13/2024	(166,667)	18.40718	3,067,864
2023100903441	BO	USDMXN	03/13/2024	56,496	18.67341	(1,054,973)
2023101003377	S	USDMXN	03/13/2024	(249,552)	18.45608	4,605,760
2023101703664	SO	USDMXN	03/13/2024	(833,333)	18.47124	15,392,703
2023111503538	B	USDMXN	03/13/2024	250,000	17.67585	(4,418,962)
2024010503479	BO	USDMXN	03/13/2024	600,000	17.07228	(10,243,369)
2024010503482	BO	USDMXN	03/13/2024	50,000	17.09234	(854,617)
2024010903518	BO	USDMXN	03/13/2024	58,914	17.1309	(1,009,250)
2024011003369	BO	USDMXN	03/13/2024	58,000	17.16031	(995,298)
2024011603214	S	USDMXN	03/13/2024	(200,000)	17.29872	3,459,744
2024012303679	B	USDMXN	03/13/2024	126,649	17.45462	(2,210,610)
2024012903582	BO	USDMXN	03/13/2024	31,400	17.35362	(544,904)
2024020903725	BO	USDMXN	03/13/2024	22,500	17.17028	(386,331)
2024021203577	BO	USDMXN	03/13/2024	41,580	17.15718	(713,395)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024021403727	BO	USDMXN	03/13/2024	137,750	17.17262	(2,365,528)
2024021603210	B	USDMXN	03/13/2024	20,000,000	17.12441	(342,488,200)
2024021603668	BO	USDMXN	03/13/2024	100,000	17.09849	(1,709,849)
2024022003593	BO	USDMXN	03/13/2024	126,000	17.13044	(2,158,435)
2024022103685	BO	USDMXN	03/13/2024	61,200	17.10557	(1,046,861)
2024022603577	BO	USDMXN	03/13/2024	55,200	17.14381	(946,338)
2024022603578	BO	USDMXN	03/13/2024	55,200	17.14391	(946,344)
2024022603607	BO	USDMXN	03/13/2024	124,400	17.13491	(2,131,583)
2024031103081	B	USDMXN	03/13/2024	2,000,000	16.7997	(33,599,400)
2024031103271	B	USDMXN	03/13/2024	20,000,000	16.816	(336,320,000)
2024031103493	B	USDMXN	03/13/2024	100,000,000	16.8	(1,680,000,000)
2024031103494	B	USDMXN	03/13/2024	100,000,000	16.8	(1,680,000,000)
2024031103135	S	USDMXN	03/13/2024	(1,000,000)	16.82106	16,821,060
2024031103136	S	USDMXN	03/13/2024	(1,000,000)	16.8214	16,821,400
2024031103500	S	USDMXN	03/13/2024	(200,000,000)	16.8	3,360,000,000
2024031103582	S	USDMXN	03/13/2024	(200,000)	16.80223	3,360,446
2024031203049	B	USDMXN	03/13/2024	124,000,000	16.8374	(2,087,837,600)
2024031203052	S	USDMXN	03/13/2024	(124,000,000)	16.8374	2,087,837,600
2021111003156	SO	USDMXN	03/14/2024	(500,000,000)	29	14,500,000,000
2023110303617	BO	USDMXN	03/14/2024	44,543	17.81136	(793,371)
2023110803441	BO	USDMXN	03/14/2024	29,300	17.90397	(524,586)
2023111503510	B	USDMXN	03/14/2024	50,000	17.67994	(883,997)
2023111603441	BO	USDMXN	03/14/2024	500,000	17.5749	(8,787,450)
2023112903165	BO	USDMXN	03/14/2024	2,660	17.48565	(46,512)
2023112903550	B	USDMXN	03/14/2024	244,042	17.50929	(4,273,002)
2023112903544	S	USDMXN	03/14/2024	(244,042)	17.50854	4,272,820
2023120503574	B	USDMXN	03/14/2024	569,378	17.69413	(10,074,648)
2023120503577	B	USDMXN	03/14/2024	1,806,991	17.6983	(31,980,666)
2023120703640	S	USDMXN	03/14/2024	(467,948)	17.76396	8,312,610
2023121503367	B	USDMXN	03/14/2024	475,300	17.43114	(8,285,022)
2023121903853	B	USDMXN	03/14/2024	2,034,409	17.30838	(35,212,319)
2024010303292	B	USDMXN	03/14/2024	290,259	17.24026	(5,004,143)
2024010303522	BO	USDMXN	03/14/2024	16,317	17.24842	(281,439)
2024010903394	B	USDMXN	03/14/2024	1,901,700	17.14078	(32,596,607)
2024011603706	B	USDMXN	03/14/2024	2,104,112	17.36856	(36,545,392)
2024020203172	BO	USDMXN	03/14/2024	500,000	17.15949	(8,579,745)
2024021203576	BO	USDMXN	03/14/2024	29,360	17.15999	(503,817)
2024021603680	BO	USDMXN	03/14/2024	31,746	17.09905	(542,826)
2024022903968	BO	USDMXN	03/14/2024	396,418	17.07587	(6,769,182)
2024030103469	BO	USDMXN	03/14/2024	50,000	17.03683	(851,842)
2024030403873	S	USDMXN	03/14/2024	(1,500,000)	16.98339	25,475,092
2024030503087	S	USDMXN	03/14/2024	(50,000,000)	16.9671	848,355,000
2024030503089	S	USDMXN	03/14/2024	(50,000,000)	16.9691	848,455,000
2024031203043	B	USDMXN	03/14/2024	1,000,000	16.81669	(16,816,690)
2024031203047	B	USDMXN	03/14/2024	1,000,000	16.81273	(16,812,730)
2024031203478	B	USDMXN	03/14/2024	2,731	16.834	(45,970)
2024031203485	B	USDMXN	03/14/2024	2,000,000	16.82	(33,640,000)
2024031203149	S	USDMXN	03/14/2024	(2,000,000)	16.838	33,676,000
2024031203334	S	USDMXN	03/14/2024	(1,000,000)	16.83604	16,836,040
2024031203610	S	USDMXN	03/14/2024	(5,000,000)	16.8	84,000,000
2024031203612	S	USDMXN	03/14/2024	(2,000,000)	16.8	33,600,000
2024031203615	S	USDMXN	03/14/2024	(3,000,000)	16.8	50,400,000
2024031203620	S	USDMXN	03/14/2024	(1,000,000)	16.8	16,800,000
2024031203623	S	USDMXN	03/14/2024	(4,000,000)	16.8	67,200,000
2024031203642	S	USDMXN	03/14/2024	(5,000,000)	16.8	84,000,000
2024031203688	S	USDMXN	03/14/2024	(1,000,000)	16.8	16,800,000
2024031203699	S	USDMXN	03/14/2024	(1,784,000)	16.79371	29,959,979
2023031003628	SO	USDMXN	03/15/2024	(175,000)	19.80779	3,466,364
2023031003753	S	USDMXN	03/15/2024	(31,200)	19.8044	617,897
2023031403143	SO	USDMXN	03/15/2024	(175,000)	20.47881	3,583,792
2023071303102	BO	USDMXN	03/15/2024	384,522	17.72009	(6,813,764)
2023090703385	SO	USDMXN	03/15/2024	(31,200)	18.11871	565,304
2023091403456	B	USDMXN	03/15/2024	384,522	17.63054	(6,779,332)
2023110603389	B	USDMXN	03/15/2024	350,000	17.90969	(6,268,391)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023111403252	BO	USDMXN	03/15/2024	460,000	17.76118	(8,170,145)
2023111603387	B	USDMXN	03/15/2024	250,000	17.59674	(4,399,186)
2023121903360	B	USDMXN	03/15/2024	2,044,494	17.31588	(35,402,222)
2023121903602	B	USDMXN	03/15/2024	1,813,042	17.3164	(31,395,359)
2024011103420	BO	USDMXN	03/15/2024	63,017	17.13811	(1,079,992)
2024011703447	BO	USDMXN	03/15/2024	141,000	17.44412	(2,459,621)
2024030403443	BO	USDMXN	03/15/2024	400,000	16.98734	(6,794,937)
2024030403937	BO	USDMXN	03/15/2024	50,000	16.99068	(849,534)
2024030603545	SO	USDMXN	03/15/2024	(67,664)	16.90043	1,143,550
2024030603552	SO	USDMXN	03/15/2024	(18,280)	16.90443	309,013
2024031303111	B	USDMXN	03/15/2024	20,000,000	16.753	(335,060,000)
2024031303201	B	USDMXN	03/15/2024	1,000,000	16.74933	(16,749,330)
2024031303255	B	USDMXN	03/15/2024	60,000,000	16.735	(1,004,100,000)
2024031303546	B	USDMXN	03/15/2024	250,000	16.7229	(4,180,725)
2024031303647	B	USDMXN	03/15/2024	3,000,000	16.685	(50,055,000)
2024031303649	B	USDMXN	03/15/2024	400,000	16.68567	(6,674,268)
2024031303655	B	USDMXN	03/15/2024	3,000,000	16.68	(50,040,000)
2024031303657	B	USDMXN	03/15/2024	2,000,000	16.68	(33,360,000)
2024031303187	S	USDMXN	03/15/2024	(50,000,000)	16.7485	837,425,000
2024031303230	S	USDMXN	03/15/2024	(1,000,000)	16.73675	16,736,750
2024031303490	S	USDMXN	03/15/2024	(100,000)	16.68663	1,668,663
2024031303735	S	USDMXN	03/15/2024	(1,000,000)	16.66269	16,662,690
2024031303736	S	USDMXN	03/15/2024	(20,000)	16.6628	333,256
2024031403532	S	USDMXN	03/15/2024	(50,000,000)	16.70074	835,037,190
2024031503336	S	USDMXN	03/15/2024	(50,000,000)	16.68	834,000,000
2023071203630	BO	USDMXN	03/19/2024	38,462	17.68014	(680,006)
2023091103591	B	USDMXN	03/19/2024	100,000	17.89121	(1,789,121)
2023100403338	SO	USDMXN	03/19/2024	(232,371)	18.50407	4,299,810
2023102703305	SO	USDMXN	03/19/2024	(232,606)	18.48903	4,300,659
2023110703159	SO	USDMXN	03/19/2024	(239,822)	17.93372	4,300,901
2023122203612	BO	USDMXN	03/19/2024	50,000	17.20278	(860,139)
2024011203164	S	USDMXN	03/19/2024	(30,000,000)	17.036	511,080,000
2024020803378	SO	USDMXN	03/19/2024	(203,158)	17.23164	3,500,746
2024022803646	SO	USDMXN	03/19/2024	(440,000)	17.15311	7,547,369
2024022903230	B	USDMXN	03/19/2024	30,000,000	17.10802	(513,240,450)
2024022903676	SO	USDMXN	03/19/2024	(141,000)	17.08641	2,409,184
2024030103471	BO	USDMXN	03/19/2024	185,000	17.05073	(3,154,384)
2024031203528	SO	USDMXN	03/19/2024	(5,000,000)	16.81976	84,098,815
2024031303826	B	USDMXN	03/19/2024	500,000	16.67625	(8,338,125)
2024031403042	B	USDMXN	03/19/2024	1,000,000	16.69698	(16,696,980)
2024031403044	B	USDMXN	03/19/2024	1,000,000	16.69975	(16,699,750)
2024031403274	B	USDMXN	03/19/2024	5,000,000	16.685	(83,425,000)
2024031403533	B	USDMXN	03/19/2024	50,000,000	16.7113	(835,565,000)
2024031403644	B	USDMXN	03/19/2024	293,000	16.7215	(4,899,400)
2024031403647	B	USDMXN	03/19/2024	143,000	16.7214	(2,391,160)
2024031403074	S	USDMXN	03/19/2024	(30,000,000)	16.699	500,970,000
2024031403082	S	USDMXN	03/19/2024	(1,000,000)	16.69606	16,696,060
2024031403083	S	USDMXN	03/19/2024	(1,000,000)	16.6956	16,695,600
2024031403193	S	USDMXN	03/19/2024	(20,000,000)	16.70003	334,000,600
2024031403303	S	USDMXN	03/19/2024	(30,000,000)	16.679	500,370,000
2024031403439	S	USDMXN	03/19/2024	(2,000,000)	16.70244	33,404,880
2024031403511	S	USDMXN	03/19/2024	(1,500,000)	16.705	25,057,500
2024031403518	S	USDMXN	03/19/2024	(1,000,000)	16.71294	16,712,940
2024031403519	S	USDMXN	03/19/2024	(500,000)	16.71246	8,356,230
2024031503337	B	USDMXN	03/19/2024	50,000,000	16.69091	(834,545,500)
2023021003706	BO	USDMXN	03/20/2024	1,527,785	20.17515	(30,823,290)
2023100903442	BO	USDMXN	03/20/2024	56,496	18.69585	(1,056,241)
2023101203186	B	USDMXN	03/20/2024	1,225,927	18.39596	(22,552,104)
2024011203648	B	USDMXN	03/20/2024	58,910	17.0331	(1,003,420)
2024011603212	S	USDMXN	03/20/2024	(200,000)	17.31693	3,463,386
2024011703868	B	USDMXN	03/20/2024	92,654	17.39093	(1,611,340)
2024012203696	BO	USDMXN	03/20/2024	47,600	17.35071	(825,894)
2024012303348	B	USDMXN	03/20/2024	218,909	17.53755	(3,839,132)
2024012303683	B	USDMXN	03/20/2024	126,649	17.47659	(2,213,393)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024020603827	BO	USDMXN	03/20/2024	52,000	17.18025	(893,373)
2024020903027	B	USDMXN	03/20/2024	109,656,777	17.19	(1,885,000,000)
2024020903036	SO	USDMXN	03/20/2024	(1,621,472)	17.20156	27,891,852
2024020903137	S	USDMXN	03/20/2024	(50,000,000)	17.2055	860,275,000
2024021403204	BO	USDMXN	03/20/2024	60,000	17.19197	(1,031,518)
2024021403244	B	USDMXN	03/20/2024	30,000,000	17.203	(516,090,000)
2024021403419	BO	USDMXN	03/20/2024	35,900	17.19965	(617,468)
2024021403420	BO	USDMXN	03/20/2024	35,900	17.20005	(617,482)
2024021403728	BO	USDMXN	03/20/2024	42,550	17.1931	(731,566)
2024021403249	S	USDMXN	03/20/2024	(30,000,000)	17.203	516,090,000
2024021503358	S	USDMXN	03/20/2024	(20,000,000)	17.1625	343,250,000
2024021503749	S	USDMXN	03/20/2024	(20,000,000)	17.1625	343,250,000
2024021603669	BO	USDMXN	03/20/2024	95,200	17.11742	(1,629,578)
2024021603833	BO	USDMXN	03/20/2024	41,700	17.13611	(714,576)
2024022103679	BO	USDMXN	03/20/2024	38,400	17.12483	(657,594)
2024022103680	BO	USDMXN	03/20/2024	38,400	17.12453	(657,582)
2024022603576	BO	USDMXN	03/20/2024	55,200	17.16392	(947,448)
2024022703514	BO	USDMXN	03/20/2024	114,000	17.12361	(1,952,092)
2024030603615	BO	USDMXN	03/20/2024	69,600	16.9228	(1,177,827)
2024031503042	B	USDMXN	03/20/2024	1,000,000	16.69739	(16,697,390)
2024031503179	B	USDMXN	03/20/2024	30,000,000	16.713	(501,390,000)
2024031503031	S	USDMXN	03/20/2024	(1,000,000)	16.72418	16,724,180
2024031503181	S	USDMXN	03/20/2024	(30,000,000)	16.713	501,390,000
2024031503334	S	USDMXN	03/20/2024	(100,000,000)	16.695	1,669,500,000
2024031503664	S	USDMXN	03/20/2024	(5,000,000)	17.0045	85,022,500
2024031503753	S	USDMXN	03/20/2024	(500,000)	16.7048	8,352,400
2023021403576	BO	USDMXN	03/21/2024	3,600,000	19.9998	(71,999,273)
2023110303616	BO	USDMXN	03/21/2024	51,918	17.83258	(925,832)
2023110803442	BO	USDMXN	03/21/2024	14,650	17.92512	(262,603)
2023111603442	BO	USDMXN	03/21/2024	500,000	17.59516	(8,797,581)
2023112903166	BO	USDMXN	03/21/2024	2,660	17.50592	(46,566)
2024010303523	BO	USDMXN	03/21/2024	3,734	17.26722	(64,476)
2024012303642	S	USDMXN	03/21/2024	(50,000)	17.47583	873,791
2024021603681	BO	USDMXN	03/21/2024	14,680	17.11885	(251,305)
2024021603746	B	USDMXN	03/21/2024	20,000,000	17.1327	(342,654,000)
2024022603146	BO	USDMXN	03/21/2024	69,162	17.18688	(1,188,685)
2024022603613	BO	USDMXN	03/21/2024	161,247	17.15755	(2,766,603)
2024022703812	BO	USDMXN	03/21/2024	13,348	17.11979	(228,515)
2024031903166	B	USDMXN	03/21/2024	1,000,000	16.86346	(16,863,460)
2024031903242	B	USDMXN	03/21/2024	2,000,000	16.83783	(33,675,660)
2024031903778	B	USDMXN	03/21/2024	50,000,000	16.83	(841,500,000)
2024031903797	B	USDMXN	03/21/2024	50,000,000	16.82	(841,000,000)
2024031903927	B	USDMXN	03/21/2024	1,000,000	16.80639	(16,806,390)
2024031903186	S	USDMXN	03/21/2024	(2,000,000)	16.85439	33,708,780
2024031903668	S	USDMXN	03/21/2024	(1,000,000)	16.8339	16,833,900
2024031903749	S	USDMXN	03/21/2024	(3,000,000)	16.81566	50,446,980
2024031903789	S	USDMXN	03/21/2024	(50,000,000)	16.82	841,000,000
2024031903793	S	USDMXN	03/21/2024	(1,000,000)	16.825	16,825,000
2023031003732	S	USDMXN	03/22/2024	(31,200)	19.79272	617,533
2023090703386	SO	USDMXN	03/22/2024	(31,200)	18.14071	565,990
2023092503064	SO	USDMXN	03/22/2024	(200,000)	17.88156	3,576,311
2023101703452	B	USDMXN	03/22/2024	300,000	18.4167	(5,525,009)
2023121503370	S	USDMXN	03/22/2024	(405,263)	17.45395	7,073,439
2024011103424	BO	USDMXN	03/22/2024	63,017	17.15812	(1,081,253)
2024011203748	B	USDMXN	03/22/2024	200,000	17.04591	(3,409,181)
2024030103716	SO	USDMXN	03/22/2024	(286,000)	17.0614	4,879,560
2024032003038	B	USDMXN	03/22/2024	1,000,000	16.80869	(16,808,690)
2024032003039	B	USDMXN	03/22/2024	1,000,000	16.80978	(16,809,780)
2024032003046	B	USDMXN	03/22/2024	1,000,000	16.80112	(16,801,120)
2024032003168	B	USDMXN	03/22/2024	1,000,000	16.78193	(16,781,930)
2024032003422	B	USDMXN	03/22/2024	1,000,000	16.6848	(16,684,800)
2024032003682	B	USDMXN	03/22/2024	123,000	16.68845	(2,052,679)
2024032003684	B	USDMXN	03/22/2024	834	16.68825	(13,915)
2024032003021	S	USDMXN	03/22/2024	(1,000,000)	16.83295	16,832,950

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024032003024	S	USDMXN	03/22/2024	(1,000,000)	16.83206	16,832,060
2024032003025	S	USDMXN	03/22/2024	(1,000,000)	16.83265	16,832,650
2024032003061	S	USDMXN	03/22/2024	(1,000,000)	16.78066	16,780,660
2024032003063	S	USDMXN	03/22/2024	(1,000,000)	16.77946	16,779,460
2024032003064	S	USDMXN	03/22/2024	(1,000,000)	16.77713	16,777,130
2024032003228	S	USDMXN	03/22/2024	(50,000,000)	16.7805	839,025,000
2024032003248	S	USDMXN	03/22/2024	(1,000,000)	16.7508	16,750,800
2024032003407	S	USDMXN	03/22/2024	(1,000,000)	16.68123	16,681,230
2024032003410	S	USDMXN	03/22/2024	(1,000,000)	16.69525	16,695,250
2024032003654	S	USDMXN	03/22/2024	(107,000)	16.67236	1,783,943
2024032003669	S	USDMXN	03/22/2024	(90,000)	16.6768	1,500,912
2024022103170	B	USDMXN	03/25/2024	20,000,000	17.138	(342,760,000)
2024022103261	B	USDMXN	03/25/2024	20,000,000	17.143	(342,860,000)
2024022903231	S	USDMXN	03/25/2024	(30,000,000)	17.12385	513,715,380
2024030603498	BO	USDMXN	03/25/2024	50,000	16.91748	(845,874)
2024031403512	SO	USDMXN	03/25/2024	(78,935)	16.72029	1,319,816
2023010603327	B	USDMXN	03/26/2024	1,274,293	20.68147	(26,354,247)
2023011303495	B	USDMXN	03/26/2024	637,147	20.26002	(12,908,609)
2023041803082	BO	USDMXN	03/26/2024	125,941	19.22637	(2,421,389)
2023041903028	BO	USDMXN	03/26/2024	1,489	19.32445	(28,774)
2023050203580	B	USDMXN	03/26/2024	254,858	19.17813	(4,887,700)
2023050303552	B	USDMXN	03/26/2024	127,429	19.04815	(2,427,286)
2023050503586	B	USDMXN	03/26/2024	127,429	18.94576	(2,414,240)
2023071203629	BO	USDMXN	03/26/2024	38,462	17.70124	(680,817)
2023072003385	SO	USDMXN	03/26/2024	(255,280)	17.63843	4,502,746
2023091103589	B	USDMXN	03/26/2024	100,000	17.91401	(1,791,401)
2023100303167	SO	USDMXN	03/26/2024	(249,485)	18.44361	4,601,405
2023101003373	S	USDMXN	03/26/2024	(249,106)	18.50243	4,609,071
2023122203606	BO	USDMXN	03/26/2024	50,000	17.22261	(861,131)
2024012403212	B	USDMXN	03/26/2024	30,000,000	17.3585	(520,755,000)
2024021303259	SO	USDMXN	03/26/2024	(652,651)	17.32346	11,306,173
2024022603582	BO	USDMXN	03/26/2024	31,520	17.17932	(541,492)
2024022703271	SO	USDMXN	03/26/2024	(659,777)	17.12911	11,301,393
2024032203287	B	USDMXN	03/26/2024	300,000	16.73785	(5,021,355)
2024032203442	B	USDMXN	03/26/2024	25,000	16.7335	(418,338)
2024032203762	B	USDMXN	03/26/2024	221,023	16.75978	(3,704,297)
2024032203519	S	USDMXN	03/26/2024	(297,000)	16.74783	4,974,106
2024032203520	S	USDMXN	03/26/2024	(12,000)	16.74781	200,974
2024032203720	S	USDMXN	03/26/2024	(1,000,000)	16.75163	16,751,630
2022110103590	B	USDMXN	03/27/2024	4,230,000	21.59236	(91,335,679)
2023031003727	B	USDMXN	03/27/2024	31,200	19.84106	(619,041)
2023031003629	SO	USDMXN	03/27/2024	(125,000)	19.84603	2,480,754
2023031003875	S	USDMXN	03/27/2024	(62,400)	19.82566	1,237,121
2023031403154	SO	USDMXN	03/27/2024	(125,000)	20.51629	2,564,536
2023051503285	B	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	18.68718	(18,687,182)
2023061403059	BO	USDMXN	03/27/2024	500,000	18.09722	(9,048,609)
2023062703047	BO	USDMXN	03/27/2024	600,000	17.93463	(10,760,778)
2023070303478	B	USDMXN	03/27/2024	192,800	17.90389	(3,451,870)
2023071403662	BO	USDMXN	03/27/2024	250,000	17.535	(4,383,750)
2023072103314	B	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	17.73851	(17,738,510)
2023081003156	BO	USDMXN	03/27/2024	400,000	17.64901	(7,059,603)
2023090703387	SO	USDMXN	03/27/2024	(31,200)	18.15723	566,506
2023091303520	B	USDMXN	03/27/2024	48,200	17.73396	(854,777)
2023100903443	BO	USDMXN	03/27/2024	56,496	18.71788	(1,057,485)
2023101703213	B	USDMXN	03/27/2024	573,593	18.43387	(10,573,541)
2023110303614	BO	USDMXN	03/27/2024	59,438	17.85142	(1,061,053)
2023110603391	B	USDMXN	03/27/2024	250,000	17.94749	(4,486,873)
2023110803443	BO	USDMXN	03/27/2024	14,650	17.94269	(262,860)
2023111603443	BO	USDMXN	03/27/2024	500,000	17.61279	(8,806,395)
2023112103154	BO	USDMXN	03/27/2024	150,000	17.54401	(2,631,601)
2023112103442	B	USDMXN	03/27/2024	800,000	17.59739	(14,077,910)
2023112903803	B	USDMXN	03/27/2024	165,400	17.59439	(2,910,112)
2023121303980	BO	USDMXN	03/27/2024	280,000	17.56555	(4,918,354)
2023121403824	BO	USDMXN	03/27/2024	350,000	17.47134	(6,114,968)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023121503636	BO	USDMXN	03/27/2024	2,253	17.50988	(39,447)
2023122203614	BO	USDMXN	03/27/2024	100,000	17.23292	(1,723,292)
2023122703377	BON	USDMXN	03/27/2024	69,893,413	17.169	(1,200,000,000)
2024010303294	B	USDMXN	03/27/2024	3,833,616	17.27823	(66,238,078)
2024010303533	SO	USDMXN	03/27/2024	(31,349)	17.27779	541,638
2024010503602	BO	USDMXN	03/27/2024	1,198,154	17.1246	(20,517,909)
2024010803598	BO	USDMXN	03/27/2024	250,000	17.03925	(4,259,812)
2024011003370	BO	USDMXN	03/27/2024	48,000	17.20371	(825,778)
2024011103427	BO	USDMXN	03/27/2024	63,017	17.17251	(1,082,160)
2024011603210	S	USDMXN	03/27/2024	(200,000)	17.33736	3,467,473
2024012303681	B	USDMXN	03/27/2024	126,649	17.49615	(2,215,870)
2024012603402	S	USDMXN	03/27/2024	(30,000,000)	17.346	520,380,000
2024012903237	B	USDMXN	03/27/2024	30,000,000	17.38	(521,400,000)
2024012903579	BO	USDMXN	03/27/2024	31,400	17.39432	(546,182)
2024012903626	SO	USDMXN	03/27/2024	(263,886)	17.39708	4,590,847
2024020903482	BO	USDMXN	03/27/2024	485,876	17.20439	(8,359,199)
2024021403205	BO	USDMXN	03/27/2024	60,000	17.21332	(1,032,799)
2024021603670	BO	USDMXN	03/27/2024	95,200	17.13804	(1,631,541)
2024021903484	BO	USDMXN	03/27/2024	76,000	17.14395	(1,302,940)
2024022003650	BO	USDMXN	03/27/2024	19,200	17.17195	(329,701)
2024022103678	BO	USDMXN	03/27/2024	17,400	17.15196	(298,444)
2024022203665	BO	USDMXN	03/27/2024	737,500	17.19339	(12,680,128)
2024022603144	BO	USDMXN	03/27/2024	109,400	17.20235	(1,881,937)
2024022603145	BO	USDMXN	03/27/2024	50,800	17.20245	(873,885)
2024022603609	BO	USDMXN	03/27/2024	161,247	17.17305	(2,769,103)
2024022903260	BO	USDMXN	03/27/2024	58,800	17.12309	(1,006,838)
2024031103573	BO	USDMXN	03/27/2024	38,396	16.8443	(646,754)
2024032003670	B	USDMXN	03/27/2024	90,000	16.69064	(1,502,158)
2024032503095	B	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	16.71074	(16,710,740)
2024032503105	B	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	16.70659	(16,706,590)
2024032503233	BO	USDMXN	03/27/2024	0	16.714	(31,801,503)
2024032503232	SON	USDMXN	03/27/2024	(69,893,413)	17.169	1,200,000,000
2024032503393	S	USDMXN	03/27/2024	(68,685,250)	16.71	1,147,730,525
2024032503659	S	USDMXN	03/27/2024	(500,000)	16.67695	8,338,475
2024032503660	S	USDMXN	03/27/2024	(300,000)	16.67685	5,003,055
2024032503698	S	USDMXN	03/27/2024	(5,000,000)	16.685	83,425,000
2024032503817	S	USDMXN	03/27/2024	(37,097)	16.68065	618,804
2023122803804	S	EURMXN	01/02/2024	(50,000)	18.7782	938,910
2023122903032	B	EURMXN	01/02/2024	962,139	18.6838	(17,976,423)
2023122903034	S	EURMXN	01/02/2024	(962,139)	18.67855	17,971,369
2023122903035	B	EURMXN	01/03/2024	962,139	18.6828	(17,975,456)
2023122903033	S	EURMXN	01/03/2024	(962,139)	18.6867	17,979,209
2024010203338	B	EURMXN	01/03/2024	3,550,000	18.64313	(66,183,124)
2024010203339	S	EURMXN	01/04/2024	(3,550,000)	18.6468	66,196,140
2023122803805	B	EURMXN	01/16/2024	50,000	18.83342	(941,671)
2024030703644	S	USDJPY	03/11/2024	(15,000,000)	148.031	2,220,465,000
2023022303522	B	USDMXN	01/02/2024	30,000,000	19.4975	(584,925,000)
2023092803108	B	USDMXN	01/02/2024	20,000,000	17.936	(358,720,000)
2023122703340	SON	USDMXN	01/02/2024	(70,880,095)	16.93	1,200,000,000
2023122803066	S	USDMXN	01/02/2024	(244,892)	16.9069	4,140,357
2023122803069	S	USDMXN	01/02/2024	(32,000,000)	16.9348	541,913,600
2023122803153	S	USDMXN	01/02/2024	(50,000,000)	16.908	845,400,000
2023122903036	B	USDMXN	01/02/2024	962,139	16.90184	(16,261,922)
2023122903103	B	USDMXN	01/02/2024	60,000,000	16.904	(1,014,240,000)
2024010203259	S	USDMXN	01/02/2024	(1,700,000)	17.02	28,934,000
2023122903300	B	USDMXN	01/03/2024	80,000,000	16.91	(1,352,800,000)
2023122903534	B	USDMXN	01/03/2024	10,000,000	16.942	(169,420,000)
2023122903536	B	USDMXN	01/03/2024	10,000,000	16.955	(169,550,000)
2023122903037	S	USDMXN	01/03/2024	(962,139)	16.9038	16,263,810
2023122903104	S	USDMXN	01/03/2024	(60,000,000)	16.9064	1,014,384,000
2023122903298	S	USDMXN	01/03/2024	(80,000,000)	16.91	1,352,800,000
2024010203260	B	USDMXN	01/03/2024	1,700,000	17.0226	(28,938,420)
2024010203038	S	USDMXN	01/03/2024	(787,861)	17.00129	13,394,644
2024010203330	S	USDMXN	01/03/2024	(41,000,000)	17.037	698,517,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024013103949	B	USDMXN	01/03/2024	35,000,000	16.92	(592,200,000)
2024010203039	B	USDMXN	01/04/2024	787,861	17.0041	(13,396,862)
2024010203331	B	USDMXN	01/04/2024	41,000,000	17.03975	(698,629,750)
2024010203606	S	USDMXN	01/04/2024	(10,000,000)	17.047	170,470,000
2024010203609	S	USDMXN	01/04/2024	(10,000,000)	17.04	170,400,000
2024010303154	B	USDMXN	01/04/2024	212,139	17.03732	(3,614,285)
2022100703382	B	USDMXN	01/05/2024	1,825,000	21.68558	(39,576,184)
2024010303172	B	USDMXN	01/05/2024	30,000,000	17.045	(511,350,000)
2024010303155	S	USDMXN	01/05/2024	(212,139)	17.04	3,614,854
2024010303176	S	USDMXN	01/05/2024	(20,000,000)	17.045	340,900,000
2024010303388	S	USDMXN	01/05/2024	(15,000,000)	17.041	255,615,000
2024010303390	S	USDMXN	01/05/2024	(15,000,000)	17.04	255,600,000
2024010403020	B	USDMXN	01/05/2024	387,139	17.02684	(6,591,758)
2023100403244	S	USDMXN	01/08/2024	(30,000,000)	18.2355	547,065,000
2023110303875	B	USDMXN	01/08/2024	30,000,000	17.633	(528,990,000)
2023121103243	SO	USDMXN	01/08/2024	(177,000)	17.50602	3,098,565
2024010403021	S	USDMXN	01/08/2024	(387,139)	17.0349	6,594,879
2024010503033	B	USDMXN	01/08/2024	387,139	16.96431	(6,567,552)
2024010503455	B	USDMXN	01/09/2024	7,997,398	16.91	(135,236,000)
2024010503034	S	USDMXN	01/09/2024	(387,139)	16.9669	6,568,554
2024010503472	S	USDMXN	01/09/2024	(7,997,398)	16.91	135,236,000
2024010803009	B	USDMXN	01/09/2024	384,537	16.89755	(6,497,738)
2024010803169	B	USDMXN	01/09/2024	7,000,000	16.885	(118,195,000)
2023070603388	B	USDMXN	01/10/2024	5,000,000	17.939	(89,695,000)
2023110303559	SO	USDMXN	01/10/2024	(34,000,000)	17.5939	598,192,600
2023110803005	B	USDMXN	01/10/2024	30,000,000	17.7075	(531,225,000)
2024010803313	B	USDMXN	01/10/2024	40,000,000	16.795	(671,800,000)
2024010803505	B	USDMXN	01/10/2024	50,000,000	16.83	(841,500,000)
2024010803708	B	USDMXN	01/10/2024	50,000,000	16.81	(840,500,000)
2024010803010	S	USDMXN	01/10/2024	(384,537)	16.9002	6,498,757
2024010803170	S	USDMXN	01/10/2024	(7,000,000)	16.88775	118,214,250
2024010803318	S	USDMXN	01/10/2024	(40,000,000)	16.795	671,800,000
2024010803501	S	USDMXN	01/10/2024	(50,000,000)	16.83	841,500,000
2024010903001	S	USDMXN	01/10/2024	(515,463)	16.8759	8,698,900
2024010903129	S	USDMXN	01/10/2024	(19,000,000)	16.88	320,720,000
2024011003039	S	USDMXN	01/10/2024	(30,000,000)	16.988	509,640,000
2024010903002	B	USDMXN	01/11/2024	515,463	16.8789	(8,700,443)
2024010903108	B	USDMXN	01/11/2024	50,000,000	16.9	(845,000,000)
2024010903130	B	USDMXN	01/11/2024	19,000,000	16.88273	(320,771,775)
2024010903627	B	USDMXN	01/11/2024	10,000,000	16.971	(169,710,000)
2024010903110	S	USDMXN	01/11/2024	(30,000,000)	16.897	506,910,000
2024010903221	S	USDMXN	01/11/2024	(50,000,000)	16.933	846,650,000
2024010903400	S	USDMXN	01/11/2024	(50,000,000)	16.98	849,000,000
2024011003005	B	USDMXN	01/11/2024	484,537	16.96054	(8,218,015)
2024011003040	B	USDMXN	01/11/2024	30,000,000	16.99078	(509,723,250)
2024011003192	B	USDMXN	01/11/2024	10,000,000	16.98035	(169,803,475)
2024011103249	S	USDMXN	01/11/2024	(30,000,000)	16.991	509,730,000
2022101303133	B	USDMXN	01/12/2024	1,825,000	21.80993	(39,803,122)
2023010403186	B	USDMXN	01/12/2024	50,000,000	20.6615	(1,033,075,000)
2023010403179	S	USDMXN	01/12/2024	(50,000,000)	20.669	1,033,450,000
2023011003126	S	USDMXN	01/12/2024	(3,000,000)	20.415	61,245,000
2023101003361	S	USDMXN	01/12/2024	(20,000,000)	18.275	365,500,000
2024010503473	B	USDMXN	01/12/2024	7,993,475	16.9183	(135,236,000)
2024010503456	S	USDMXN	01/12/2024	(7,993,475)	16.9183	135,236,000
2024011003001	S	USDMXN	01/12/2024	(4,000,000)	16.97	67,880,000
2024011003006	S	USDMXN	01/12/2024	(484,537)	16.9632	8,219,303
2024011003060	S	USDMXN	01/12/2024	(30,000,000)	17	510,000,000
2024011003193	S	USDMXN	01/12/2024	(10,000,000)	16.983	169,830,000
2024011003401	S	USDMXN	01/12/2024	(30,000,000)	16.99	509,700,000
2024011103045	B	USDMXN	01/12/2024	186,156	17.03605	(3,171,358)
2024011103127	B	USDMXN	01/12/2024	70,000,000	17.01	(1,190,700,000)
2024011103250	B	USDMXN	01/12/2024	30,000,000	16.99373	(509,811,750)
2023111303268	S	USDMXN	01/16/2024	(30,000,000)	17.8262	534,786,000
2023111403275	B	USDMXN	01/16/2024	30,000,000	17.5615	(526,845,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023111403717	B	USDMXN	01/16/2024	30,000,000	17.5615	(526,845,000)
2023121303489	B	USDMXN	01/16/2024	30,000,000	17.5015	(525,045,000)
2023122803673	BO	USDMXN	01/16/2024	1,000,000	16.98759	(16,987,592)
2023122803674	BO	USDMXN	01/16/2024	2,000,000	16.98624	(33,972,486)
2023122803677	BO	USDMXN	01/16/2024	476,043	16.98779	(8,086,919)
2023122803689	BO	USDMXN	01/16/2024	2,000,000	16.98624	(33,972,486)
2023122803358	SO	USDMXN	01/16/2024	(275,000)	16.94631	4,660,235
2024011103649	B	USDMXN	01/16/2024	10,000,000	16.94	(169,400,000)
2024011103652	B	USDMXN	01/16/2024	10,000,000	16.937	(169,370,000)
2024011103046	S	USDMXN	01/16/2024	(186,156)	17.0464	3,173,285
2024011103128	S	USDMXN	01/16/2024	(70,000,000)	17.021	1,191,470,000
2024011103134	S	USDMXN	01/16/2024	(15,000,000)	17.005	255,075,000
2024011203201	B	USDMXN	01/16/2024	186,156	16.84656	(3,136,084)
2024011203637	B	USDMXN	01/16/2024	45,000,000	16.85	(758,250,000)
2024011503071	S	USDMXN	01/16/2024	(84,000,000)	16.9	1,419,600,000
2023011203400	B	USDMXN	01/17/2024	7,000,000	20.145	(141,015,000)
2023122903049	SO	USDMXN	01/17/2024	(91,779)	16.93247	1,554,046
2024011203032	B	USDMXN	01/17/2024	186,156	16.8792	(3,142,159)
2024011203485	B	USDMXN	01/17/2024	50,000,000	16.857	(842,850,000)
2024011203653	B	USDMXN	01/17/2024	50,000,000	16.8545	(842,725,000)
2024011203202	S	USDMXN	01/17/2024	(186,156)	16.8493	3,136,593
2024011203638	S	USDMXN	01/17/2024	(45,000,000)	16.85275	758,373,750
2024011503072	B	USDMXN	01/17/2024	84,000,000	16.9029	(1,419,843,600)
2024011603008	B	USDMXN	01/17/2024	891,667	17.05126	(15,204,045)
2023091403593	B	USDMXN	01/18/2024	40,000,000	17.453	(698,120,000)
2023122803515	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96457	(33,929,142)
2023122803517	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96517	(33,930,342)
2023122803518	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96487	(33,929,740)
2023122803541	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96457	(33,929,142)
2023122803543	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96517	(33,930,342)
2023122803546	BO	USDMXN	01/18/2024	2,000,000	16.96487	(33,929,740)
2023122803554	BO	USDMXN	01/18/2024	338,891	16.97138	(5,751,448)
2024010903109	S	USDMXN	01/18/2024	(50,000,000)	16.9195	845,975,000
2024011603006	S	USDMXN	01/18/2024	(50,000,000)	17.07	853,500,000
2024011603009	S	USDMXN	01/18/2024	(891,667)	17.0541	15,206,575
2024011603052	S	USDMXN	01/18/2024	(10,000,000)	17.07	170,700,000
2024011603281	S	USDMXN	01/18/2024	(30,000,000)	17.19	515,700,000
2024011603729	S	USDMXN	01/18/2024	(10,000,000)	17.21	172,100,000
2024011703051	B	USDMXN	01/18/2024	32,095	17.34318	(556,621)
2024011703200	S	USDMXN	01/18/2024	(20,000,000)	17.325	346,500,000
2024011703204	S	USDMXN	01/18/2024	(14,000,000)	17.317	242,438,000
2023051703110	S	USDMXN	01/19/2024	(10,000,000)	18.492	184,920,000
2024011703201	B	USDMXN	01/19/2024	20,000,000	17.3279	(346,558,000)
2024011703205	B	USDMXN	01/19/2024	14,000,000	17.31995	(242,479,300)
2024011703052	S	USDMXN	01/19/2024	(32,095)	17.346	556,711
2024011703368	S	USDMXN	01/19/2024	(10,000,000)	17.2475	172,475,000
2024011803002	B	USDMXN	01/19/2024	32,095	17.20195	(552,088)
2024011803554	B	USDMXN	01/19/2024	27,300,000	17.198	(469,505,400)
2023080303676	B	USDMXN	01/22/2024	19,950,000	17.515	(349,424,250)
2023122003422	S	USDMXN	01/22/2024	(40,000,000)	17.1425	685,700,000
2024011803168	B	USDMXN	01/22/2024	1,928,357	17.19	(33,148,453)
2024011803363	B	USDMXN	01/22/2024	50,000,000	17.222	(861,100,000)
2024011803558	B	USDMXN	01/22/2024	10,000,000	17.189	(171,890,000)
2024011803003	S	USDMXN	01/22/2024	(32,095)	17.2104	552,359
2024011803555	S	USDMXN	01/22/2024	(27,300,000)	17.20655	469,738,815
2024011903030	B	USDMXN	01/22/2024	103,738	17.1535	(1,779,465)
2024011903285	B	USDMXN	01/22/2024	34,000,000	17.115	(581,910,000)
2024011903316	B	USDMXN	01/22/2024	258,908	17.11868	(4,432,157)
2024011903436	B	USDMXN	01/22/2024	84,000,000	17.11	(1,437,240,000)
2024011903267	S	USDMXN	01/22/2024	(84,258,908)	17.12	1,442,512,500
2023082403078	S	MXNUSD	01/23/2024	(798,840,560)	17.24291	46,328,633
2023082403074	S	USDMXN	01/23/2024	(46,336,459)	17.24	798,840,560
2023122003185	B	USDMXN	01/23/2024	76,881,564	17.14	(1,317,750,000)
2024011903350	B	USDMXN	01/23/2024	50,000,000	17.164	(858,200,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024011903354	B	USDMXN	01/23/2024	30,000,000	17.12	(513,600,000)
2024011903386	B	USDMXN	01/23/2024	80,000,000	17.12	(1,369,600,000)
2024011903440	B	USDMXN	01/23/2024	188,000	17.10713	(3,216,140)
2024011903671	B	USDMXN	01/23/2024	30,000,000	17.11	(513,300,000)
2024011903031	S	USDMXN	01/23/2024	(103,738)	17.1563	1,779,755
2024011903275	S	USDMXN	01/23/2024	(82,735,411)	17.12	1,416,430,240
2024011903286	S	USDMXN	01/23/2024	(34,000,000)	17.11788	582,007,750
2024011903317	S	USDMXN	01/23/2024	(258,908)	17.1215	4,432,888
2024011903437	S	USDMXN	01/23/2024	(84,000,000)	17.1128	1,437,475,200
2024011903815	S	USDMXN	01/23/2024	(82,735,411)	17.12	1,416,430,240
2024012203065	B	USDMXN	01/23/2024	255,984	17.08091	(4,372,430)
2023082303232	B	USDMXN	01/24/2024	25,000,000	17.275	(431,875,000)
2023082303343	B	USDMXN	01/24/2024	30,000,000	17.276	(518,280,000)
2023082303185	S	USDMXN	01/24/2024	(54,320,000)	17.277	938,486,640
2024011203033	S	USDMXN	01/24/2024	(186,156)	16.89804	3,145,666
2024012203066	S	USDMXN	01/24/2024	(255,984)	17.0837	4,373,145
2024012303003	B	USDMXN	01/24/2024	4,862,139	17.27831	(84,009,561)
2024012303008	B	USDMXN	01/24/2024	3,951,930	17.295	(68,348,630)
2024012303011	S	USDMXN	01/24/2024	(3,951,930)	17.29296	68,340,578
2024012303012	B	USDMXN	01/25/2024	3,951,930	17.2959	(68,352,187)
2024012303552	B	USDMXN	01/25/2024	4,614,941	17.335	(80,000,000)
2024012303004	S	USDMXN	01/25/2024	(4,862,139)	17.2811	84,023,114
2024012303009	S	USDMXN	01/25/2024	(3,951,267)	17.2979	68,348,630
2024012303192	S	USDMXN	01/25/2024	(10,000,000)	17.33	173,300,000
2024012303325	S	USDMXN	01/25/2024	(30,000,000)	17.356	520,680,000
2024012303565	S	USDMXN	01/25/2024	(30,000,000)	17.343	520,290,000
2024012403009	B	USDMXN	01/25/2024	246,536	17.19314	(4,238,724)
2024012403260	B	USDMXN	01/25/2024	101,000,000	17.1635	(1,733,513,500)
2022102803496	B	USDMXN	01/26/2024	1,825,000	21.4785	(39,198,263)
2024012303553	S	USDMXN	01/26/2024	(4,614,169)	17.3379	80,000,000
2024012403010	S	USDMXN	01/26/2024	(246,536)	17.1959	4,239,405
2024012403261	S	USDMXN	01/26/2024	(101,000,000)	17.16633	1,733,798,825
2024012403323	S	USDMXN	01/26/2024	(15,000,000)	17.162	257,430,000
2024012503028	B	USDMXN	01/26/2024	35,705	17.1807	(613,433)
2024012503257	B	USDMXN	01/26/2024	78,000,000	17.2375	(1,344,525,000)
2024012503338	B	USDMXN	01/26/2024	100,000,000	17.215	(1,721,500,000)
2023102503095	BON	USDMXN	01/29/2024	200,000,000	18.6306	(3,726,120,000)
2023102503070	SON	USDMXN	01/29/2024	(200,000,000)	18.6312	3,726,240,000
2023110903087	B	USDMXN	01/29/2024	20,300,000	17.71255	(359,564,745)
2023112203338	S	USDMXN	01/29/2024	(30,000,000)	17.392	521,760,000
2023112203514	S	USDMXN	01/29/2024	(30,000,000)	17.3715	521,145,000
2023112703431	S	USDMXN	01/29/2024	(30,000,000)	17.319	519,570,000
2024011903268	B	USDMXN	01/29/2024	84,160,589	17.14	(1,442,512,500)
2024012503206	BON	USDMXN	01/29/2024	200,000,000	18.6312	(3,726,240,000)
2024012503209	BO	USDMXN	01/29/2024	0	17.2475	(276,620,000)
2024012503429	B	USDMXN	01/29/2024	6,000,000	17.232	(103,392,000)
2024012503029	S	USDMXN	01/29/2024	(35,705)	17.1891	613,733
2024012503208	SO	USDMXN	01/29/2024	0	17.2475	276,740,000
2024012503207	SON	USDMXN	01/29/2024	(200,000,000)	18.6306	3,726,120,000
2024012503258	S	USDMXN	01/29/2024	(78,000,000)	17.24605	1,345,191,900
2024012503339	S	USDMXN	01/29/2024	(100,000,000)	17.22355	1,722,355,000
2024012603032	B	USDMXN	01/29/2024	575,115	17.14394	(9,859,744)
2024012603409	B	USDMXN	01/29/2024	115,000,000	17.165	(1,973,975,000)
2023122203618	BO	USDMXN	01/30/2024	400,000	17.0793	(6,831,721)
2024011903276	B	USDMXN	01/30/2024	82,638,870	17.14	(1,416,430,240)
2024011903816	B	USDMXN	01/30/2024	82,638,388	17.1401	(1,416,430,240)
2024011903387	S	USDMXN	01/30/2024	(80,000,000)	17.1403	1,371,224,000
2024012603164	B	USDMXN	01/30/2024	70,000,000	17.18	(1,202,600,000)
2024012603033	S	USDMXN	01/30/2024	(575,115)	17.1467	9,861,333
2024012603155	S	USDMXN	01/30/2024	(30,000,000)	17.182	515,460,000
2024012603159	S	USDMXN	01/30/2024	(30,000,000)	17.18	515,400,000
2024012603410	S	USDMXN	01/30/2024	(115,000,000)	17.16783	1,974,299,875
2024012903290	B	USDMXN	01/30/2024	50,000,000	17.225	(861,250,000)
2024012903291	S	USDMXN	01/31/2024	(50,000,000)	17.22785	861,392,500

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024010903222	B	USDMXN	02/01/2024	50,000,000	16.9922	(849,610,000)
2023110103540	BON	USDMXN	02/06/2024	50,000,000	18.173	(908,650,000)
2023110103541	BON	USDMXN	02/06/2024	50,000,000	18.173	(908,650,000)
2023110103542	BON	USDMXN	02/06/2024	50,000,000	18.173	(908,650,000)
2023110103546	SON	USDMXN	02/06/2024	(150,000,000)	18.173	2,725,950,000
2023122003508	BO	USDMXN	02/06/2024	5,400,000	17.20065	(92,883,533)
2023122903301	S	USDMXN	02/06/2024	(80,000,000)	17.002	1,360,160,000
2024020103202	BO	USDMXN	02/06/2024	0	17.118	(52,750,000)
2024020103205	BO	USDMXN	02/06/2024	0	17.118	(52,750,000)
2024020103206	BO	USDMXN	02/06/2024	0	17.118	(52,750,000)
2024020103204	BON	USDMXN	02/06/2024	150,000,000	18.173	(2,725,950,000)
2024020103200	SON	USDMXN	02/06/2024	(50,000,000)	18.173	908,650,000
2024020103201	SON	USDMXN	02/06/2024	(50,000,000)	18.173	908,650,000
2024020103203	SON	USDMXN	02/06/2024	(50,000,000)	18.173	908,650,000
2024020103207	SO	USDMXN	02/06/2024	0	17.118	158,250,000
2023110303743	B	USDMXN	02/07/2024	30,000,000	17.7075	(531,225,000)
2023110303560	SO	USDMXN	02/07/2024	(40,000,000)	17.5939	703,756,000
2023120503047	B	USDMXN	02/07/2024	50,000,000	17.664	(883,200,000)
2024020603594	B	USDMXN	02/07/2024	100,000	17.05353	(1,705,353)
2023120603178	B	USDMXN	02/08/2024	50,000,000	17.445	(872,250,000)
2023120703108	B	USDMXN	02/08/2024	100,000,000	17.51	(1,751,000,000)
2024010803437	S	USDMXN	02/08/2024	(100,000,000)	16.915	1,691,500,000
2024020603595	S	USDMXN	02/08/2024	(100,000)	17.0563	1,705,630
2024020603685	S	USDMXN	02/08/2024	(40,000,000)	17.05	682,000,000
2024020703009	B	USDMXN	02/08/2024	100,000	17.05773	(1,705,773)
2024020703469	B	USDMXN	02/08/2024	58,000,000	17.07	(990,060,000)
2024020703010	S	USDMXN	02/09/2024	(100,000)	17.0605	1,706,050
2024020703203	S	USDMXN	02/09/2024	(30,000,000)	17.06	511,800,000
2024020703470	S	USDMXN	02/09/2024	(58,000,000)	17.0728	990,222,400
2024020703471	S	USDMXN	02/09/2024	(10,000,000)	17.06	170,600,000
2024020703473	S	USDMXN	02/09/2024	(10,000,000)	17.068	170,680,000
2024020803003	B	USDMXN	02/09/2024	100,000	17.08944	(1,708,944)
2024020803180	B	USDMXN	02/09/2024	123,000,000	17.08	(2,100,840,000)
2023091103126	B	USDMXN	02/12/2024	39,230,000	17.93216	(703,478,770)
2023091103156	B	USDMXN	02/12/2024	30,000,000	17.941	(538,230,000)
2023091103066	S	USDMXN	02/12/2024	(69,230,000)	17.95	1,242,678,500
2023120703189	S	USDMXN	02/12/2024	(50,000,000)	17.5288	876,440,000
2023120703216	S	USDMXN	02/12/2024	(50,000,000)	17.5288	876,440,000
2024010803502	B	USDMXN	02/12/2024	50,000,000	16.9222	(846,110,000)
2024010803314	S	USDMXN	02/12/2024	(40,000,000)	16.887	675,480,000
2024010903401	B	USDMXN	02/12/2024	50,000,000	17.0695	(853,475,000)
2024011803169	S	USDMXN	02/12/2024	(1,921,627)	17.2502	33,148,453
2024020803004	S	USDMXN	02/12/2024	(100,000)	17.0975	1,709,750
2024020803181	S	USDMXN	02/12/2024	(123,000,000)	17.0882	2,101,848,600
2024020803710	S	USDMXN	02/12/2024	(10,000,000)	17.14	171,400,000
2024020903359	B	USDMXN	02/13/2024	24,000,000	17.1	(410,400,000)
2024020903363	S	USDMXN	02/13/2024	(20,000,000)	17.1	342,000,000
2024021203112	B	USDMXN	02/13/2024	21,627	17.07909	(369,372)
2024021203197	B	USDMXN	02/13/2024	66,000,000	17.055	(1,125,630,000)
2024021203113	S	USDMXN	02/14/2024	(21,627)	17.0818	369,431
2024021203198	S	USDMXN	02/14/2024	(66,000,000)	17.05778	1,125,813,150
2023111303603	B	USDMXN	02/15/2024	20,000,000	17.8735	(357,470,000)
2023121303407	B	USDMXN	02/15/2024	30,000,000	17.5925	(527,775,000)
2024020603602	BO	USDMXN	02/15/2024	500,000	17.09016	(8,545,082)
2024021303522	B	USDMXN	02/15/2024	50,000,000	17.185	(859,250,000)
2024021303631	B	USDMXN	02/15/2024	30,000,000	17.22	(516,600,000)
2024021403029	S	USDMXN	02/15/2024	(243,556)	17.1445	4,175,648
2024021403583	S	USDMXN	02/15/2024	(33,000,000)	17.114	564,762,000
2023121303400	BO	USDMXN	02/16/2024	1,169,791	17.59079	(20,577,552)
2024021403030	B	USDMXN	02/16/2024	243,556	17.1474	(4,176,355)
2024021403069	B	USDMXN	02/16/2024	20,000,000	17.15	(343,000,000)
2024021403292	B	USDMXN	02/16/2024	10,000,000	17.108	(171,080,000)
2024021403294	B	USDMXN	02/16/2024	10,000,000	17.108	(171,080,000)
2024021403584	B	USDMXN	02/16/2024	33,000,000	17.11685	(564,856,050)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024021503006	S	USDMXN	02/16/2024	(687,792)	17.05899	11,733,042
2024021503101	S	USDMXN	02/16/2024	(40,000,000)	17.083	683,320,000
2024021503106	S	USDMXN	02/16/2024	(53,000,000)	17.0765	905,054,500
2024021503147	S	USDMXN	02/16/2024	(10,000,000)	17.057	170,570,000
2024021503729	S	USDMXN	02/16/2024	(687,792)	17.05899	11,733,042
2024021503785	S	USDMXN	02/16/2024	(40,000,000)	17.083	683,320,000
2024021503805	S	USDMXN	02/16/2024	(53,000,000)	17.0765	905,054,500
2024021503837	S	USDMXN	02/16/2024	(10,000,000)	17.057	170,570,000
2024021503875	S	USDMXN	02/16/2024	(687,792)	17.05899	11,733,042
2023051703111	B	USDMXN	02/20/2024	10,000,000	18.603	(186,030,000)
2023121403515	B	USDMXN	02/20/2024	30,000,000	17.47	(524,100,000)
2023121503320	B	USDMXN	02/20/2024	40,000,000	17.3775	(695,100,000)
2024011203486	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000,000)	16.9515	847,575,000
2024011203654	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000,000)	16.949	847,450,000
2024011603007	B	USDMXN	02/20/2024	50,000,000	17.164	(858,200,000)
2024011603282	B	USDMXN	02/20/2024	30,000,000	17.285	(518,550,000)
2024012603165	S	USDMXN	02/20/2024	(70,000,000)	17.2401	1,206,807,000
2024021503007	B	USDMXN	02/20/2024	687,792	17.0706	(11,741,025)
2024021503102	B	USDMXN	02/20/2024	40,000,000	17.09445	(683,778,000)
2024021503107	B	USDMXN	02/20/2024	53,000,000	17.0879	(905,658,700)
2024021503124	B	USDMXN	02/20/2024	58,000,000	17.065	(989,770,000)
2024021503148	B	USDMXN	02/20/2024	10,000,000	17.0684	(170,684,000)
2024021503730	B	USDMXN	02/20/2024	687,792	17.0706	(11,741,025)
2024021503755	B	USDMXN	02/20/2024	58,000,000	17.065	(989,770,000)
2024021503786	B	USDMXN	02/20/2024	40,000,000	17.09445	(683,778,000)
2024021503806	B	USDMXN	02/20/2024	53,000,000	17.0879	(905,658,700)
2024021503838	B	USDMXN	02/20/2024	10,000,000	17.0684	(170,684,000)
2024021503876	B	USDMXN	02/20/2024	687,792	17.0706	(11,741,025)
2024021503126	S	USDMXN	02/20/2024	(30,000,000)	17.065	511,950,000
2024021503245	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000,000)	17.06	853,000,000
2024021503770	S	USDMXN	02/20/2024	(30,000,000)	17.065	511,950,000
2024021503823	S	USDMXN	02/20/2024	(50,000,000)	17.06	853,000,000
2024022003067	S	USDMXN	02/21/2024	(467,525)	17.00486	7,950,202
2024022003074	S	USDMXN	02/21/2024	(20,000,000)	17.01	340,200,000
2023122003424	B	USDMXN	02/22/2024	40,000,000	17.231	(689,240,000)
2024011803364	S	USDMXN	02/22/2024	(50,000,000)	17.311	865,550,000
2024022003068	B	USDMXN	02/22/2024	467,525	17.0079	(7,951,622)
2024022003075	B	USDMXN	02/22/2024	20,000,000	17.01288	(340,257,500)
2024022003254	B	USDMXN	02/22/2024	118,000	17.03845	(2,010,537)
2024022003658	B	USDMXN	02/22/2024	20,000,000	17.076	(341,520,000)
2024022003734	B	USDMXN	02/22/2024	30,000,000	17.07	(512,100,000)
2024022003391	S	USDMXN	02/22/2024	(20,000,000)	17.0435	340,870,000
2024022003818	S	USDMXN	02/22/2024	(1,000,000)	17.06018	17,060,180
2022111803095	S	USDMXN	02/23/2024	(3,000,000)	21.145	63,435,000
2024022003249	S	USDMXN	02/23/2024	(100,182,196)	17.053	1,708,406,986
2024022203127	B	USDMXN	02/23/2024	54,526	17.1407	(934,607)
2024022203151	B	USDMXN	02/23/2024	62,000,000	17.145	(1,062,990,000)
2023052403244	S	USDMXN	02/26/2024	(5,000,000)	18.78	93,900,000
2023082403731	B	USDMXN	02/26/2024	11,500,000	17.3026	(198,979,900)
2023121303076	S	USDMXN	02/26/2024	(52,616,024)	17.561	923,990,000
2024012303326	B	USDMXN	02/26/2024	30,000,000	17.4492	(523,476,000)
2024012303566	B	USDMXN	02/26/2024	30,000,000	17.436	(523,080,000)
2024022203128	S	USDMXN	02/26/2024	(54,526)	17.1488	935,049
2024022203152	S	USDMXN	02/26/2024	(62,000,000)	17.15335	1,063,507,700
2024022303000	B	USDMXN	02/26/2024	442,058	17.06926	(7,545,611)
2024022303518	B	USDMXN	02/26/2024	56,000,000	17.11	(958,160,000)
2023090403418	SO	USDMXN	02/27/2024	(100,000)	17.71512	1,771,512
2023112703441	BON	USDMXN	02/27/2024	50,000,000	17.389	(869,450,000)
2023112703453	SON	USDMXN	02/27/2024	(50,000,000)	17.39487	869,743,500
2024022303214	B	USDMXN	02/27/2024	10,000,000	17.148	(171,480,000)
2024022303217	B	USDMXN	02/27/2024	10,000,000	17.14	(171,400,000)
2024022303240	BO	USDMXN	02/27/2024	0	17.139	(12,500,000)
2024022303241	BON	USDMXN	02/27/2024	50,000,000	17.39487	(869,743,500)
2024022303001	S	USDMXN	02/27/2024	(442,058)	17.0719	7,546,777

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024022303239	SON	USDMXN	02/27/2024	(50,000,000)	17.389	869,450,000
2024022303243	SO	USDMXN	02/27/2024	0	17.139	12,793,500
2024022303510	S	USDMXN	02/27/2024	(20,000,000)	17.115	342,300,000
2024022303519	S	USDMXN	02/27/2024	(56,000,000)	17.1128	958,316,800
2024022603009	B	USDMXN	02/27/2024	193,514	17.09843	(3,308,783)
2024022603135	B	USDMXN	02/27/2024	31,000,000	17.099	(530,069,000)
2022022403648	B	USDMXN	02/28/2024	91,373	23.45739	(2,143,367)
2023122803702	SO	USDMXN	02/28/2024	(159,963)	17.0826	2,732,583
2024022603659	B	USDMXN	02/28/2024	10,000,000	17.088	(170,880,000)
2024022603010	S	USDMXN	02/28/2024	(193,514)	17.1012	3,309,319
2024022603136	S	USDMXN	02/28/2024	(31,000,000)	17.10183	530,156,575
2024022603649	S	USDMXN	02/28/2024	(10,000,000)	17.093	170,930,000
2024022703003	B	USDMXN	02/28/2024	127,384	17.06263	(2,173,508)
2024022703221	B	USDMXN	02/28/2024	42,000,000	17.062	(716,604,000)
2023052503567	B	USDMXN	02/29/2024	10,000,000	18.7885	(187,885,000)
2023082803416	S	USDMXN	02/29/2024	(10,000,000)	17.33	173,300,000
2024022303304	B	USDMXN	02/29/2024	20,000,000	17.135	(342,700,000)
2024022703724	B	USDMXN	02/29/2024	10,000,000	17.065	(170,650,000)
2024022703744	B	USDMXN	02/29/2024	10,000,000	17.07	(170,700,000)
2024022703004	S	USDMXN	02/29/2024	(127,384)	17.0654	2,173,861
2024022703068	S	USDMXN	02/29/2024	(50,000,000)	17.0645	853,225,000
2024022703222	S	USDMXN	02/29/2024	(42,000,000)	17.0648	716,721,600
2024022703717	S	USDMXN	02/29/2024	(30,000,000)	17.063	511,890,000
2024022803009	B	USDMXN	02/29/2024	656,638	17.08269	(11,217,150)
2024022803659	B	USDMXN	02/29/2024	100,000,000	17.1	(1,710,000,000)
2022022503135	B	USDMXN	03/01/2024	7,000,000	23.2475	(162,732,500)
2022022503138	B	USDMXN	03/01/2024	5,500,000	23.317	(128,243,500)
2024022003250	B	USDMXN	03/01/2024	100,064,252	17.0731	(1,708,406,986)
2024022803010	S	USDMXN	03/01/2024	(656,638)	17.0853	11,218,865
2024022803176	S	USDMXN	03/01/2024	(10,000,000)	17.105	171,050,000
2024022803198	S	USDMXN	03/01/2024	(50,000,000)	17.094	854,700,000
2024022803317	S	USDMXN	03/01/2024	(50,000,000)	17.094	854,700,000
2024022803660	S	USDMXN	03/01/2024	(100,000,000)	17.1027	1,710,270,000
2024022803790	S	USDMXN	03/01/2024	(30,000,000)	17.109	513,270,000
2024022903003	B	USDMXN	03/01/2024	406,306	17.08776	(6,942,864)
2024022903314	B	USDMXN	03/01/2024	75,000,000	17.065	(1,279,875,000)
2024022903685	B	USDMXN	03/01/2024	406,306	17.04205	(6,924,290)
2024022903688	B	USDMXN	03/01/2024	8,000,000	17.04165	(136,333,200)
2024022903691	S	USDMXN	03/01/2024	(406,306)	17.0396	6,923,295
2023113003221	B	USDMXN	03/04/2024	30,000,000	17.626	(528,780,000)
2023113003104	S	USDMXN	03/04/2024	(98,533,384)	17.7375	1,747,735,899
2023122803154	B	USDMXN	03/04/2024	50,000,000	17.0795	(853,975,000)
2023122903299	B	USDMXN	03/04/2024	80,000,000	17.077	(1,366,160,000)
2024022903232	B	USDMXN	03/04/2024	30,000,000	17.065	(511,950,000)
2024022903235	B	USDMXN	03/04/2024	30,000,000	17.061	(511,830,000)
2024022903692	B	USDMXN	03/04/2024	406,306	17.0479	(6,926,667)
2024022903839	B	USDMXN	03/04/2024	30,000,000	17.05	(511,500,000)
2024022903004	S	USDMXN	03/04/2024	(406,306)	17.0958	6,946,129
2024022903042	S	USDMXN	03/04/2024	(50,000,000)	17.075	853,750,000
2024022903315	S	USDMXN	03/04/2024	(75,000,000)	17.0732	1,280,490,000
2024022903686	S	USDMXN	03/04/2024	(406,306)	17.0501	6,927,561
2024022903689	S	USDMXN	03/04/2024	(8,000,000)	17.0497	136,397,600
2024022903835	S	USDMXN	03/04/2024	(45,000,000)	17.05	767,250,000
2024030103006	B	USDMXN	03/04/2024	743,188	17.03671	(12,661,487)
2024030103670	B	USDMXN	03/04/2024	19,000,000	17.023	(323,437,000)
2024021903442	SO	USDMXN	03/05/2024	(1,000,000)	17.074	17,073,996
2024021903443	SO	USDMXN	03/05/2024	(1,000,000)	17.0738	17,073,796
2024021903445	SO	USDMXN	03/05/2024	(1,000,000)	17.074	17,073,996
2024021903447	SO	USDMXN	03/05/2024	(1,000,000)	17.0738	17,073,796
2024030103597	B	USDMXN	03/05/2024	20,000,000	17.017	(340,340,000)
2024030103007	S	USDMXN	03/05/2024	(743,188)	17.0393	12,663,410
2024030103671	S	USDMXN	03/05/2024	(19,000,000)	17.0255	323,484,500
2024030403099	B	USDMXN	03/05/2024	645,529	17.00461	(10,976,962)
2024030403197	B	USDMXN	03/05/2024	106,000,000	16.996	(1,801,576,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024030503521	S	USDMXN	03/05/2024	(16,706,000)	16.94	282,999,640
2024030503523	S	USDMXN	03/05/2024	(14,994,000)	16.94	253,998,360
2024030503527	S	USDMXN	03/05/2024	(15,300,000)	16.94	259,182,000
2024022803150	S	USDMXN	03/06/2024	(21,450,000)	17.11483	367,113,061
2024030403100	S	USDMXN	03/06/2024	(645,529)	17.0071	10,978,568
2024030403198	S	USDMXN	03/06/2024	(106,000,000)	16.99858	1,801,848,950
2024030503024	B	USDMXN	03/06/2024	474,253	16.95436	(8,040,655)
2024030503083	B	USDMXN	03/06/2024	126,000,000	16.947	(2,135,322,000)
2024030503522	B	USDMXN	03/06/2024	16,706,000	16.9424	(283,039,734)
2024030503524	B	USDMXN	03/06/2024	14,994,000	16.9424	(254,034,346)
2024030503528	B	USDMXN	03/06/2024	15,300,000	16.9424	(259,218,720)
2023120503148	S	USDMXN	03/07/2024	(30,000,000)	17.6885	530,655,000
2024030503544	B	USDMXN	03/07/2024	30,000,000	16.93	(507,900,000)
2024030503549	B	USDMXN	03/07/2024	30,000,000	16.929	(507,870,000)
2024030503553	B	USDMXN	03/07/2024	15,000,000	16.935	(254,025,000)
2024030503574	B	USDMXN	03/07/2024	75,000,000	16.939	(1,270,425,000)
2024030503025	S	USDMXN	03/07/2024	(474,253)	16.9566	8,041,717
2024030503084	S	USDMXN	03/07/2024	(126,000,000)	16.9493	2,135,611,800
2024030503237	S	USDMXN	03/07/2024	(30,000,000)	16.9155	507,465,000
2024030603340	B	USDMXN	03/07/2024	24,000,000	16.865	(404,760,000)
2024030603038	S	USDMXN	03/07/2024	(632,506)	16.87036	10,670,598
2024030603353	S	USDMXN	03/07/2024	(48,000,000)	16.865	809,520,000
2023120603167	S	USDMXN	03/08/2024	(30,000,000)	17.535	526,050,000
2023120603179	S	USDMXN	03/08/2024	(50,000,000)	17.5252	876,260,000
2023120703109	S	USDMXN	03/08/2024	(100,000,000)	17.59	1,759,000,000
2024010403075	B	USDMXN	03/08/2024	50,000,000	17.249	(862,450,000)
2024010803438	B	USDMXN	03/08/2024	100,000,000	16.9965	(1,699,650,000)
2024022803199	B	USDMXN	03/08/2024	50,000,000	17.1136	(855,680,000)
2024022803318	B	USDMXN	03/08/2024	50,000,000	17.1136	(855,680,000)
2024030603039	B	USDMXN	03/08/2024	632,506	16.8729	(10,672,203)
2024030603354	B	USDMXN	03/08/2024	48,000,000	16.86748	(809,638,800)
2024030603341	S	USDMXN	03/08/2024	(24,000,000)	16.8675	404,820,000
2024030603342	S	USDMXN	03/08/2024	(100,000,000)	16.862	1,686,200,000
2024030603578	S	USDMXN	03/08/2024	(50,000,000)	16.887	844,350,000
2024030703004	B	USDMXN	03/08/2024	274,656	16.86723	(4,632,684)
2024030703027	B	USDMXN	03/08/2024	48,000,000	16.876	(810,048,000)
2024030703129	S	USDMXN	03/08/2024	(30,000,000)	16.912	507,360,000
2023120703190	B	USDMXN	03/11/2024	50,000,000	17.608	(880,400,000)
2023120703221	B	USDMXN	03/11/2024	50,000,000	17.608	(880,400,000)
2024010803506	S	USDMXN	03/11/2024	(50,000,000)	17.0015	850,075,000
2024010803709	S	USDMXN	03/11/2024	(50,000,000)	16.9818	849,090,000
2024020703204	B	USDMXN	03/11/2024	30,000,000	17.1477	(514,431,000)
2024030703130	B	USDMXN	03/11/2024	30,000,000	16.9195	(507,585,000)
2024030703005	S	USDMXN	03/11/2024	(274,656)	16.8746	4,634,710
2024030703028	S	USDMXN	03/11/2024	(48,000,000)	16.8835	810,408,000
2024030703087	S	USDMXN	03/11/2024	(100,000,000)	16.9	1,690,000,000
2024030703294	S	USDMXN	03/11/2024	(30,000,000)	16.887	506,610,000
2024030703368	S	USDMXN	03/11/2024	(10,000,000)	16.862	168,620,000
2024030703656	S	USDMXN	03/11/2024	(50,000,000)	16.863	843,150,000
2024030803201	B	USDMXN	03/11/2024	888,225	16.77944	(14,903,916)
2024030803696	B	USDMXN	03/11/2024	177,000,000	16.775	(2,969,175,000)
2024030803710	B	USDMXN	03/11/2024	177,000,000	16.815	(2,976,255,000)
2024030803728	S	USDMXN	03/11/2024	(177,000,000)	16.81	2,975,370,000
2024011003061	B	USDMXN	03/12/2024	30,000,000	17.169	(515,070,000)
2024030803636	B	USDMXN	03/12/2024	20,000,000	16.77	(335,400,000)
2024030803689	B	USDMXN	03/12/2024	50,000,000	16.775	(838,750,000)
2024030803698	B	USDMXN	03/12/2024	10,000,000	16.805	(168,050,000)
2024030803701	B	USDMXN	03/12/2024	20,000,000	16.81	(336,200,000)
2024030803729	B	USDMXN	03/12/2024	177,000,000	16.81248	(2,975,808,075)
2024030803202	S	USDMXN	03/12/2024	(888,225)	16.7818	14,906,015
2024030803686	S	USDMXN	03/12/2024	(26,000,000)	16.77	436,020,000
2024030803697	S	USDMXN	03/12/2024	(177,000,000)	16.77745	2,969,608,650
2024030803711	S	USDMXN	03/12/2024	(177,000,000)	16.81745	2,976,688,650
2024031103002	B	USDMXN	03/12/2024	621,206	16.80434	(10,438,966)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024031103290	B	USDMXN	03/12/2024	44,000,000	16.824	(740,256,000)
2024031103003	S	USDMXN	03/13/2024	(621,206)	16.8067	10,440,431
2024031103291	S	USDMXN	03/13/2024	(44,000,000)	16.82645	740,363,800
2024031103328	S	USDMXN	03/13/2024	(30,000,000)	16.8105	504,315,000
2024031203004	B	USDMXN	03/13/2024	883,270	16.82518	(14,861,187)
2024031203015	B	USDMXN	03/13/2024	20,000,000	16.82	(336,400,000)
2024022703069	B	USDMXN	03/14/2024	50,000,000	17.1036	(855,180,000)
2024031203483	B	USDMXN	03/14/2024	100,000	16.82315	(1,682,315)
2024031203526	B	USDMXN	03/14/2024	79,000,000	16.81	(1,327,990,000)
2024031203574	B	USDMXN	03/14/2024	30,000,000	16.815	(504,450,000)
2024031203629	B	USDMXN	03/14/2024	30,000,000	16.819	(504,570,000)
2024031203005	S	USDMXN	03/14/2024	(883,270)	16.8275	14,863,234
2024031203016	S	USDMXN	03/14/2024	(20,000,000)	16.82243	336,448,500
2024031203061	S	USDMXN	03/14/2024	(92,114,541)	16.828	1,550,103,493
2024031203474	S	USDMXN	03/14/2024	(10,000,000)	16.825	168,250,000
2024031203524	S	USDMXN	03/14/2024	(118,000,000)	16.81	1,983,580,000
2024031303055	B	USDMXN	03/14/2024	642,131	16.75346	(10,757,923)
2024031303103	B	USDMXN	03/14/2024	144,000,000	16.755	(2,412,720,000)
2023102503532	BO	USDMXN	03/15/2024	72,000	18.76116	(1,350,803)
2024021303632	S	USDMXN	03/15/2024	(30,000,000)	17.3024	519,072,000
2024030603343	B	USDMXN	03/15/2024	100,000,000	16.8799	(1,687,990,000)
2024031303185	B	USDMXN	03/15/2024	20,000,000	16.749	(334,980,000)
2024031303056	S	USDMXN	03/15/2024	(642,131)	16.7559	10,759,488
2024031303104	S	USDMXN	03/15/2024	(144,000,000)	16.7575	2,413,080,000
2024031403011	B	USDMXN	03/15/2024	642,131	16.72291	(10,738,302)
2024031403014	B	USDMXN	03/15/2024	194,267	16.71782	(3,247,727)
2024031503191	B	USDMXN	03/15/2024	130,000,000	16.705	(2,171,650,000)
2024031503188	S	USDMXN	03/15/2024	(130,000,000)	16.705	2,171,650,000
2023121403756	B	USDMXN	03/19/2024	30,000,000	17.461	(523,830,000)
2023121403516	S	USDMXN	03/19/2024	(30,000,000)	17.5455	526,365,000
2024030703088	B	USDMXN	03/19/2024	100,000,000	16.9206	(1,692,060,000)
2024030803690	S	USDMXN	03/19/2024	(50,000,000)	16.793	839,650,000
2024031403012	S	USDMXN	03/19/2024	(642,131)	16.7335	10,745,104
2024031403015	S	USDMXN	03/19/2024	(194,267)	16.7283	3,249,762
2024031403072	S	USDMXN	03/19/2024	(80,000,000)	16.697	1,335,760,000
2024031403293	S	USDMXN	03/19/2024	(40,000,000)	16.684	667,360,000
2024031403296	S	USDMXN	03/19/2024	(10,000,000)	16.685	166,850,000
2024031403298	S	USDMXN	03/19/2024	(10,000,000)	16.683	166,830,000
2024031403309	S	USDMXN	03/19/2024	(40,000,000)	16.683	667,320,000
2024031503064	B	USDMXN	03/19/2024	613,003	16.70346	(10,239,279)
2024031503189	B	USDMXN	03/19/2024	130,000,000	16.7156	(2,173,028,000)
2024031503540	B	USDMXN	03/19/2024	50,000,000	16.72	(836,000,000)
2024031503544	B	USDMXN	03/19/2024	60,000,000	16.703	(1,002,180,000)
2024031503192	S	USDMXN	03/19/2024	(130,000,000)	16.7156	2,173,028,000
2023070603186	B	USDMXN	03/20/2024	20,000,000	18.013	(360,260,000)
2023070603011	S	USDMXN	03/20/2024	(20,000,000)	17.90035	358,006,980
2023112103573	B	USDMXN	03/20/2024	20,000,000	17.5663	(351,326,000)
2023113003271	B	USDMXN	03/20/2024	30,000,000	17.6815	(530,445,000)
2023120403161	B	USDMXN	03/20/2024	30,000,000	17.6765	(530,295,000)
2024021303523	S	USDMXN	03/20/2024	(50,000,000)	17.2815	864,075,000
2024021503246	B	USDMXN	03/20/2024	50,000,000	17.1425	(857,125,000)
2024021503824	B	USDMXN	03/20/2024	50,000,000	17.1425	(857,125,000)
2024022303031	B	USDMXN	03/20/2024	50,000,000	17.1538	(857,690,000)
2024022803328	B	USDMXN	03/20/2024	30,000,000	17.1398	(514,194,000)
2024030403202	S	USDMXN	03/20/2024	(30,000,000)	17.038	511,140,000
2024030403321	S	USDMXN	03/20/2024	(30,000,000)	17.0075	510,225,000
2024030403740	S	USDMXN	03/20/2024	(30,000,000)	17.0025	510,075,000
2024030503540	S	USDMXN	03/20/2024	(50,000,000)	16.9625	848,125,000
2024031203055	S	USDMXN	03/20/2024	(50,000,000)	16.8263	841,315,000
2024031303404	S	USDMXN	03/20/2024	(80,000,000)	16.713	1,337,040,000
2024031503065	S	USDMXN	03/20/2024	(613,003)	16.706	10,240,834
2024031503193	S	USDMXN	03/20/2024	(20,000,000)	16.705	334,100,000
2024031503327	S	USDMXN	03/20/2024	(30,000,000)	16.693	500,790,000
2024031503541	S	USDMXN	03/20/2024	(50,000,000)	16.72265	836,132,500

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024031503545	S	USDMXN	03/20/2024	(60,000,000)	16.70565	1,002,339,000
2024031903271	B	USDMXN	03/20/2024	763,003	16.82607	(12,838,351)
2024031903376	B	USDMXN	03/20/2024	178,030,977	16.851	(3,000,000,000)
2024031903594	B	USDMXN	03/20/2024	34,951,341	16.852	(589,000,000)
2023031603226	B	USDMXN	03/21/2024	20,000,000	20.37	(407,400,000)
2023031603229	B	USDMXN	03/21/2024	30,000,000	20.37	(611,100,000)
2024031203062	B	USDMXN	03/21/2024	92,016,662	16.8459	(1,550,103,493)
2024031903674	B	USDMXN	03/21/2024	25,000,000	16.848	(421,200,000)
2024031903678	B	USDMXN	03/21/2024	25,000,000	16.848	(421,200,000)
2024031903272	S	USDMXN	03/21/2024	(763,003)	16.8287	12,840,355
2024031903377	S	USDMXN	03/21/2024	(178,001,400)	16.8538	3,000,000,000
2024031903595	S	USDMXN	03/21/2024	(34,945,535)	16.8548	589,000,000
2024031903684	S	USDMXN	03/21/2024	(20,000,000)	16.85	337,000,000
2024031903686	S	USDMXN	03/21/2024	(20,000,000)	16.85	337,000,000
2024031903688	S	USDMXN	03/21/2024	(10,000,000)	16.8445	168,445,000
2024031903690	S	USDMXN	03/21/2024	(30,000,000)	16.845	505,350,000
2024031903795	S	USDMXN	03/21/2024	(20,000,000)	16.817	336,340,000
2024032003026	B	USDMXN	03/21/2024	986,392	16.83271	(16,603,659)
2024032003035	B	USDMXN	03/21/2024	577,826	16.82645	(9,722,759)
2024032003431	B	USDMXN	03/21/2024	100,000,000	16.7225	(1,672,250,000)
2024032003022	S	USDMXN	03/21/2024	(100,000,000)	16.83	1,683,000,000
2024032003033	S	USDMXN	03/21/2024	(97,347,652)	16.83	1,638,360,986
2023122003186	S	USDMXN	03/22/2024	(76,139,712)	17.307	1,317,750,000
2023122203624	BO	USDMXN	03/22/2024	380,000	17.23295	(6,548,520)
2024032003023	B	USDMXN	03/22/2024	100,000,000	16.8328	(1,683,280,000)
2024032003034	B	USDMXN	03/22/2024	97,347,652	16.8328	(1,638,633,559)
2024032003123	B	USDMXN	03/22/2024	10,000,000	16.8	(168,000,000)
2024032003199	B	USDMXN	03/22/2024	30,000,000	16.78	(503,400,000)
2024032003027	S	USDMXN	03/22/2024	(986,392)	16.8354	16,606,309
2024032003036	S	USDMXN	03/22/2024	(577,826)	16.8292	9,724,350
2024032003197	S	USDMXN	03/22/2024	(30,000,000)	16.78	503,400,000
2024032003432	S	USDMXN	03/22/2024	(100,000,000)	16.7253	1,672,530,000
2024032103044	B	USDMXN	03/22/2024	135,773	16.746	(2,273,647)
2024032103223	B	USDMXN	03/22/2024	170,000,000	16.748	(2,847,160,000)
2024032103040	S	USDMXN	03/22/2024	(50,000,000)	16.76	838,000,000
2024032103333	S	USDMXN	03/22/2024	(80,000,000)	16.771	1,341,680,000
2023100503687	B	USDMXN	03/25/2024	19,288,000	18.4314	(355,504,843)
2023100503680	S	USDMXN	03/25/2024	(19,288,000)	18.8034	362,679,883
2023112103462	B	USDMXN	03/25/2024	20,000,000	17.5925	(351,850,000)
2024011903351	S	USDMXN	03/25/2024	(50,000,000)	17.3415	867,075,000
2024011903672	S	USDMXN	03/25/2024	(30,000,000)	17.2875	518,625,000
2024032103041	B	USDMXN	03/25/2024	50,000,000	16.76825	(838,412,500)
2024032103334	B	USDMXN	03/25/2024	80,000,000	16.77928	(1,342,342,000)
2024032103471	B	USDMXN	03/25/2024	50,000,000	16.773	(838,650,000)
2024032103473	B	USDMXN	03/25/2024	30,000,000	16.775	(503,250,000)
2024032103475	B	USDMXN	03/25/2024	30,000,000	16.775	(503,250,000)
2024032103512	B	USDMXN	03/25/2024	30,000,000	16.783	(503,490,000)
2024032103730	B	USDMXN	03/25/2024	100,000,000	16.74	(1,674,000,000)
2024032103045	S	USDMXN	03/25/2024	(135,773)	16.7542	2,274,761
2024032103224	S	USDMXN	03/25/2024	(170,000,000)	16.7563	2,848,571,000
2024032103671	S	USDMXN	03/25/2024	(30,000,000)	16.742	502,260,000
2024032103676	S	USDMXN	03/25/2024	(30,000,000)	16.742	502,260,000
2024032103680	S	USDMXN	03/25/2024	(40,000,000)	16.747	669,880,000
2024032103699	S	USDMXN	03/25/2024	(10,000,000)	16.747	167,470,000
2024032203099	B	USDMXN	03/25/2024	278,298	16.7302	(4,655,980)
2024032203116	B	USDMXN	03/25/2024	412,423	16.72174	(6,896,435)
2024032203591	B	USDMXN	03/25/2024	118,000,000	16.76	(1,977,680,000)
2024032203075	S	USDMXN	03/25/2024	(50,000,000)	16.71	835,500,000
2024032203113	S	USDMXN	03/25/2024	(58,412,423)	16.73	977,239,842
2023092203483	S	USDMXN	03/26/2024	(15,000,000)	17.705	265,575,000
2024032203076	B	USDMXN	03/26/2024	50,000,000	16.71265	(835,632,500)
2024032203114	B	USDMXN	03/26/2024	58,412,423	16.73265	(977,394,635)
2024032203100	S	USDMXN	03/26/2024	(278,298)	16.7327	4,656,678
2024032203117	S	USDMXN	03/26/2024	(412,423)	16.7242	6,897,450

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024032203592	S	USDMXN	03/26/2024	(118,000,000)	16.76256	1,977,982,080
2024032503101	B	USDMXN	03/26/2024	43,549	16.70326	(727,416)
2024032503123	B	USDMXN	03/26/2024	45,000,000	16.705	(751,725,000)
2024032503135	B	USDMXN	03/26/2024	694,039	16.7166	(11,601,963)
2024032503188	B	USDMXN	03/26/2024	58,000,000	16.72	(969,760,000)
2024032503086	S	USDMXN	03/26/2024	(50,000,000)	16.7	835,000,000
2024032503133	S	USDMXN	03/26/2024	(58,694,039)	16.71	980,777,385
2024032603110	S	USDMXN	03/26/2024	(20,000,000)	16.684	333,680,000
2023032403521	B	USDMXN	03/27/2024	27,000,000	19.861	(536,247,000)
2023052503568	S	USDMXN	03/27/2024	(10,000,000)	18.873	188,730,000
2023111603290	BO	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	17.66521	(17,665,210)
2023111603291	BO	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	17.67031	(17,670,310)
2023111603298	SO	USDMXN	03/27/2024	(2,000,000)	17.675	35,350,000
2023111603301	SO	USDMXN	03/27/2024	(2,000,000)	17.675	35,350,000
2023122603245	BO	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	17.22658	(17,226,579)
2023122603247	BO	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	17.22728	(17,227,279)
2023122603248	BO	USDMXN	03/27/2024	402,182	17.22798	(6,928,791)
2023122703037	B	USDMXN	03/27/2024	348,391,592	17.222	(6,000,000,000)
2023122703080	S	USDMXN	03/27/2024	(100,000,000)	17.1975	1,719,750,000
2023122703082	S	USDMXN	03/27/2024	(100,000,000)	17.1975	1,719,750,000
2023122703084	S	USDMXN	03/27/2024	(100,000,000)	17.2185	1,721,850,000
2023122803290	B	USDMXN	03/27/2024	333,875,276	17.222	(5,750,000,000)
2023122803297	B	USDMXN	03/27/2024	14,516,316	17.222	(250,000,000)
2023122803314	B	USDMXN	03/27/2024	333,875,276	17.222	(5,750,000,000)
2024012903241	B	USDMXN	03/27/2024	30,000,000	17.38	(521,400,000)
2024030703627	BO	USDMXN	03/27/2024	387,000	16.91002	(6,544,178)
2024032503087	B	USDMXN	03/27/2024	50,000,000	16.70265	(835,132,500)
2024032503134	B	USDMXN	03/27/2024	58,694,039	16.71263	(980,931,457)
2024032503383	B	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	16.69225	(16,692,250)
2024032503384	B	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	16.69226	(16,692,260)
2024032503385	B	USDMXN	03/27/2024	1,000,000	16.69173	(16,691,730)
2024032503535	B	USDMXN	03/27/2024	30,000,000	16.692	(500,760,000)
2024032503539	B	USDMXN	03/27/2024	50,000,000	16.694	(834,700,000)
2024032503544	B	USDMXN	03/27/2024	65,364,568	16.691	(1,091,000,000)
2024032503600	B	USDMXN	03/27/2024	30,000,000	16.69	(500,700,000)
2024032503603	B	USDMXN	03/27/2024	150,000,000	16.69	(2,503,500,000)
2024032503102	S	USDMXN	03/27/2024	(43,549)	16.7059	727,530
2024032503124	S	USDMXN	03/27/2024	(45,000,000)	16.70763	751,843,125
2024032503136	S	USDMXN	03/27/2024	(694,039)	16.7191	11,603,701
2024032503189	S	USDMXN	03/27/2024	(58,000,000)	16.72263	969,912,250
2024032503372	S	USDMXN	03/27/2024	(281,437,126)	16.7	4,700,000,000
2024032503414	S	USDMXN	03/27/2024	(284,431,138)	16.7	4,750,000,000
2024032503818	S	USDMXN	03/27/2024	(50,000,000)	16.68	834,000,000
2024032603111	B	USDMXN	03/27/2024	20,000,000	16.68658	(333,731,500)
2024032603120	B	USDMXN	03/27/2024	156,613	16.66431	(2,609,845)
2024032603000	S	USDMXN	03/27/2024	(50,000,000)	16.69	834,500,000
2024032603072	S	USDMXN	03/27/2024	(108,944,930)	16.675	1,816,656,707
2024032603116	S	USDMXN	03/27/2024	(108,944,930)	16.66208	1,815,248,594
2024032703219	B	USDMXN	03/27/2024	323,893	16.51516	(5,349,140)
2024032703206	S	USDMXN	03/27/2024	(75,323,893)	16.595	1,250,000,000
2024032703328	S	USDMXN	03/27/2024	(75,323,893)	16.595	1,250,000,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2103509	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103512	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103653	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103656	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104038	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104086	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104291	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104293	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104294	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104296	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104321	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104323	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104324	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104326	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105024	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105026	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105027	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105028	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105030	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105031	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105032	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105034	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105035	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105036	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105038	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105039	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105200	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105202	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105203	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105204	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105206	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105207	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105208	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105210	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105211	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105212	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105214	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105215	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105958	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105961	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105964	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105967	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105970	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106258	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106261	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106264	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106267	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106270	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106522	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106524	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106534	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106536	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106614	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106616	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106617	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106650	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106652	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106653	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2107866	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107868	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107878	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107880	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2108098	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108100	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108101	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108102	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108104	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108105	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108106	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108108	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108109	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108110	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108112	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108113	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108114	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108116	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108117	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108178	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108180	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108181	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108182	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108184	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108185	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108186	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108188	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108189	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108190	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108192	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108193	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108194	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108196	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108197	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108608	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108609	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108632	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108633	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108678	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108680	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108681	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108683	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108702	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108704	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108705	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108707	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2108751	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108752	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108753	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,056
2108755	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108756	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108757	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,056
2108946	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108948	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108994	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108996	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109040	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109042	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109061	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109063	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109105	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109107	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109123	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109125	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109194	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109195	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109196	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109200	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109201	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109202	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109206	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109207	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109208	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109212	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109213	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109214	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109218	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109219	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109220	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109274	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109275	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109276	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109277	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109279	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109281	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109283	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109284	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109285	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109287	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109288	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109289	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109291	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109292	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109293	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109295	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109296	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109297	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109331	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109332	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109333	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109335	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109336	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109337	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109339	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109340	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109341	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109343	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109344	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109345	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109396	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109397	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109398	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109399	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109401	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109403	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109424	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109426	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109436	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109438	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109502	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109504	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109505	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,568
2109510	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109512	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109513	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,568
2109595	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109596	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109597	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109619	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109620	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109621	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109639	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109640	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109657	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109658	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109671	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109683	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109703	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109704	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109705	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,907
2109727	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109728	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109729	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,907
2109870	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109872	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109873	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,250
2109874	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109876	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109877	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,417
2109878	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109880	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109881	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2109883	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109884	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109885	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2109886	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109888	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109889	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,444
2109950	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109952	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109953	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,250
2109954	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109956	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109957	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,417
2109958	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109960	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109961	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2109963	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109964	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109965	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,000
2109966	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109968	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109969	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,444
2109986	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109988	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109989	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2109990	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109992	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109993	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2109995	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109996	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109997	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110178	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110180	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110181	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110182	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110184	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110185	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110187	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110188	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110189	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110369	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110371	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110375	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110377	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110441	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110443	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110447	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110449	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110510	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110512	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110535	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110537	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110668	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110670	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110671	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110673	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110674	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110676	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110677	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110679	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110695	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110697	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110698	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110700	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110701	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110703	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110704	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110706	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2111171	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2111173	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2111174	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111176	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111177	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111179	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111180	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111182	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111183	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111185	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111218	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111220	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111258	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111260	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111261	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,097
2111262	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111264	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111265	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,097
2111266	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111268	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111269	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,935
2111270	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111272	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111273	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,935
2111274	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111276	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111277	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,935
2111318	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111320	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111321	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,097
2111322	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111324	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111325	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,097
2111326	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111328	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111329	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,935
2111330	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111332	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111333	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,935
2111334	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111336	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111337	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,935
2111356	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111358	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111376	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111378	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111380	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111382	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111384	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111396	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111398	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111400	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111402	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111404	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111432	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111434	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111435	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111436	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111438	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111439	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111440	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111442	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111443	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111444	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111446	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111447	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111448	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111450	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111451	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111536	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111538	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111539	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111540	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111542	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111543	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111544	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111546	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111547	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111548	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111550	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111551	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111552	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111554	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111555	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111640	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2111642	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2111646	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2111648	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2111652	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111654	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111655	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111657	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111658	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111659	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111660	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111682	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111684	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111685	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111687	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111688	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111689	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111690	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111747	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2111749	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2111756	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2111758	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2111762	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111764	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2111765	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,872
2111786	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2111788	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2111789	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,872
2111842	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111844	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111875	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111877	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111908	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111909	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111914	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111915	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2112015	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112016	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112017	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,040
2112047	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112048	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112049	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,040
2112070	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112072	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112088	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112090	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112164	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112166	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112167	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112169	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112170	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112172	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112173	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112175	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112218	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112220	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112221	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112223	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112224	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112226	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112227	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112229	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2113277	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113278	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113279	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113280	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113281	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113282	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113283	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113284	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113285	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113286	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113287	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113288	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113289	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113290	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113291	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113292	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113293	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113295	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113296	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113297	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113298	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113299	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113300	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113301	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113522	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2113523	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113524	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113525	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113526	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113527	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113528	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113529	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113530	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113531	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113532	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113533	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113534	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113535	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113536	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113537	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113538	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113540	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113541	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113542	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113543	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113544	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113545	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113546	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2114993	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2114994	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2114995	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2114996	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2114997	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2114998	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2114999	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115000	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115001	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115002	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115003	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115004	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115005	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115006	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115007	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115008	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115009	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115011	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115012	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115013	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115014	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115015	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115016	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115017	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115238	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115239	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115240	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115241	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115242	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115243	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115244	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115245	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115246	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115247	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115248	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115249	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115250	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115251	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115252	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115253	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115254	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115256	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115257	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115258	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115259	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115260	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115261	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115262	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115483	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115484	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115485	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115486	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115487	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115538	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115539	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115540	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115541	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115542	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115596	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115597	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115601	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115602	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115603	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115604	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115606	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115607	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115608	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115609	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115611	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115612	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115696	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115697	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115701	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115702	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115703	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115704	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115706	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115707	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115708	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115709	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115711	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115712	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115798	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115799	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115803	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115804	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115918	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115919	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115923	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115924	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2116029	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116031	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116038	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116040	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116057	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116059	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116060	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116062	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116063	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116065	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116066	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116067	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116068	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116069	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116071	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116204	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116206	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116207	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116209	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116210	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116212	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116213	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116214	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116215	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116216	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116218	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116363	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116364	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116366	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116367	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116423	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116424	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116426	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116427	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116531	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116532	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116533	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116535	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116536	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116538	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116539	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116541	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116542	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116618	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116619	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116620	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116622	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116623	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116625	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116626	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116628	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116629	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116955	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2116956	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116958	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116959	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2117015	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2117016	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117018	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117019	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2117136	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117137	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117139	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117140	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117141	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117142	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117144	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117145	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117146	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117147	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117149	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117150	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117386	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117387	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117389	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117390	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117391	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117392	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117394	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117395	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117396	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117397	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117399	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117400	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117636	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117638	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117639	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117640	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117642	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117643	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117644	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117646	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117647	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117836	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117838	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117839	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117840	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117842	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117843	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117844	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117846	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117847	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118197	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118199	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118200	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118201	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118203	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118204	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118393	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118395	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118396	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118397	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118399	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118400	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2103508	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103510	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103511	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103513	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103652	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103654	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103655	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103657	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2104037	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104039	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104040	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104085	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104087	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104088	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104292	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104295	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104322	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104325	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105025	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105029	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105033	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105037	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105201	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105205	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105209	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105213	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105957	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105959	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105960	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105962	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105963	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105965	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105966	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105968	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105969	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105971	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106257	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106259	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106260	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106262	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106263	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106265	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106266	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106268	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106269	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106271	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106523	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106525	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106535	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106537	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106615	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106651	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107867	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2107879	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2108099	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108103	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108107	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108111	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108115	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108179	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108183	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108187	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108191	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108195	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108679	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108682	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108703	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108706	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108750	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2108754	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2108945	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108947	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108993	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108995	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109041	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109062	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109106	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109124	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109278	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109280	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109282	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109286	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109290	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109294	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109330	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109334	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109338	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109342	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109400	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109402	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2109425	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109437	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109503	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109511	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109594	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109618	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109638	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109656	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109670	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109682	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109702	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109726	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109871	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109875	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109879	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109882	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109887	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109951	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109955	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109959	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109962	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109967	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109987	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109991	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109994	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110179	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110183	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110186	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110370	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110376	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110442	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110448	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110511	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110536	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110669	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110672	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110675	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110678	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110696	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110699	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110702	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110705	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2111172	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2111175	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111178	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111181	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111184	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111219	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111259	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111263	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111267	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111271	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111275	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111319	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111323	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111327	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111331	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111335	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111357	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111377	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111379	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111381	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111383	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111385	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111397	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111399	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111401	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111403	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111405	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111433	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111437	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111441	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111445	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111449	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111537	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111541	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111545	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111549	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111553	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111641	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2111647	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2111653	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111656	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111683	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111686	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111748	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2111757	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2111763	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2111787	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2111843	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111876	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112014	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112046	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112071	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112089	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112165	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112168	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112171	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112174	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112219	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112222	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112225	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112228	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2113294	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113539	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115010	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115255	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115593	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115594	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115595	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115598	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115599	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115600	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115605	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115610	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115693	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115694	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115695	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115698	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115699	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115700	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115705	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115710	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115795	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115796	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115797	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115800	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115801	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115802	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115915	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115916	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115917	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115920	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115921	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115922	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116030	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2116039	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2116058	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116061	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116064	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116070	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116205	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116208	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116211	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116217	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116365	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116425	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116534	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116537	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116540	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116621	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116624	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116627	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116957	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2117017	FX	ene-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2117138	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117143	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117148	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117388	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117393	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117398	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117637	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117641	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117645	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117837	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117841	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117845	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118198	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118202	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118394	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118398	FX	ene-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112176	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112178	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112230	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112232	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116709	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116710	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116727	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116728	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2112177	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112231	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105040	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105042	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105043	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105216	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105218	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105219	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2109999	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110000	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110001	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110191	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110192	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110193	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110513	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110515	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110538	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110540	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110680	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110682	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110707	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110709	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2115613	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115614	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115616	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115617	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115713	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115714	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115716	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115717	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2105041	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105217	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2109998	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110190	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110514	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110539	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110681	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110708	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2115615	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115715	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2105973	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106273	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109890	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109892	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109893	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,444
2109970	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109972	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109973	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,444
2111278	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111280	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111281	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,774
2111338	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111340	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111341	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,774
2111386	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111406	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111452	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111454	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111455	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111556	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111558	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111559	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111845	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111847	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111878	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111880	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112073	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112075	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112091	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112093	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2113302	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113303	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113304	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113305	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113306	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113547	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113548	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113549	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113550	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113551	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115018	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115019	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115020	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115021	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115022	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115263	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115264	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115265	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115266	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115267	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2116072	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116074	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116219	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116221	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116543	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116544	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116545	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116630	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116631	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116632	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118792	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,952
2118793	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118794	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118795	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118796	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,401
2118847	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,952
2118848	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118849	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118850	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118851	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,401
2105972	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105974	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106272	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106274	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109891	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109971	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111279	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111339	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111387	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111407	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111453	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111557	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111846	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111879	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112074	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112092	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2116073	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116220	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108118	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108120	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108121	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108198	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108200	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108201	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2109299	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109300	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109301	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109347	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109348	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109349	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2111750	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2111752	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2111759	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2111761	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117151	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117152	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117154	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117155	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117401	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117402	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117404	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117405	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117650	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117651	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117850	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117851	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118207	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118208	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118403	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118404	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2108119	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108199	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2109298	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109346	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111751	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2111760	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2117153	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117403	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117648	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117649	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117848	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117849	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118205	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118206	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118401	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118402	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116712	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116730	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116711	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2116729	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2106526	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106538	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2112179	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112181	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112233	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112235	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106527	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106539	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2112180	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112234	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105044	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105046	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105047	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105220	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105222	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105223	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2110002	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110004	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110005	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110194	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110196	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110197	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110381	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110383	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110453	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110455	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110683	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110685	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110710	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110712	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2115618	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115619	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115621	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115622	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115718	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115719	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115721	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115722	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2116368	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116369	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116370	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116371	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116372	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116428	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116429	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116430	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116431	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116432	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2105045	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105221	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110003	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110195	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110382	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110454	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110684	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110711	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2115620	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115720	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2105976	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106276	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108950	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108998	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109043	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109045	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109064	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109066	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111221	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111223	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111359	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111361	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111456	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111458	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111459	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111560	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111562	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111563	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111661	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111663	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111691	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111693	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111848	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111850	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111881	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111883	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112076	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112078	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112094	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112096	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2113307	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113308	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113309	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113310	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2113311	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113552	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113553	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113554	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113555	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113556	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2115023	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115024	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115025	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115026	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115027	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115268	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115269	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115270	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115271	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115272	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2116075	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116076	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116077	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116222	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116223	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116224	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116547	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116548	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116634	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116635	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118902	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118903	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118904	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118905	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119070	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119071	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119072	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119073	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2105975	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105977	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106275	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106277	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2108949	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108997	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109044	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109065	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111222	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111360	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111457	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111561	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111662	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111692	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111849	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111882	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112077	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112095	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2116546	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116633	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108122	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108124	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108125	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108202	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108204	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108205	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2109303	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109304	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109305	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109351	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109352	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109353	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109427	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109429	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109439	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109441	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111643	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111645	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111649	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111651	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111910	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111911	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111916	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111917	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2117156	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117157	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117159	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117160	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117406	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117407	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117409	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117410	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117652	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117654	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117655	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117852	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117854	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117855	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118209	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118211	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118212	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118405	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118407	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118408	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2108123	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108203	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2109302	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109350	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109428	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109440	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111644	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111650	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2117158	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117408	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117653	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117853	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118210	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118406	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112182	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112184	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112236	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112238	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116713	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116714	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116731	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116732	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2112183	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112237	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105048	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105050	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105051	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105224	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105226	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105227	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109197	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109198	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109199	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109203	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109204	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109205	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109209	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109210	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109211	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109215	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109216	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109217	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109221	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109222	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109223	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110006	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110008	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110009	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110198	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110200	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110201	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110516	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110518	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110541	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110543	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110686	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110688	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110713	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110715	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2115623	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115624	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115626	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115627	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115723	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115724	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115726	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115727	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2105049	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105225	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110007	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110199	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110517	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110542	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110687	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110714	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2115625	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115725	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2105979	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106279	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109894	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109896	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109897	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,028
2109974	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109976	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109977	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,028
2111282	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111284	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111285	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,774
2111342	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111344	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111345	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,774
2111460	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111462	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111463	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111564	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111566	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111567	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111664	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111666	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111694	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111696	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111851	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111853	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111884	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111886	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112079	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112081	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112097	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112099	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2113312	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113313	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113314	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113315	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113316	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113557	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113558	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113559	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113560	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113561	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2115028	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115029	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115030	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115031	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115032	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115273	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115274	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115275	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115276	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115277	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2116078	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116080	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116225	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116227	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116549	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116550	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116551	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116636	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116637	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116638	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118639	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118661	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118682	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118683	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118685	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118686	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118737	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118738	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118740	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118741	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118906	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118907	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118908	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118909	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119074	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119075	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119076	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119077	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2105978	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105980	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106278	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106280	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109895	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109975	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111283	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111343	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111461	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111565	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111665	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111695	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111852	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111885	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112080	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112098	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2116079	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116226	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2118638	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118660	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118684	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118739	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108126	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108128	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108129	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2108206	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108208	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2108209	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,015
2111766	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2111768	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2111769	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,872
2111790	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2111792	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2111793	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,872
2111912	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111913	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111918	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111919	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2116032	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116034	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116041	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116043	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2117161	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117162	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117164	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117165	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117411	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117412	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117414	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117415	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117658	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117659	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117858	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117859	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118215	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118216	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118411	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118412	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2108127	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2108207	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2111767	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2111791	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2116033	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2116042	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2117163	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117413	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117656	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117657	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117856	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117857	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118213	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118214	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118409	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118410	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116716	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116734	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116715	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2116733	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2106528	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106540	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2112185	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112187	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112239	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112241	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106529	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106541	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2112186	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112240	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105052	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105054	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105055	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105228	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105230	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105231	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2106844	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106846	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106853	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106855	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2110011	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110012	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110013	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110203	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110204	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110205	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110387	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110389	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110459	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110461	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110689	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110691	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110716	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110718	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2115628	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115629	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115631	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115632	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115728	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115729	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115731	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115732	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2116373	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116374	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116375	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116376	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116377	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116433	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116434	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116435	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116436	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116437	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2117075	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	541
2117076	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	230,000
2117078	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	230,000
2117079	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,046
2117080	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	541
2117081	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	230,000
2117083	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	230,000
2117084	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,046
2105053	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105229	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2106845	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2106854	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2110010	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110202	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110388	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110460	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110690	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110717	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2115630	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115730	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2117077	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	230,000
2117082	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	230,000
2105982	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106282	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107869	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107871	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107881	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107883	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109506	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109508	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109509	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,568
2109514	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109516	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109517	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,568
2109599	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109600	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109601	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109623	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109624	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109625	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109642	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109643	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109660	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109661	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109673	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109685	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109707	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109731	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109898	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109900	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109901	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,028
2109978	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109980	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2109981	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,028
2110547	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2110548	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2111286	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111288	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111289	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,774
2111346	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111348	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2111349	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,774
2111464	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111466	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111467	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111568	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111570	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111571	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111854	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111856	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111887	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111889	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112019	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112020	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112021	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,040
2112051	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112052	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112053	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,040
2112082	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112084	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112100	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112102	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2113317	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113318	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113319	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113320	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113321	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113562	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113563	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113564	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113565	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113566	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2115033	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115034	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115035	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115036	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115037	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115278	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115279	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115280	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115281	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115282	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115488	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115489	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115490	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115491	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115492	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115543	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115544	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115545	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115546	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115547	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2116081	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116083	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116228	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116230	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116552	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116553	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116554	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116639	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116640	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116641	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116960	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2116961	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116962	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116963	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116964	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117020	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2117021	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117022	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117023	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117024	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2118910	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118911	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118912	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118913	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119078	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119079	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119080	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119081	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2105981	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105983	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106281	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106283	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107870	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2107882	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109507	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109515	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109598	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109622	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109641	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109659	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109672	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109684	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109706	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109708	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109709	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,907
2109730	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109732	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109733	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,907
2109899	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2109979	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111287	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111347	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2111465	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111569	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111855	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111888	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112018	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112050	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112083	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112101	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2116082	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116229	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2108610	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108611	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108634	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108635	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108952	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109000	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109108	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109110	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109126	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109128	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109307	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109308	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109309	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109355	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109356	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109357	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2115975	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115977	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116002	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116004	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2117166	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117167	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117169	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117170	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117416	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117417	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117419	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117420	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117662	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117663	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117862	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117863	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118219	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118220	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118415	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118416	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2119478	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119479	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119481	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119482	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119738	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119739	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119741	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119742	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119998	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,505
2119999	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120001	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120002	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120218	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,505
2120219	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120221	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120222	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2108951	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108999	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109109	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109127	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109306	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109354	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2115976	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116003	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2117168	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117418	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117660	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117661	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117860	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117861	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118217	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118218	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118413	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118414	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119480	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119740	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120000	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120220	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2115808	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115809	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115928	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115929	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2116717	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116718	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116735	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116736	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116745	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,144
2116746	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2116748	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2116749	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,723
2116750	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,144
2116751	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2116753	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2116754	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,723
2115805	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115806	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115807	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115925	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115926	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115927	FX	feb-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116747	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2116752	FX	feb-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2112188	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112190	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112242	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112244	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112189	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112243	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2110014	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110016	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110017	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110206	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110208	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110209	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110390	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110392	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110462	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110464	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115636	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115637	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115736	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115737	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2116877	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	297
2116878	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116879	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116880	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116881	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2116907	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	297
2116908	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116909	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116910	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116911	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2118078	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118079	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118080	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118081	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118130	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118131	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118132	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118133	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2110015	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110207	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110391	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110463	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2115633	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115634	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115635	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115733	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115734	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115735	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2105985	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106285	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111468	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111470	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111471	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111572	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111574	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111575	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111857	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111859	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111890	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111892	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112085	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	155,000
2112087	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	155,000
2112103	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	155,000
2112105	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	155,000
2113322	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113323	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113324	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113325	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113326	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113567	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113568	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113569	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113570	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113571	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2115038	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115039	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115040	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115041	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115042	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115283	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115284	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115285	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115286	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115287	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2116084	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116086	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116231	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116233	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116555	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116557	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116642	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116644	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118797	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,952
2118798	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118799	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118800	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118801	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,401
2118852	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,952
2118853	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118854	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118855	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118856	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,401
2118914	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118915	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118916	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118917	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119082	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119083	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119084	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119085	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119363	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119407	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2105984	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105986	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106284	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106286	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111469	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111573	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111858	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111891	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112086	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	155,000
2112104	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	155,000
2116085	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116232	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116556	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116643	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2119362	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119406	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109311	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109312	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109313	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109359	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109360	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109361	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2115978	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115980	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116005	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116007	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116351	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2116353	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2116354	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2116356	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2117174	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117175	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117424	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117425	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117666	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117667	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117866	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117867	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118223	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118224	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118419	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118420	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2119486	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119487	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119746	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119747	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2120006	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120007	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120226	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120227	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2109310	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109358	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2115979	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116006	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116352	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2116355	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2117171	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117172	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117173	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117421	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117422	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117423	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117664	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117665	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117864	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117865	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118221	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118222	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118417	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118418	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119483	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119484	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119485	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119743	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119744	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119745	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120003	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120004	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120005	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120223	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120224	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120225	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2116719	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116720	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116737	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116738	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2106530	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106542	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2112191	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112193	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112245	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112247	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106531	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106543	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2112192	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112246	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2110018	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110020	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110021	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110210	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110212	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110213	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110393	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110395	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110465	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110467	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115641	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115642	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115741	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115742	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2116378	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116379	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116380	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116381	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116382	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116438	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116439	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116440	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116441	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116442	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116884	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116885	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116886	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2116914	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116915	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116916	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2110019	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110211	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110394	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110466	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2115638	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115639	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115640	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115738	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115739	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115740	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2116882	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116883	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2116912	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116913	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2105988	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106288	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111472	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111474	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111475	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111576	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111578	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111579	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111667	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111669	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111697	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111699	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111860	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111862	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111893	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111895	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2113327	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113328	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113329	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113330	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113331	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113572	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113573	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113574	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113575	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113576	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2115043	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115044	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115045	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115046	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115047	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115288	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115289	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115290	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115291	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115292	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2116087	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116089	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116234	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116236	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116558	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116560	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116645	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116647	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118918	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118919	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118920	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118921	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119086	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119087	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119088	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119089	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2105987	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105989	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106287	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106289	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111473	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111577	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111668	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111698	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111861	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111894	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2116088	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116235	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116559	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116646	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2108954	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109002	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109046	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109048	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109067	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109069	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109314	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109316	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109317	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109362	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109364	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109365	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2111224	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111226	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111362	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111364	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115981	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115983	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116008	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116010	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2117179	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117180	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117429	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117430	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117670	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117671	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117870	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117871	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118227	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118228	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118423	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118424	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2119491	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119492	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119751	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119752	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2120011	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120012	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120231	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120232	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2108953	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109001	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109047	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109068	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109315	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109363	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111225	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111363	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115982	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116009	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2117176	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117177	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117178	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117426	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117427	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117428	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117668	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117669	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117868	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117869	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118225	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118226	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118421	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118422	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119488	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119489	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119490	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119748	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119749	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119750	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120008	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120009	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120010	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120228	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120229	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120230	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2109430	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109432	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109442	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109444	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2112194	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112196	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112248	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112250	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116721	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116722	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116739	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116740	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2109431	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109443	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2112195	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112249	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2110022	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110024	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110025	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110214	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110216	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110217	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110519	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110521	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110544	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110546	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115646	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115647	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115746	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115747	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2116889	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116890	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116891	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2116919	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116920	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116921	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2120991	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110023	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110215	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110520	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110545	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2115643	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115644	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115645	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115743	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115744	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115745	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2116887	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116888	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2116917	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116918	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2120990	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000,000
2111055	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111063	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111476	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111478	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111479	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111580	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111582	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111583	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111670	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111672	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111700	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111702	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111863	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111865	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111896	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111898	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2113332	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113333	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113334	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113335	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113336	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113577	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113578	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113579	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113580	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113581	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2115048	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115049	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115050	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115051	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115052	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115293	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115294	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115295	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115296	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115297	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2116090	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116092	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116237	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116239	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116561	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116563	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116648	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116650	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118082	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118083	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118084	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118085	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118134	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118135	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118136	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118137	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118641	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118663	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118690	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118691	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118745	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118746	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118922	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118923	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118924	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118925	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119090	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119091	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119092	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119093	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111054	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111056	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111057	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,140
2111062	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111064	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111065	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,140
2111477	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111581	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111671	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111701	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111864	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111897	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2116091	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116238	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116562	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116649	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118640	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118662	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118687	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,709
2118688	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118689	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118742	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,709
2118743	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118744	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115984	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115986	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116011	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116013	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2117184	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117185	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117434	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117435	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117674	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117675	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117874	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117875	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118231	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118232	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118427	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118428	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2119496	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119497	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119756	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119757	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2120016	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120017	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120236	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120237	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2115985	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116012	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2117181	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117182	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117183	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117431	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117432	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117433	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117672	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117673	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117872	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117873	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118229	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118230	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118425	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118426	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119493	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119494	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119495	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119753	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119754	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119755	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120013	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120014	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120015	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120233	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120234	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120235	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2116723	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116724	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116741	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116742	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2106532	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106544	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106847	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106849	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106856	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106858	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112106	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112108	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112109	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,632
2112114	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112116	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112120	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112122	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112136	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112138	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112139	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,632
2112144	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112146	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112150	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112152	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112156	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112158	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112197	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112199	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112251	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112253	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106533	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106545	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106848	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2106857	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112107	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2112115	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112121	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112137	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112145	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112151	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112157	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112198	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112252	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2107872	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107874	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107884	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107886	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2110026	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110028	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110029	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110218	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110220	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110221	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110399	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110401	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110471	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110473	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111480	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111482	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111483	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111584	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111586	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111587	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111866	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111868	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111899	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111901	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112022	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112024	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112025	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,296
2112054	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112056	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112057	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,296
2113337	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113338	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113339	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113340	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113341	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113582	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113583	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113584	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113585	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113586	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2115053	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115054	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115055	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115056	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115057	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115298	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115299	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115300	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115301	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115302	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115495	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115496	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115497	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115550	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115551	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115552	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115651	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115652	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115751	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115752	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115987	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115989	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116014	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116016	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116035	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116037	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116044	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116046	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116093	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116095	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116240	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116242	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116383	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116384	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116385	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116386	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116387	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116443	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116444	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116445	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116446	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116447	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116707	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	150,000
2116708	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	150,000
2116894	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116895	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116896	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2116924	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116925	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116926	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2116965	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2116966	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116967	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116968	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116969	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2117025	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2117026	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117027	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117028	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117029	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2117189	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117190	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117439	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117440	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117678	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117679	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117878	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117879	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118235	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118236	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118431	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118432	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2119501	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119502	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119761	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119762	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2120021	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120022	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120241	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120242	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120490	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120491	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120492	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,611
2120540	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120541	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120542	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,611
2107873	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2107885	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2110027	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110219	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110400	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110472	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111481	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111585	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111867	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111900	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112023	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112055	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115493	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,912
2115494	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115548	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,912
2115549	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115648	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115649	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115650	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115748	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115749	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115750	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115988	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116015	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116036	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2116045	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2116094	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116241	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116892	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116893	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2116922	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116923	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2117186	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117187	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117188	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117436	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117437	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117438	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117676	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117677	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117876	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117877	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118233	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118234	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118429	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118430	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119498	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119499	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119500	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119758	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119759	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119760	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120018	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120019	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120020	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120238	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120239	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120240	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120488	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,724
2120489	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120538	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,724
2120539	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2108612	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108613	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108636	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108637	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108956	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109004	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2116564	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116566	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116651	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116653	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116725	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116726	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116743	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2116744	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2108955	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109003	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2116565	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116652	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109111	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109113	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109129	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109131	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2112200	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112202	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112254	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112256	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2120992	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120994	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121022	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121024	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121602	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121603	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121604	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121656	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121657	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121658	FX	mar-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109112	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109130	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2112201	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112255	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2120993	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121023	FX	mar-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
C67349	15/12/2024	Unwound		mxn/usd	88,546,500	4,500,000	
C67360	15/12/2024	Unwound		usd/mxn	4,500,000	88,546,500	
C67392	15/03/2024	Unwound		mxn/usd	37,271,948	1,959,619	
E81343	06/03/2024	Unwound	12,000,000	mxn			12,000,000
E81361	30/01/2024	Unwound	21,300,000	mxn			21,300,000
E81379	06/03/2024	Unwound	12,000,000	mxn			12,000,000
E81380	06/03/2024	Unwound	12,000,000	mxn			12,000,000
E81381	06/03/2024	Unwound	12,000,000	mxn			12,000,000
E81419	30/01/2024	Unwound	21,300,000	mxn			21,300,000
E83557	05/03/2024	Unwound	22,180,000	mxn			22,180,000
E83558	05/03/2024	Unwound	22,180,000	mxn			22,180,000
E85394	23/02/2024	Unwound	51,260,000	mxn			51,260,000
E85395	23/02/2024	Unwound	51,260,000	mxn			51,260,000
P17996	17/06/2025	Unwound	200,000,000	mxn			200,000,000
P17998	17/06/2025	Unwound	200,000,000	mxn			200,000,000
P18041	17/03/2027	Unwound	230,000,000	mxn			230,000,000
P18042	17/03/2027	Unwound	230,000,000	mxn			230,000,000
P18044	17/03/2027	Unwound	230,000,000	mxn			230,000,000
P18045	17/03/2027	Unwound	230,000,000	mxn			230,000,000
P18657	26/01/2025	Unwound	42,028,986	mxn			42,028,986
P18658	26/01/2025	Unwound	42,028,986	mxn			42,028,986
P18659	26/01/2025	Unwound	42,028,986	mxn			42,028,986
P18661	26/01/2025	Unwound	42,028,986	mxn			42,028,986
SDS180	09/09/2024	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SDS181	09/09/2024	Unwound	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	
SDT041	17/04/2024	Unwound	20,500,000	mxn	20,500,000	20,500,000	
SGB125	28/11/2025	Unwound	186,458,729	mxn	186,458,729	186,458,729	
SGO620	30/04/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGQ699	11/05/2029	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGW214	17/06/2025	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGW217	17/06/2025	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHD677	08/08/2027	Unwound	261,043,002	mxn	261,043,002	261,043,002	
SHD678	08/08/2027	Unwound	94,410,707	mxn	94,410,707	94,410,707	
SHD679	08/08/2027	Unwound	119,546,291	mxn	119,546,291	119,546,291	
SHD682	08/08/2027	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SHJ616	30/09/2025	Unwound	995,396	usd	995,396	995,396	
SJF161	30/06/2026	Unwound	3,511,892	usd	3,511,892	3,511,892	
SJF213	30/06/2026	Unwound	3,511,892	usd	3,511,892	3,511,892	
SJF341	22/06/2031	Unwound	4,928,056	usd	4,928,056	4,928,056	
SJF348	26/02/2026	Unwound	4,279,706	usd	4,279,706	4,279,706	
SJF362	22/06/2031	Unwound	4,928,056	usd	4,928,056	4,928,056	
SJF363	26/02/2026	Unwound	4,279,706	usd	4,279,706	4,279,706	
SJI621	15/02/2028	Unwound	30,316,104	usd	30,316,104	30,316,104	
SJI645	15/02/2028	Unwound	30,316,104	usd	30,316,104	30,316,104	
SKS268	12/02/2034	Unwound	3,620,000	usd	3,620,000	3,620,000	

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertura o Nego	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	5,232,134,790	Compra	Divisas	Divisas	131,033,968,027	178,382,155,760	5,205,093,394	27,041,396	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	5,490,847,025	Venta	Divisas	Divisas	(130,410,972,261)	(178,057,952,405)	5,445,442,304	45,404,721	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,159,400,000	Compra	Acción	Acción	115,625,789	71,266,772	818,030,000	341,370,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,159,400,000	Venta	Acción	Acción	(104,578,497)	(69,509,078)	818,030,000	341,370,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	9,278,337,530	Compra	Divisas	Divisas	245,964,263	215,520,455	7,688,514,071	1,589,823,459	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	8,947,087,530	Venta	Divisas	Divisas	(194,342,987)	(170,194,616)	7,357,264,071	1,589,823,459	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,987,106,700	Compra	Índice	Índice	232,523,040	275,699,030	14,626,700	3,972,480,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,123,043,400	Venta	Índice	Índice	(72,580,681)	(81,734,098)	29,253,400	1,093,790,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	38,558,829,240	Compra	Tasas	Tasas	786,044,293	729,770,154	1,500,000,000	32,419,367,363	4,639,461,877	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	38,223,665,039	Venta	Tasas	Tasas	(766,457,540)	(717,898,773)	1,500,000,000	32,222,265,351	4,501,399,688	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	12,020,000	Compra	Acción NE	Acción NE	6,726,285	387,567	-	12,020,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	12,020,000	Venta	Acción NE	Acción NE	(17,773,577)	(2,145,261)	-	12,020,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	202,913,400	Compra	Índice NE	Índice NE	56,125,431	48,661,062	29,253,400	173,660,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,048,501,700	Venta	Índice NE	Índice NE	(216,061,931)	(242,623,643)	14,626,700	3,033,875,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,237,147,717	Compra	Divisas NE	Divisas NE	28,926,760	14,772,956	287,276,696	949,871,022	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,237,147,717	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(80,851,711)	(56,211,808)	287,276,696	949,871,022	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	7,345,940,398	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	482,606,920	647,637,872	-	5,143,734,970	2,202,205,428	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	3,910,324,505	CCIRS / IRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	233,896,278	321,329,503	-	2,805,031,735	1,105,292,770	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	68,348,166,502	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	1,072,471,611	1,611,153,178	-	45,441,187,011	22,906,979,490	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	645,250,000	CCIRS	Reuters_SOFR / LIBOR USD	TASA DE INTERES / LIBOR USD	350,985,295	68,246,460	645,250,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	62,595,638	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	87,245,917	77,479,546	-	62,595,638	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	98,385,683,405	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	861,065,744	1,933,940,410	2,044,988,592	50,553,187,907	45,787,506,906	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	415,155,898,630	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	5,612,226,342	6,272,613,723	81,675,544,122	221,981,145,181	111,499,209,326	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	101,573,391,147	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	(40,773,666)	(873,423,667)	2,149,333,158	51,511,692,881	47,912,365,107	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	450,070,508,196	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	(6,586,074,542)	(7,531,118,584)	115,840,655,434	213,283,741,100	120,946,111,662	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
100000000000			**A C T I V O**	822,126,129,068	776,395,925,051
100200001001			**Efectivo y equivalentes de efectivo**	46,341,584,773	51,507,767,675
100400001001			**Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)**	1,307,395,619	1,091,283,713
100600001001			**INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS**	164,604,800,675	150,346,991,020
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	65,473,212,650	70,602,283,110
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	94,171,555,404	74,980,216,410
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	4,960,032,621	4,764,491,500
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	4,960,562,645	4,764,991,360
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-530,024	-499,860
101000001001			**Deudores por reporto**	17,102,700,345	4,849,434,616
101200001001			**PRÉSTAMO DE VALORES**	0	0
101400001001			**Instrumentos financieros derivados**	44,897,478,626	41,589,339,958
	101400102001		Con fines de negociación	33,955,579,818	32,944,570,688
	101400102002		Con fines de cobertura	10,941,898,808	8,644,769,270
101600001001			**AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS**	-652,656,726	-1,111,571,160
	101800104001		**Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1**	487,787,655,438	466,847,532,177
	101800105001		Créditos comerciales	233,609,459,356	244,569,360,108
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	195,917,048,724	214,038,666,700
		101800107002	Entidades financieras	17,814,607,520	16,097,110,295
		101800107003	Entidades gubernamentales	19,877,803,112	14,433,583,113
	101800105002		Créditos de consumo	38,551,935,114	32,373,683,089
	101800105003		Créditos a la vivienda	215,626,260,968	189,904,488,980
		101800507023	Media y residencial	210,818,776,686	184,554,112,059
		101800507024	De interés social	3,997,253	4,512,352
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	4,803,487,029	5,345,864,569
		101800507026	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800507027	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800105004		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
	101800104002		**Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2**	4,939,774,321	5,723,212,541
	101800205005		Créditos comerciales	254,240,287	2,020,777,850
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	254,240,287	2,020,777,850
		101800506008	Entidades financieras	0	0
		101800506009	Entidades gubernamentales	0	0
	101800205006		Créditos de consumo	973,980,584	668,304,760
	101800205007		Créditos a la vivienda	3,711,553,450	3,034,129,931
		101800706018	Media y residencial	3,554,718,340	2,870,865,593
		101800706019	De interés social	0	245,972
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	156,835,110	163,018,366
		101800706021	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800706022	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104003		**Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3**	17,583,475,182	18,550,019,776
	101800305008		Créditos comerciales	6,421,930,091	9,425,209,753
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	6,365,563,631	9,333,730,228
		101800806024	Entidades financieras	56,366,460	91,479,525
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	0
	101800305009		Créditos de consumo	941,206,307	822,993,643
	101800305010		Créditos a la vivienda	10,220,338,784	8,301,816,380
		101801006034	Media y residencial	9,770,862,959	7,955,314,107
		101801006035	De interés social	9,077,208	10,054,940
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	440,398,617	336,447,333
		101801006037	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801006038	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104004		**Cartera de crédito valuada a valor razonable**	0	0
	101800405011		Créditos comerciales	0	0
		101801106039	Actividad empresarial o comercial	0	0
		101801106040	Entidades financieras	0	0
		101801106041	Entidades gubernamentales	0	0
	101800405012		Créditos de consumo	0	0
	101800405013		Créditos a la vivienda	0	0
		101801306050	Media y residencial	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
		101801306051	De interés social	0	0
		101801306052	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	0	0
		101801306053	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801306054	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	131800103001		Cartera de crédito	510,310,904,941	491,120,764,494
	131800103002		Partidas diferidas	3,303,053,005	2,765,374,289
	101800103003		**ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS**	-13,523,848,143	-16,278,114,668
	131800102001		**Cartera de crédito (neto)**	500,090,109,803	477,608,024,115
	131800102002		**Derechos de cobro adquiridos (neto)**	0	0
131800001001			**Total de cartera de crédito (neto)**	500,090,109,803	477,608,024,115
102000001001			**Activos virtuales**	0	0
102200001001			**BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN**	0	0
132400001001			**Otras cuentas por cobrar (neto)**	26,660,918,104	29,121,295,260
132600001001			**Bienes adjudicados (neto)**	664,643,508	374,006,615
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	13,941,494	13,941,494
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	2,864,743,507	2,766,192,239
133400001001			**Propiedades, mobiliario y equipo (neto)**	5,239,236,185	4,710,228,767
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,398,927,073	2,676,635,045
103800001001			**INVERSIONES PERMANENTES**	113,306,776	53,440,841
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	5,895,643,094	6,229,166,229
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,583,356,212	4,569,748,624
134400001001			Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	0	0
104600001001			Crédito mercantil	0	0
200000000000			**P A S I V O**	740,939,426,725	700,959,991,188
200200001001			**CAPTACIÓN TRADICIONAL**	553,301,815,227	485,730,744,303
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	292,949,401,441	229,911,357,721
	200200102002		Depósitos a plazo	237,920,675,185	249,544,535,307
		200200203003	Del público en general	212,753,092,299	205,914,353,474
		200200203004	Mercado de dinero	25,167,582,886	43,630,181,833
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	21,120,038,692	5,047,070,765
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	1,311,699,909	1,227,780,510
200400001001			**PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS**	33,035,423,222	35,734,004,661
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	21,795,337,420	21,509,318,184
	200400102003		De largo plazo	11,240,085,802	14,224,686,477
230600001001			**VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR**	7,721,381,978	7,743,275,172
200800001001			**ACREEDORES POR REPORTO**	54,517,806,464	68,421,085,319
201000001001			**PRÉSTAMO DE VALORES**	81,495	105,395
201200001001			**COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA**	998,187,975	8,525,558,270
	201200102001		Reportos	0	4,001,642,802
	201200102002		Préstamo de valores	998,187,975	4,523,915,468
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			**Instrumentos financieros derivados**	41,853,997,693	38,505,188,154
	201400102001		Con fines de negociación	33,558,882,918	32,244,837,033
	201400102002		Con fines de cobertura	8,295,114,775	6,260,351,121
201600001001			**AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS**	0	1,123,738
201800001001			**OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN**	0	0
202000001001			**Pasivo por arrendamiento**	2,560,727,632	2,773,430,069
202200001001			**Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal**	0	0
202400001001			**OTRAS CUENTAS POR PAGAR**	29,671,708,542	35,928,530,497
	202400102001		Acreedores por liquidación de operaciones	16,330,109,874	17,717,834,132
	202400102002		Acreedores por cuentas de margen	1,643,606,434	1,863,018,457
	202400102003		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	3,791,992,798	4,666,072,125
	202400102004		Contribuciones por pagar	490,877,563	391,441,137
	202400102005		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	7,415,121,873	11,290,164,646
202600001001			Pasivos relacionados con grupos de activos mantenidos para la venta	0	0
202800001001			Pasivos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
203000001001			Instrumentos financieros que califican como pasivo	9,101,670,745	9,099,006,104
	203000102001		**OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN**	9,101,670,745	9,099,006,104
	203000102002		**Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno**	0	0
	203000102003		**Otros**	0	0
203200001001			**Obligaciones asociadas con el retiro de componentes de propiedades, mobiliario y equipo**	0	0
203400001001			**Pasivo por impuestos a la utilidad**	231,957,742	1,081,544,366
203600001001			**Pasivo por beneficios a los empleados**	6,813,564,302	6,339,877,598
203800001001			**Créditos diferidos y cobros anticipados**	1,131,103,708	1,076,517,542
400000000000			**CAPITAL CONTABLE**	81,186,702,343	75,435,933,863
440200001001			**Participación controladora**	81,185,238,170	75,434,651,399
	400200102001		**CAPITAL CONTRIBUIDO**	13,468,335,561	13,468,335,561
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	9,420,300,433
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	1,250,665,369
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	2,716,852,485	2,716,852,485
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	80,517,274
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		**CAPITAL GANADO**	67,716,902,609	61,966,315,838
		400200203010	Reservas de capital	8,949,346,887	7,839,163,707
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	162,317,294
		400200203012	Resultados acumulados	58,726,160,465	53,943,045,102
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	56,116,362,815	50,947,569,992
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	2,609,797,650	2,995,475,110
	400200203013		Otros resultados integrales	-119,510,748	23,808,852
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-355,387,283	-304,729,802
		400201304007	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0
		400201304008	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	827,960,059	809,620,138
		400201304009	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0
		400201304010	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304011	Incremento por actualización de Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304012	Remedición de beneficios definidos a los empleados	-592,083,524	-481,081,484
		400201304013	Incremento por actualización de la remedición de beneficios definidos a los empleados	0	0
		400201304014	Efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304015	Incremento por actualización del efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304016	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
		400201304017	Incremento por actualización del resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	400200203014		Participación en ORI de otras entidades	-1,411,289	-2,019,117
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			**PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA**	1,464,173	1,282,464
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	47,938	42,648
	440400102002		Otra participación no controladora	1,416,235	1,239,816
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			**CUENTAS DE ORDEN**	3,600,167,842,885	3,090,332,561,411
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	336,181,450,536	248,799,478,552
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	480,613,490,328	455,304,964,996
	700800102001		Fideicomisos	451,504,836,154	426,175,877,586
	700800102002		Mandatos	29,108,654,174	29,129,087,410
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	639,594,549,609	642,746,918,663
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	24,179,919,844	14,524,572,339
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	998,187,975	8,524,595,680
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,725,362,028	1,389,137,703
702000001001			Otras cuentas de registro	2,116,874,882,565	1,719,042,893,478

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB** TRIMESTRE: **01** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 31 DE MARZO DE 2024 Y 2023

(PESOS)

Impresión Final

		TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	20,840,238,099	18,391,747,947
600400101002	Gastos por intereses	14,064,934,882	11,732,736,178
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	**MARGEN FINANCIERO**	6,775,303,217	6,659,011,769
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	1,033,799,934	145,206,617
330000000002	**MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS**	5,741,503,283	6,513,805,152
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	1,223,704,690	1,308,161,498
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	110,363,067	108,810,030
501400301007	Resultado por intermediación	755,690,293	563,125,126
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	211,832,201	281,702,617
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	4,052,976,584	4,433,543,511
330000000003	**RESULTADO DE LA OPERACIÓN**	3,769,390,816	4,124,440,852
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	-153,889,125	79,155,487
330000000004	**RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD**	3,615,501,691	4,203,596,339
602400501012	Impuestos a la utilidad	1,005,656,103	1,208,078,581
330000000005	**RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS**	2,609,845,588	2,995,517,758
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	**RESULTADO NETO**	2,609,845,588	2,995,517,758
502800701014	Otros Resultados Integrales	-110,063,106	10,298,922
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-254,373,425	51,681,257
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	125,561,871	-42,368,782
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remedición de beneficios definidos a los empleados	18,748,448	986,447
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	67,265	84,956
330000000007	**RESULTADO INTEGRAL**	2,499,849,747	3,005,901,636
543200601016	**Resultado neto atribuible a:**	2,609,845,588	2,995,517,758
543201602158	Participación controladora	2,609,797,650	2,995,475,110
543201602159	Participación no controladora	47,938	42,648
543400701017	**Resultado integral atribuible a:**	2,499,849,747	3,005,901,636
543401702160	Participación controladora	2,499,849,747	3,005,901,636
543401702161	Participación no controladora	0	0
330000000008	**UTILIDAD BÁSICA POR ACCIÓN ORDINARIA**	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB** TRIMESTRE: **01** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS) **Impresión Final**

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
		Actividades de operación		
851000102001		**Resultado antes de impuestos a la utilidad**	3,615,501,691	4,203,596,339
851000102002		**Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:**	634,712,573	-461,239,294
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	269,276,470	265,605,529
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	213,364,575	197,799,817
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	-1,817,597	9,522,231
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	153,889,125	-79,155,487
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	0	-855,011,384
	851000203006	Operaciones discontinuadas	0	0
	851000203007	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	0	0
851000102003		Ajustes por partidas asociadas con actividades de financiamiento	692,571,008	463,781,986
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	692,571,008	463,781,986
	851000303003	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000303004	Otros intereses	0	0
851000102004		**Cambios en partidas de operación**	-315,225,082	-12,866,353,569
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	-3,768,883,397	-13,783,940,869
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	75,171,327	1,116,609,669
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	16,248,739,846	-20,449,253,774
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	-9,094,051,813	-1,624,941,608
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-1,928,751,614	-1,259,047,006
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	3,373,860,971	3,504,463,499
	851000403008	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	851000403009	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	851000403010	Cambio en activos virtuales	0	0
	851000403011	Cambio en otras cuentas por cobrar (neto)	133,693,146	-13,690,038,482
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-79,416,345	-89,073,858
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	4,785,851,839	-369,333,545
	851000403014	Cambio en captación tradicional	11,888,375,260	265,090,503
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	-13,802,855,859	12,660,179,719
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	23,900	44,499
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	-7,386,299,101	4,560,233,845
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	2,027,153,795	1,673,222,505
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	42,091,198	42,091,189
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	31,120,028	-14,544,366
	851000403021	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	851000403022	Cambio en activos/pasivos por beneficios a los empleados	509,903,630	706,005,475
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	-2,162,056,945	15,272,612,355
	851000403024	Cambio en otras provisiones	-4,024	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-1,208,890,924	-1,386,733,319
851000001001		**Flujos netos de efectivo de actividades de operación**	4,627,560,190	-8,660,214,538
		Actividades de inversión		
	851000202001	Pagos por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202002	Cobros por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202003	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-69,152,120	-57,655,359
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
	851000202005	Pagos por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202006	Cobros por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202007	Pagos por adquisición de subsidiarias	0	0
	851000202008	Cobros por disposición de subsidiarias	0	0
	851000202009	Pagos por adquisición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202010	Cobros por disposición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202011	Cobros de dividendos en efectivo de inversiones permanentes	181,178,518	78,670,629
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-186,531,217	-179,665,382
	851000202013	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	851000202014	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	851000202015	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB** TRIMESTRE: **01** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS) **Impresión Final**

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
	851000202016	Otros cobros por actividades de inversión	0	0
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	**Flujos netos de efectivo de actividades de inversión**	-74,504,819	-158,650,112
		Actividades de financiamiento		
	851000302001	Cobros por la obtención de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302002	Pagos de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302003	Pagos de pasivo por arrendamiento	-180,049,837	-240,563,490
	851000302004	Cobros por emisión de acciones	0	0
	851000302005	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	851000302006	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302007	Pagos asociados a instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302008	Pagos de dividendos en efectivo	-4,999,990,635	-2,849,994,662
	851000302009	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	851000302010	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo	0	0
	851000302011	Pagos asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	-692,571,008	-463,781,986
	851000302012	Pagos por intereses por pasivo por arrendamiento	0	0
	851000302013	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302014	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302015	Otros cobros por actividades de financiamiento	0	0
	851000302016	Otros pagos por actividades de financiamiento	0	0
851000001003		**Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento**	-5,872,611,480	-3,554,340,138
	851000000000	**Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo**	-1,319,556,109	-12,373,204,788
	851200000000	**Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo**	0	0
	851400000000	**Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo**	47,661,140,882	63,880,972,463
	100200001001	**Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo**	46,341,584,773	51,507,767,675

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE CAMBIOS EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado									Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remediciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversion	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Participación en ORI de otras entidades			
Saldo al inicio del periodo	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	56,116,362,815	-101,013,858	702,398,188	0	-610,831,972	0	0	-1,478,554	78,685,436,361	1,416,235	78,686,852,596
Ajustes retrospectivos por cambios contables	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Ajustes retrospectivos por correcciones de errores	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Saldo ajustado	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	56,116,362,815	-101,013,858	702,398,188	0	-610,831,972	0	0	-1,478,554	78,685,436,361	1,416,235	78,686,852,596
MOVIMIENTOS DE PROPIETARIOS																
Aportaciones de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Reembolsos de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Decreto de dividendos	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Capitalización de otros conceptos del capital contable	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cambios en la participación controladora que no implican pérdida de control	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
MOVIMIENTOS DE RESERVAS																
Reservas de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
RESULTADO INTEGRAL																
Resultado neto	0	0	0	0	0	2,609,797,650	0	0	0	0	0	0	0	2,609,797,650	47,938	2,609,845,588
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	-254,373,425	125,561,871	0	18,748,448	0	0	0	-110,063,106	0	-110,063,106
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	-254,373,425	0	0	0	0	0	0	-254,373,425	0	-254,373,425
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	125,561,871	0	0	0	0	0	125,561,871	0	125,561,871
Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remedición de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	18,748,448	0	0	0	18,748,448	0	18,748,448
Efecto acumulado por conversión	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Participación en ORI de otras entidades	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	67,265	67,265	0	67,265
Total	0	0	0	0	0	2,609,797,650	-254,373,425	125,561,871	0	18,748,448	0	0	67,265	2,499,801,809	47,938	2,499,849,747
Saldo al final del periodo	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	58,726,160,465	-355,387,283	827,960,059	0	-592,083,524	0	0	-1,411,289	81,185,238,170	1,464,173	81,186,702,343

ANEXO
Scotiabank Inverlat

INDICADORES FINANCIEROS

Scotiabank-Indicadores Financieros T2 2023T3 2023T4 2023T1 2024
ROE
(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)13.2%14.8%14.2%
13.1%
ROA
(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)1.3%1.5%1.4%1.3%
MIN
(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos
productivos promedio)3.4%3.3%3.1%3.0%
Eficiencia Operativa
(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total
promedio)2.2%2.1%2.2%2.0%
Índice de Morosidad
(Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del
trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)4.0%4.0%3.3%3.4%
Índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3
(Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del
trimestre/Saldo de la
cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)82.2%79.8%
77.4%76.9%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito21.94%22.60%21.47%22.01%1)
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales
(crédito, mercado y operacional)16.59%17.07%15.99%.16.64%1)
Liquidez
(Activos líquidos / Pasivos líquidos)50.6%49.0%47.2%44.4%
1).Sujeto a aprobación de Banco Central

En el primer trimestre de 2024 Scotiabank alcanzó una utilidad neta de $2,610 millones, una disminución de $385 millones o 13% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente por mayores requerimientos de reservas crediticias. Por otro lado, el PTPP presentó un incremento de $535 millones o 13% respecto al mismo trimestre del año pasado alcanzando $4,804 millones; impulsado por mayores ingresos en el margen financiero e intermediación, así como una gestión eficiente del gasto.
La utilidad neta mostró una disminución de $218 millones u 8% respecto al trimestre anterior. Al mismo tiempo, el PTPP presentó un incremento de $497 millones o 12%, debido a mayores ingresos por intermediación y una gestión eficiente del gasto; compensados parcialmente por un menor margen financiero.

3 meses
Scotiabank-Información Financiera
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar
202331 dic
202331 mar
2024A/A
Δ%
Ingresos por intereses 18,392 21,215 20,840 13%
Gastos por intereses(11,733)(14,035)(14,065)20%
Margen Financiero 6,659 7,180 6,775 2%
Comisiones 1,199 1,210 1,114 -7%
Resultado por Intermediación 563 312 756 34%
Otros ingresos/egresos de la operación 282 115 212 -25%
Ingresos no Financieros 2,044 1,637 2,082 2%
Total Ingresos 8,703 8,817 8,857 2%
Gastos de Administración y Promoción(4,434)(4,510)(4,053)-9%
PTPP 1). 4,269 4,307 4,804 13%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(145)(1,191)(1,034)> +100%
Resultado de la Operación 4,124 3,116 3,770 -9%
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora 79 394 (154)> -100%
Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 4,203 3,510 3,616 -14%
Impuestos a la Utilidad(1,208)(682)(1,006)-17%
Resultado Neto 2,995 2,828 2,610 -13%
Otros Resultados Integrales
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender 52 662 (254)> -100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo(42) (774) 125 > -100%
Remedición de beneficios definidos a los empleados 1 (154) 19 > +100%
Participación en ORI de otras entidades - 1 - 0%
Resultado Integral 3,006 2,563 2,500 -17%
1).PTPP: “Pre-Tax, Pre-Provision”, resultado antes de impuestos y reservas.

MARGEN FINANCIERO
El margen financiero fue de $6,775 millones al cierre del primer trimestre de 2024, un incremento de $116 millones o 2% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente por mayores ingresos en la cartera comercial e hipotecaria, así como un día más de operación; compensados parcialmente por mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.
Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró una disminución de $405 millones o 6%; debido principalmente a un día menos de operación y menores volúmenes de cartera comercial; compensado parcialmente por mayores volúmenes de menudeo.
INGRESOS NO FINANCIEROS
El total de ingresos no financieros fue de $2,082 millones en el primer trimestre de

2024, un incremento de $38 millones o 2% respecto al mismo trimestre del año pasado, debido principalmente a mayores resultados por intermediación en el mercado cambiario; compensados por menores comisiones provenientes de colocación de créditos.
Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron un incremento de $445 millones o 27%, debido principalmente a mayores resultados por intermediación en instrumentos financieros derivados; compensados por menores comisiones provenientes de colocación de créditos.

3 meses
Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202331 dic
202331 mar
2024A/A
Δ%
Aceptaciones por Cuenta de Terceros 1 1 - -100%
Actividades Fiduciarias 60 46 57 -5%
Apertura de Cuenta 6 5 4 -33%
Cartas de Crédito 75 81 81 8%
Cheques Certificados 1 1 1 0%
Compraventa de instrumentos financieros - - 1 0%
Manejo de Cuenta 83 91 106 28%
Operaciones de Crédito 400 482 395 -1%
Otras Comisiones y Tarifas 495 430 297 -40%
Servicios de Banca Electrónica 51 47 149 > +100%
Transferencia de Fondos 27 26 23 -15%
Total de Comisiones y Tarifas (netas) 1,199 1,210 1,114 -7%

3 meses
Scotiabank-
Otros Ingresos/Egresos de la operación
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202331 dic
202331 mar
2024A/A
Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas 35 (15) 14 -60%
Aportaciones al IPAB(533)(577)(582)9%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo 35 5 6 -83%
Donativos - (17) - 0%
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados 6 9 8 33%
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito - - - 0%
Ingresos por Arrendamiento 3 9 12 > +100%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados 46 56 56 22%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación 762 787 751 -1%
Pérdida por venta de cartera de crédito - (79) - 0%
Quebrantos(72)(149)(105)46%
Recuperaciones - 3 - 0%
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo - (1) - 0%
Utilidad por venta de cartera de crédito - 84 2 0%
Resultado por adjudicación de bienes - - 50 0%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación 282 115 212 -25%

ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS
En el primer trimestre de 2024, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en $1,034 millones, un incremento de $889 millones respecto al mismo periodo del

año anterior; debido a mayores requerimientos en tarjeta de crédito, vivienda, automotriz y consumo.
Respecto al trimestre pasado, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra una disminución de $157 millones o 13%, principalmente por menores requerimientos en la cartera comercial.

3 meses
Scotiabank-
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202331 dic
202331 mar
2024A/A
Δ%
Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(145)(1,191)(1,034)> +100%

GASTOS DE ADMINISTRACIÓN Y PROMOCIÓN
Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en $4,053 millones en el primer trimestre de 2024, una disminución de $381 millones o 9% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una menor compensación variable; compensada parcialmente por mayores gastos por IVA, honorarios, procesadores y gastos generales.
Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, disminuyeron $457 millones o 10%, debido principalmente a menores gastos por amortización de sistemas, honorarios, IVA, así como por gastos generales.
3 meses
Scotiabank-
Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)
31 mar
202331 dic
202331 mar
2024A/A
Δ%
Gastos de Personal(2,367)(1,783)(1,768)-25%
Gastos de Operación(2,067)(2,727)(2,285)11%
Total de Gastos de Administración y Promoción(4,434)(4,510)(4,053)-9%

IMPUESTOS A LA UTILIDAD
En el primer trimestre de 2024, se registró un impuesto neto a cargo de $1,006 millones, una disminución de $202 millones o 17% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una menor utilidad gravable en el periodo.
Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto incrementó $324 millones o 48%, principalmente por una menor inflación en el periodo.
3 meses
Scotiabank-Impuestos - Impuestos
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202331 dic
202331 mar
2024A/A
Δ%
Impuesto a la Utilidad Causado(962)(657)(710)-26%
Impuesto a la Utilidad Diferido(246)(25)(296)20%
Total de Impuestos a la Utilidad(1,208)(682)(1,006)-17%

BALANCE GENERAL

6% respecto al cierre de marzo de 2023. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en cartera de crédito total, inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental) y deudores por reporto.

Los activos totales disminuyeron $14,194 millones o 2% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a menores volúmenes de inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental) y cartera de crédito total; compensados parcialmente por mayores deudores por reporto.

El total del pasivo registró $740,940 millones al 31 de marzo de 2024, un incremento de $39,980 millones o 6% respecto al cierre de marzo de 2023. Este incremento se debe a mayores volúmenes en depósitos; compensados parcialmente por menores volúmenes en otros pasivos (acreedores por reporto, colaterales vendidos o dados en garantía y acreedores diversos).

El pasivo total disminuyo $16,694 millones o 2% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a menores volúmenes en otros pasivos (acreedores por reporto, colaterales vendidos o dados en garantía y valores asignados por liquidar); así como préstamos bancarios y de otros organismos; compensados parcialmente por mayores volúmenes en depósitos.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar 202331 dic 202331 mar 2024A/A Δ%

Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores248,273284,193 273,601 10%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2472,571496,519 492,728 4%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 318,55017,061 17,583 -5%

Partidas diferidas2,7653,093 3,303 19%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(16,278)(13,209)(13,524)-17%

Otros Activos 50,515 48,663 48,435 -4%

Total Activo776,396836,320 822,126 6%

Depósitos 485,731 541,557 553,302 14%

Préstamos Bancarios y de Otros Organismos 35,734 36,804 33,035 -8%

Obligaciones Subordinadas en Circulación 9,099 9,060 9,102 0%

Otros Pasivos 170,396 170,213 145,501 -15%

Total Pasivo 700,960 757,634 740,940 6%

Capital 75,436 78,686 81,186 8%

Total Pasivo y Capital776,396836,320 822,126 6%

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 1 Y 2

La cartera de préstamos de menudeo al 31 de marzo de 2024 alcanzó $258,864 millones, un incremento anual de $32,883 millones o 15% y de $8,109 o 3% millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado principalmente por mayores créditos a la vivienda.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de marzo de 2024 se ubicó en $233,864 millones, una disminución anual de $12,726 millones o 5%; debido a menores créditos de cartera empresarial o comercial; compensados parcialmente por mayores créditos a entidades gubernamentales y financieras.

Respecto al trimestre anterior, el total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales disminuyeron $11,900 millones o 5%, debido a menores créditos de cartera a entidades financieras, empresarial o comercial, así como gubernamentales.

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos;

consolidado con subsidiarias)31 mar
202331 dic
202331 mar
2024A/A
Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales 33,042 37,274 39,526 20%
Créditos a la Vivienda 192,939 213,481 219,338 14%
Total Préstamos de Menudeo 225,981 250,755 258,864 15%
Actividad Empresarial o Comercial 216,060 200,774 196,171 -9%
Entidades Financieras 16,097 23,989 17,815 11%
Entidades Gubernamentales 14,433 21,001 19,878 38%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales 246,590 245,764 233,864 -5%
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 472,571 496,519 492,728 4%

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 3
Al 31 de marzo de 2024 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó $17,583 millones, una disminución anual de $967 millones o 5% y un incremento trimestral de $522 millones o 3%.
Por otro lado, la estimación preventiva para riesgos crediticios al 31 de marzo de 2024 se ubicó en $13,524 millones, una disminución anual de $2,754 millones o 17% y un incremento trimestral de $315 millones o 2%.
El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 76.9% al 31 de marzo de 2024, una disminución respecto al año pasado y al trimestre anterior de 1,083pb y 50pb, respectivamente.
El índice de morosidad al 31 de marzo de 2024 fue de 3.4%, una disminución de 33pb respecto del año anterior y un incremento de 13pb respecto al trimestre pasado.
Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202331 dic
202331 mar
2024A/A
Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 18,550 17,061 17,583 -5%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(16,278)(13,209)(13,524)-17%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta2,2723,8524,05979%
Índice de morosidad3.78%3.32%3.45%-33 pb

DEPÓSITOS
El total de depósitos registró $553,302 millones al 31 de marzo de 2024, un incremento anual de $ 67,571 millones o 14%, y de $11,745 millones o 2% respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral se debió principalmente a mayores depósitos de vista y ahorro.
Scotiabank – Depósitos
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202331 dic
202331 mar
2024A/A
Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro 229,911 276,129 292,949 27%
Público en General 205,915 208,686 212,753 3%
Mercado de Dinero 43,630 44,504 25,168 -42%
Total Depósitos a Plazo 249,545 253,190 237,921 -5%
Títulos de Crédito Emitidos 5,047 10,941 21,120 > +100%
Cuenta global de captación sin movimientos 1,228 1,297 1,312 7%

Total de Depósitos 485,731 541,557 553,302 14%

OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN
Al 31 de marzo de 2024, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en $9,102 millones, sin cambios significativos respecto al año pasado y al trimestre anterior.

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

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Instrumentos financieros negociables	63,576	1,855	17	25	65,473
Sin restricción:	-	-	17	25	42
Restringidos:	63,576	1,855	-	-	65,431
En operaciones de reporto	54,285	1,855	-	-	56,140
Préstamos de valores	1,064	-	-	-	1,064
Otros	8,227	-	-	-	8,227
Instrumentos financieros para cobrar o vender	70,245	21,893	-	2,034	94,172
Sin restricción:	69,514	21,893	-	2,034	93,441
Restringidos:	731	-	-	-	731
En operaciones de reporto	-	-	-	-	-
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	731	-	-	-	731
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	4,960	-	-	-	4,960
Sin restricción	4,960	-	-	-	4,960
Total	138,781	23,748	17	2,059	164,605

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

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I_BANSAN_24	14,922,556,935	10.90%	514	918

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados
(millones de pesos al 31 de marzo de 2024 valor razonable)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
Posición	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Negociación	3,510	3,186	-	-	1,215	961	303	363	28,927	29,049	-	-	33,955	33,559
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	10,942	8,295	-	-	10,942	8,295

Scotiabank-Montos nocionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de marzo de 2024)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados	
Posición	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	
Con fines de negociación												
Posición	USD	5,018	5,259	-	-	-	-	-	-	-	-	

Posición EUR214231----------
Posición CHF------------
Posición GBP------------
Posición CAD------------
Divisas CAD------------
Divisas USD----5757555535----
Divisas EUR------------
Divisas MXN------9292----
Acciones MXN----12121,1591,159----
Índices MXN----2033,0493,9871,123----
Tasa de interés
Pesos------27,43827,103426,712457,037--
Dólares------6716716,3856,604--
Euros--------8---
Pesos Colombianos--------177,500---
Con fines de cobertura
Tasa de interés
Pesos --------66,583580--
Dólares --------647517--
Euros ------------

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 31 de marzo de 2024)PesosDólaresUdisTotal
Actividad empresarial o comercial 155,304 40,613 - 195,917
Créditos a entidades financieras 17,582 233 - 17,815
Créditos a entidades gubernamentales 15,552 4,326 - 19,878
Créditos al consumo 38,552 - - 38,552
Créditos a la vivienda 215,574 10 42 215,626
Total 442,564 45,182 42 487,788

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 31 de marzo de 2024)PesosDólaresUdisTotal
Actividad empresarial o comercial 254 - - 254
Créditos al consumo 974 - - 974
Créditos a la vivienda 3,707 2 3 3,712
Total 4,935 2 3 4,940

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 31 de marzo de 2024)PesosDólaresUdisTotal
Actividad empresarial o comercial 4,995 1,371 - 6,366
Créditos a entidades financieras 56 - - 56
Créditos al consumo 941 - - 941
Créditos a la vivienda 10,191 23 6 10,220
Total 16,183 1,394 6 17,583

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)
Saldo al 31 de diciembre de 2023 17,061
Reestructuras 75
Recuperaciones (387)
Castigos y quitas (737)
Traspasos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 3 1,605
Fluctuación Tipo Cambio (34)
Saldo al 31 de marzo de 2024 17,583

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)
Saldo al 31 de diciembre de 202313,209
Más: Creación de reservas27
Calificación1,128
Menos: Adjudicaciones y otros86
Castigos y quitas714
Comercial20
Hipotecario113
Consumo581
Desliz cambiario 40
Saldo al 31 de marzo de 202413,524

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito31 mar
202331 dic
202331 mar
2024
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2
Metropolitano63.8%69.3%69.2%
Noroeste – Centro10.5%8.7%8.8%
Norte13.2%11.2%11.1%
Bajío7.3%6.3%6.3%
Sur5.2%4.5%4.6%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3
Metropolitano51.0%57.2%58.0%
Noroeste – Centro16.3%13.1%13.8%
Norte6.1%5.9%5.7%
Bajío13.0%13.5%12.6%
Sur13.6%10.3%9.9%

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

Grado de Riesgo

Importe Cartera CrediticiaReservas Preventivas Necesarias

Cartera ComercialConsumoCartera de ViviendaTotal Reservas Preventivas
No revolventesTarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes
Exceptuada calificada
Riesgo A1 443,352 933 116 476 327 1,852
Riesgo A2 62,618 570 39 212 17 838
Riesgo B1 5,552 19 52 66 17 154
Riesgo B2 7,113 18 78 36 51 183
Riesgo B3 3,888 21 24 41 41 127
Riesgo C1 3,121 2 62 75 54 193
Riesgo C2 3,976 77 40 106 232 455
Riesgo D 8,760 631 64 316 1,532 2,543
Riesgo E 9,515 3,804 665 286 2,021 6,776
Total 547,895 6,075 1,140 1,614 4,292 13,121
Exceso403
Reservas Constituidas 13,524
NOTAS:
1).Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas, son las

correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 31 de marzo de 2024.
2).La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, pudiendo calificarse por metodologías internas autorizadas por la Comisión.
La institución de crédito utiliza metodología de la CNBV para créditos a cargo personas morales y físicas con actividad empresarial distintas a entidades federativas, municipios y entidades financieras, con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales mayores o iguales a 14 millones de UDIs.
Para los portafolios de créditos a cargo de empresas con ventas menores a 14 millones de UDIs, para créditos a cargo de Entidades Federativas y Municipios, créditos para proyectos de Inversión con fuente de pago propia, créditos a cargo de Entidades Financieras, así como para la cartera de crédito menudeo, se utiliza la metodología establecida por la CNBV.
Las instituciones de crédito utilizan los grados de riesgos A-1; A-2; B-1; B-2; B-3; C-1; C-2; D; y E, para efectos de agrupar las reservas preventivas de acuerdo con el tipo de cartera y el porcentaje que las reservas representen del saldo insoluto del crédito, que se establecen en la Sección Quinta "De la constitución de reservas y su clasificación por grado de riesgo", contenida en el Capítulo V del Título Segundo de las citadas disposiciones.
3).El exceso en las reservas preventivas constituidas se explica por lo siguiente:
-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida $
14
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)
47
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3 3
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores 339
Total $ 403
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 2024 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses” son:
Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes
(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)
TítulosImporteVencimiento
B4 27070111,209,6861,85501-jul-27
BV 2707016-01-jul-27
Total11,209,6921,855

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 31 de marzo de 2024)ISRPTU
Futuros castigos de crédito4,888 1,347
Pagos anticipados(626)(172)
Comisiones cobradas por anticipado(235)(65)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo802 211
Plan de pensiones1,067 293
Provisiones y otros775 154
Otros (776)(72)

Efecto Neto en Diferido5,895 1,696

Al 31 de marzo de 2024, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.
Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 31 de marzo de 2024)
VencimientoPréstamosFinanciamientoTotal
Banca
MúltipleBanco de
MéxicoBanca de DesarrolloFondos de FomentoOtros Organismos
Pesos
Inmediato - - - - - -
Mediano - - 10,876 2,483 - 13,359
Largo - - 7,000 3,703 - 10,703
Total - - 17,876 6,186 - 24,062
Tasa Promedio0.00%0.00%12.85%10.81%0.00%
Otros
Inmediato - - - - - -
Mediano 8,315 - 13 108 - 8,436
Largo - - - 537 - 537
Total 8,315 - 13 645 - 8,973
Tasa Promedio5.84%0.00%6.56%5.92%0.00%
Total Préstamos Interbancarios 8,315 - 17,889 6,831 - 33,035
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 2024.
Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la
Captación Tradicional 31 mar
202331 dic
202331 mar
2024
Depósitos a la Vista48.1%52.3%55.3%
Metropolitano21.5%27.4%29.3%
Noroeste – Centro9.0%7.2%9.3%
Norte6.7%7.0%6.8%
Bajío5.1%5.0%4.6%
Sur5.8%5.7%5.3%
Depósitos Ventanilla42.8%39.3%40.0%
Metropolitano19.9%18.0%15.1%
Noroeste – Centro4.4%4.1%4.2%
Norte7.6%7.5%8.0%
Bajío5.3%6.0%7.1%
Sur5.6%3.7%5.6%
Total de Captación del Público90.9%91.6%95.3%
Fondeo Profesional9.1%8.4%4.7%

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional
Tasa Promedio
(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)PesosDólares
Depósitos a la vista (incluye ahorro)4.71%2.11%
Depósitos a plazo9.73%0.00%

Scotiabank-Resultados por Intermediación
(millones de pesos)31 mar
2024
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable(301)
Resultado por valuación de divisas(209)

Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados766
Resultado por compraventa de divisas502
Costos de transacción(2)
Total 756
EMISIÓN DE CERTIFICADOS BURSÁTILES
Al cierre de marzo de 2024, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

Cuarta***Primera**Segunda
Clave de PizarraSCOTIAB 23SCOTIAB 24SCOTIAB 24-2
Monto de la Emisión$7,125 millones$5,189 millones$4,811 millones
Fecha de Emisión y Colocación18 agosto
202326 febrero
202426 febrero
2024
Plazo de Vigencia de la Emisión927 días, aprox.
2.5 años1,095 días, aprox.
3 años 2,548 días, aprox.
7 años
GarantíaQuirografariaQuirografariaQuirografaria
Tasa de interésTIIE28+0.04TIIE Fondeo+0.32%9.24%
Pago de InteresesCada 28 días durante la vigencia de la emisiónCada 28 días durante la vigencia de la emisiónCada 182 días durante la vigencia de la emisión
Calificaciones otorgadas Fitch/S&PAAA(mex) /”mxAAA”AAA(mex) /”mxAAA”AAA(mex) /”mxAAA”
Amortización del principalUn sólo pago al vencimientoUn sólo pago al vencimientoUn sólo pago al vencimiento

* Programa autorizado por la CNBV en diciembre de 2018.
** Programa autorizado por la CNBV en febrero de 2024.

EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS
(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)
Fecha InicioFecha VencimientoISINPlazo Importe ($)Tasa (%)
18-diciembre-1405-diciembre-24MX0QSC1N00163,6402,093,000,0007.4
28-junio-1809-junio-33MX0QSC1N00245,4603,360,000,00012.3
11-septiembre-18PerpetuaMX0QSC1N0032-3,455,000,00011.3
Total de Obligaciones Subordinadas8,908,000,000

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados
A continuación, se detallan las emisiones de bonos bancarios estructurados con los que cuenta Scotiabank actualmente:
ClaveNúmero de títulosFecha de EmisiónVencimientoPlazo
(días)SubyacenteMonto
99_SCOTIAB_5-214,772,10029-abr-2126-abr-241093Index (IDBTVER)477,210,000
99_SCOTIAB_6-21572,30003-jun-2131-may-241093Index (IDBTVER)57,230,000
99_SCOTIAB_9-213,913,20025-nov-2122-nov-241093Index (BNPIUIL5)391,320,000
99_SCOTIAB_10-213,782,25025-nov-2122-nov-241093Index (BNPIUIL5)378,225,000
99_SCOTIAB_1-22533,20028-feb-2225-feb-251093MSFDVTHY Index53,320,000
99_SCOTIAB_5-221,238,86015-jun-2213-jun-251094MSCI USA IMI (ENHAAGE5)123,886,000
99_SCOTIAB_6-221,795,50015-jun-2213-jun-251094MSCI USA IMI (ENHAAGE5)179,550,000
99_SCOTIAB_7-22793,54016-jun-2213-jun-251093MSCI USA IMI (ENHAFOO5)79,354,000
99_SCOTIAB_8-221,027,15016-jun-2213-jun-251093MSCI USA IMI (ENHAFOO5)102,715,000

99_SCOTIAB_11-225,790,75017-nov-2214-nov-251093US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)579,075,000
99_SCOTIAB_12-22457,55018-nov-2214-nov-251092US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)45,755,000
99_SCOTIAB_13-22104,50023-nov-2221-nov-251094US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)10,450,000
99_SCOTIAB_14-22803,80019-dic-2217-dic-251094US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)80,380,000
99_SCOTIAB_1-23120,20003-mar-2303-sep-24550iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)12,020,000
99_SCOTIAB_2-235,842,85027-jul-2327-ene-25550Dólar - Peso (USDMXN)584,285,000
99_SCOTIAB_3-23423,60031-ago-2328-feb-25547Dólar - Peso (USDMXN)42,360,000
83_SCOTIAB_4-23146,26721-nov-2315-nov-24360S&P 500 Index (SPX)14,626,700
99_SCOTIAB_5-232,536,05008-dic-2307-dic-261095S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)253,605,000
99_SCOTIAB_6-231,736,60008-dic-2307-dic-261095S&P / BMV IPC (MEXBOL)173,660,000
99_SCOTIAB_7-23481,40015-dic-2314-dic-261095S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)48,140,000
83_SCOTIAB_1-241,661,85027-mar-2405-nov-24223Dólar - Peso (USDMXN)166,185,000
Total Bonos Bancarios al 31 de marzo de 20243,853,351,700

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

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

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

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

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

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

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

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

c)Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 con posterioridad al 24 de octubre de 2023, presentaron la clave de observación RA en las SIC.
En el caso que las reestructuras o renovaciones incluyan quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, el Banco podrá diferir la constitución de estimaciones preventivas para riesgos crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una estimación por la diferencia en un período que no exceda de 12 meses.

Aplicación del programa OTIS
Derivado del impacto negativo generado por los fenómenos hidrometeorológicos con afectación severa en el estado de Guerrero, México, el Banco ha determinado apoyar a sus clientes mediante la implementación de diversos programas de apoyo que serán aplicables a todos sus clientes que se encuentren en dicho estado y se suscriban al programa a partir del 24 de octubre 2023 y hasta el 30 de abril de 2024, conforme a lo siguiente:
a)CrediAuto
Diferimiento de 6 mensualidades sin capitalización de intereses. Los intereses e impuestos de esas mensualidades diferidas se prorratearon en los pagos mensuales siguientes incrementando el plazo del crédito en 6 meses más. Si el crédito llega a estar vigente (con saldo) en los 6 meses adicionales, se contratarán seguros de daños, vida y desempleo que cubran la extensión de plazo.
b)Hipotecario
Diferimiento de 6 mensualidades (los seguros se capitalizan), en este período no se considerará gasto de cobranza por pago tardío; el monto de los intereses prorrogados se distribuirá en 36 mensualidades que el cliente comenzará a cubrir en su pago mensual a partir de la cuota 13 posterior a la aplicación del diferimiento.
c)Préstamo personal y préstamo de nómina
Diferimiento de 6 meses del pago del crédito sin capitalización de intereses, el plazo del préstamo será extendido en este mismo número de meses, de acuerdo con la periodicidad del crédito, los intereses generados durante el período de apoyo se harán exigibles en las cuotas que se adicionaron al plazo original. Durante el plan no habrá afectación negativa en el historial de crédito, ni se generará marca negativa en buró de crédito.
d)ScotiaLine
El apoyo consistió en no requerir el pago mínimo de la línea de crédito revolvente del mes de noviembre 2023 al mes de abril 2024. Durante dicho período de diferimiento no se hará el cobro de la comisión de gastos de cobranza por pago tardío, no habrá afectación en el historial de crédito, ni se generará una marca negativa en él. Durante este período el saldo sigue generando intereses e IVA que serán exigibles y sumados al pago mínimo requerido en el estado de cuenta. El cliente podrá hacer disposiciones de su línea de crédito y el pago correspondiente a estas disposiciones será exigible al terminar dicho período.
e)Tarjetas de crédito
Consiste en que no se requerirá el pago mínimo de la tarjeta de crédito de noviembre 2023 a abril 2024. Durante dicho período de diferimiento no se hará el cobro de la comisión de gastos de cobranza por pago tardío, no habrá afectación en el historial de crédito, ni se generará una marca negativa. Dado que el beneficio consiste en diferir el cobro de pago mínimo sin ninguna penalización, mientras no se cubra el pago para no generar intereses se generarán los intereses ordinarios correspondientes. Los intereses generados mes a mes formaran parte del saldo revolvente y con base a dicho saldo se calculará el pago mínimo al finalizar el plan de apoyo.
Los créditos sujetos al criterio contable especial, no se consideraron como reestructuras conforme a lo establecido en el párrafo 35 del Criterio Contable B-6, Cartera de Crédito, tampoco fueron reportados como créditos en etapa 3 ante las

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

2024
Saldo con CCE OTISEfectos en Cartera y EstimaciónSaldo sin CCE OTIS

Cartera comercial$233,610-233,610
Créditos de consumo38,552(7)38,545
Créditos a la vivienda:215,626(20)215,606

Etapa 1$487,788(27)487,761

Cartera comercial254-254
Créditos de consumo9741975
Créditos a la vivienda:3,712163,728

Etapa 2$4,940174,957

Cartera comercial6,422-6,422
Créditos de consumo9416947
Créditos a la vivienda:10,220310,223

Etapa 3$17,583917,592

Cartera de crédito$510,311-510,311
(+/-) Partidas diferidas$3,303-3,303
(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios$(13,524)(11)(13,535)

Total cartera de crédito, neta$500,090(11)500,079

Total activos$822,126(11)822,115

Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados)$(1,034)(11)(1,045)

Resultado neto$2,610(11)2,599

Total capital contable$81,186(11)81,175

Total pasivo y capital contable$822,126(11)822,115

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 2024)
ReferenciaCapital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservasMonto
1Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente 13,468

2Resultados de ejercicios anteriores 56,116
3Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 11,603
4Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1
(solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones) No aplica
5Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros
(monto permitido en el capital común de nivel 1) No aplica
6Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios 81,187
Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios
7Ajustes por valuación prudencial No aplica
8Crédito mercantil
(neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -
9Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -
10
conservadorImpuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) 1,710
11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo -
12Reservas pendientes de constituir -
13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización -
14Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable No aplica
15Plan de pensiones por beneficios definidos -
16
conservadorInversiones en acciones propias -
17
conservadorInversiones recíprocas en el capital ordinario -
18
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) -
19
conservadorInversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) -
20
conservadorDerechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%) -
21Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo) -
22Monto que excede el umbral del 15% No aplica
23 del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras No aplica
24 del cual: Derechos de servicios hipotecarios No aplica
25 del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales No aplica
26Ajustes regulatorios nacionales 9,422
A del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) -
B del cual: Inversiones en deuda subordinada -
C del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras) -
D del cual: Inversiones en organismos multilaterales -
E del cual: Inversiones en empresas relacionadas -
F del cual: Inversiones en capital de riesgo -
G del cual: Inversiones en sociedades de inversión -

H del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia -
I del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones -
J del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados 8,625
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 797
27Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deduciones -
28Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1 11,132
29Capital común de nivel 1 (CET1) 70,055
Capital adicional de nivel 1: instrumentos
30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima 3,483
31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables 3,483
32 de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables No aplica
33Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1 -
34Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1) No aplica
35 del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual No aplica
36Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios 3,483
Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios
37
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1 No aplica
38
conservadorInversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1 No aplica
39
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde las Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) No aplica
40
conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido No aplica
41Ajustes regulatorios nacionales -
42Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones No aplica
43Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1 -
44Capital adicional de nivel 1 (AT1) 3,483
45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) 73,538
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas
46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima 3,476
47Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del

capital de nivel 2 -
48Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2) No aplica
49 de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual No aplica
50
conservadorReservas 339
51Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios 3,815
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios
52
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2 No aplica
53
conservadorInversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2 No aplica
54
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) No aplica
55
conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido No aplica
56Ajustes regulatorios nacionales -
57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2 -
58Capital de nivel 2 (T2) 3,815
59Capital total (TC = T1 + T2) 77,353
60Activos ponderados por riesgo totales 464,864
Razones de capital y suplementos
61Capital Común de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)15.07%
62Capital de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)15.82%
63Capital Total
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.64%
64Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)18.17%
65 del cual: Suplemento de conservación de capital2.50%
66 del cual: Suplemento contracíclico bancario específico0.00%
67 del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)0.60%
68Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)8.07%
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)
69Razón mínima nacional de CET1
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica
70Razón mínima nacional de T1
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica
71Razón mínima nacional de TC
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica
Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)
72Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras No

aplica
73Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras No aplica
74Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo) No aplica
75Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -
Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2
76Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite) 339
77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada 4,103
78Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite) -
79Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas -
Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de emero de 2022)
80Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual No aplica
81Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) No aplica
82Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual -
83Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amotizaciones y vencimientos) -
84Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual -
85Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) -

Scotiabank-Notas al formato de revelación de la integración de capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios
ReferenciaDescripción
1Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6
de las presentes disposiciones.
2Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.
3Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto
acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo,
resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remediciones por beneficios definidos
a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.
4No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos
representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté
representado por títulos representativos o acciones.
5No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este
concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.
6Suma de los conceptos 1 a 5.
7No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.
8Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes

disposiciones.
9Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
10*Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.
11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.

12*Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como aquéllas constituidas con cargo a cuentas contables que no formen parte de las partidas de resultados o del capital contable y no sólo la diferencia positiva entre las Pérdidas Esperadas Totales menos las Reservas Admisibles Totales, en el caso de que las Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital.
13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
14No aplica.
15Inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos que corresponden a los recursos a los que la Institución no tiene acceso irrestricto e ilimitado. Estas inversiones se considerarán netas de los pasivos del plan y de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo que correspondan que no hayan sido aplicados en algún otro ajuste regulatorio.
16*El monto de la inversión en cualquier acción propia que:
la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido.
17*Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión

Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.

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

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

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

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

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

Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.

21El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.

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

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

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

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

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

A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.
B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.
L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.
O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.

27No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
28Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.
29Renglón 6 menos el renglón 28.
30El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.
31Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.
32No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.
33Obligaciones subordinadas computables como Capital Básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).
34No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
35No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
36Suma de los renglones 30, 33 y 34.
37 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
38 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
39 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
40 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
41Ajustes nacionales considerados:
Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
42No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
43Suma de los renglones 37 a 42.
44Renglón 36, menos el renglón 43.
45Renglón 29, más el renglón 44.
46El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental ni en el Capital Básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
47Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
48No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

50Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.

51Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.
52 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
54 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
55 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
56Ajustes nacionales considerados:
Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
57Suma de los renglones 52 a 56.
58Renglón 51, menos renglón 57.
59Renglón 45, más renglón 58.
60Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.
61Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
62Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
63Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
64Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61, 65, 66 y 67.
65Reportar 2.5%
66Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción
III, del Artículo 2 Bis 5.
67La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
68Renglón 61 menos 7%.
69No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011.
70No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011.
71No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011.
72No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
73No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
74No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
75El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.
76Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
771.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
78Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en

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

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General
(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)
Referencias de los rubros del balance generalRubros del Balance GeneralMonto presentado en el balance general
Activo
BG1Efectivo y equivalentes de efectivo 46,028
BG2Cuentas de Margen 1,297
BG3Inversiones en instrumentos financieros 164,605
BG4Deudores por reporto 17,083
BG5Préstamo de valores -
BG6Instrumentos financieros derivados 44,897
BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros(653)
BG8Total de cartera de crédito (neto) 500,090
BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización -
BG10Otras cuentas por cobrar (neto) 26,765
BG11Bienes adjudicados (neto) 665
BG12Inmuebles, mobiliario y equipo (neto) 2,562
BG13Inversiones permanentes 4,159
BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta 14
BG15Impuestos a la utilidad diferidos (neto) 5,864
BG16Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) 2,862
Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto) 1,637
Activos Intangibles (neto) 4,584
Pasivo
BG17Captación tradicional 553,485
BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos 33,035
Valores Asignados por liquidar 7,721
BG19Acreedores por reporto 56,153
BG20Préstamo de valores -
BG21Colaterales vendidos o dados en garantía 998
BG22Instrumentos financieros derivados 41,854
BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros -
BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización -
BG25Otras cuentas por pagar 29,010
BG26Obligaciones subordinadas en circulación -
BG27Pasivo por Impuestos a la Utilidad 217
BG28Créditos diferidos y cobros anticipados 1,131
Pasivos por arrendamiento 1,794

Instrumentos Financieros que califican como pasivo 9,102
Pasivos por Beneficio a los Empleados 6,774
Capital contable
BG29Capital contribuido 13,468
BG30Capital ganado 67,717
Cuentas de orden
BG31Avales otorgados -
BG32Activos y pasivos contingentes -
BG33Compromisos crediticios 336,181
BG34Bienes en fideicomisos o mandato 480,614
BG35Agente financiero del gobierno federal -
BG36Bienes en custodia o en administración 78,725
BG37Colaterales recibidos por la entidad 24,160
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad 998
BG39Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto) -
BG40Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 1,725
BG41Otras cuentas de registro 2,116,787

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 2024)
IdentificadorConceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital NetoReferencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexoMonto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto
Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
ACTIVO
1Crédito mercantil8 -
2Otros Intangibles9 -
3Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales 10 1,710 BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) $1,710
4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización13 -
5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado15 -
6Inversiones en acciones de la propia institución16 -
7Inversiones recíprocas en el capital ordinario17 -
8Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido18 -
9Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido18
10Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido19 -
11Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido19
12Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales21 -
13Reservas reconocidas como capital complementario50 339 BG 8 Total de cartera de crédito (neto) $339
14Inversiones en deuda subordinada26-B -
15Inversiones en organismos multilaterales26-D -
16Inversiones en empresas relacionadas26-E -
17Inversiones en capital de riesgo26-F -
18Inversiones en sociedades de inversión26-G -
19Financiamiento para la adquisición de acciones propias26-H -

Gastos de Instalación $4,042
21Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)26-L -
22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos26-N -
23Inversiones en cámara de compensación26-P 797 BG 13 Inversiones Permanentes $ 797
PASIVO
24Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil8 -
25Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles9 -
26Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado15 -
27Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por beneficios definidos15
28Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los anteriores21 -
29Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R31 3,483 BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,483
30Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental33 -
31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S46 3,476 BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,476
32Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario47 -
33Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados26-J -
CAPITAL CONTABLE
34Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q1 13,468 BG 29 Capital Social $10,671 más Prima en Venta de Acciones $2,797
35Resultado de ejercicios anteriores2 56,116 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores $56,116
36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable3 828 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo $828
37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores3 10,774 BG 30 Reservas de Capital $9,112 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta ($355) más Remedición por beneficios definidos a los empleados ($592) más Resultado Neto $2,610
38Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R31 -
39Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S46 -
40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable3, 11 -
41Efecto acumulado por conversión3, 26-A -
42Resultado por tenencia de activos no monetarios3, 26-A -
CUENTAS DE ORDEN
43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas26 - K -
CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL
44Reservas pendientes de constituir12 -
45Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)26-C -
46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I -
47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M -
48Derogado

Scotiabank-Nota a los Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto
IdentificadorDescripción
1Crédito mercantil.
2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.

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

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

bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
46Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
47El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
48Derogado
Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales
(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	53,239	4,259
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	926	74
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA´s	2,372	190
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's, UMA´s o con rendimiento referido al INPC	29	2
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	7,137	571
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	1,973	158
Posición 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	203	16
Requerimiento de capital por impacto Vega	36	3

Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo

Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	33	3
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%)	817	65
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	3,612	289
Grupo III (ponderados al 25%)	1	0
Grupo III (ponderados al 50%)	1,008	81
Grupo III (ponderados al 57.5%)	22	2
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%)	3,978	318
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	1,092	87
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	1,562	125
Grupo VI (ponderados al 20%)	4,493	359
Grupo VI (ponderados al 25%)	3,127	250
Grupo VI (ponderados al 30%)	11,901	952
Grupo VI (ponderados al 40%)	12,040	963
Grupo VI (ponderados al 50%)	36,168	2,893
Grupo VI (ponderados al 70%)	37	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	28,196	2,256
Grupo VI (ponderados al 85%)	6,440	515
Grupo VI (ponderados al 100%)	45,325	3,626
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%)	141	11
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	16,823	1,346
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	135	11
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	7,086	567
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	124,056	9,924
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	627	50
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,731	138
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%)	657	53
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	7,474	598
Grupo VIII (ponderados al 150%)	4,631	370
Grupo IX (ponderados al 100%)	25,414	2,033
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	32	3
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-

Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%) - -
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%) - -
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%) - -
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas 2,582 207
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación 17 1
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega 203 16

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional
Método empleadoActivos ponderados por riesgoRequerimiento de capital
Indicador de Negocio 47,428 3,794
CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN
El índice de capitalización de Scotiabank Inverlat S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (Scotiabank) fue de 16.64% al cierre de marzo 2024, 214pb superior al mínimo requerido para la categoría I del artículo 220 de las Disposiciones Generales aplicables a las Instituciones de Crédito (14.50% Índice regulatorio más suplementos de Absorción de Pérdidas Totales y de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local).
Scotiabank-Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio
ReferenciaCaracterísticasOpciones
1EmisorScotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2Identificador ISIN, CUSIP o BloombergN.A.
3Marco legalLey de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
Tratamiento regulatorio
4Nivel de capital con transitoriedadN.A.
5Nivel de capital sin transitoriedadFundamental
6Nivel del instrumentoInstitución de crédito sin consolidar subsidiarias
7Tipo de InstrumentoAcción series "F" y "B"
8Monto reconocido en el capital regulatorio13,468,335,561
9Valor nominal del instrumentoUn Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A Moneda del instrumentoPesos mexicanos
10Clasificación contableCapital
11Fecha de emisión13-ene-01
12Plazo del instrumentoPerpetuidad
13Fecha de vencimientoSin vencimiento
14Cláusula de pago anticipadoNo
15Primera fecha de pago anticipadoN.A.
15A Eventos regulatorios o fiscalesNo
15B Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipadoN.A.
16Fechas subsecuentes de pago anticipadoN.A.
Rendimientos / dividendos
17Tipo de rendimiento / dividendoFijo o Variable
18Tasa de Interés /DividendoLa política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19Cláusula de cancelación de dividendosSujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20Discrecionalidad en el pago Parcialmente discrecional.
21Cláusula de aumento de interesesNo
22Rendimientos / dividendosNo Acumulable
23Convertibilidad del instrumentoN.A.
24Condiciones de convertibilidadN.A.
25Grado de convertibilidadN.A.

26Tasa de conversiónN.A.
27Tipo de convertibilidad del instrumentoN.A.
28Tipo de instrumento financiero de la convertibilidadN.A.
29Emisor del instrumento Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.
30Cláusula de disminución de valor (Write-Down)No
31Condiciones para disminución de valorN.A.
32Grado de baja de valorN.A.
33Temporalidad de la baja de valorN.A.
34Mecanismos de disminución de valor temporalN.A.
35Posición de subordinación en caso de liquidaciónLos títulos de las acciones están sujetos a las disposiciones que en su caso emite la Secretaría de Hacienda y Crédito Público y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, así como lo que al efecto dispongan los Estatutos Sociales.
36Características de incumplimientoNO
37Descripción de características de incumplimientoNO

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

ReferenciaDescripción

1Institución de crédito que emite el título que forma parte del Capital Neto.
2Identificador o clave del título que forma parte del Capital Neto, (ISIN, CUSIP o número identificador de valor internacional).
3Marco legal con el que el título deberá de cumplir, así como las leyes sobre a las cuales se sujetará.
4Nivel de capital al que corresponde el título que está sujeto a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
5Nivel de capital al que corresponde el título que cumple con el anexo 1-Q, 1-R, o 1-S de las presentes disposiciones.
6Nivel dentro del grupo al cual se incluye el título.
7Tipo de Instrumento de Capital o título representativo del capital social que se incluye como parte del Capital Neto. En caso de los títulos sujetos a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, establecido en la Resolución 50a, se refiere a las obligaciones subordinadas descritas en el Artículo 64 de la Ley de Instituciones de Crédito.
8Monto del Instrumento de Capital o título representativo del capital social, que se reconoce en el Capital Neto conforme al Artículo 2 bis 6 de las presentes disposiciones, en caso de que la referencia 5 sea Fundamental o Básico no Fundamental; y conforme al Artículo 2 bis 7 de las presentes disposiciones en caso de que dicha referencia sea Complementario. En cualquier otro caso, será el monto que corresponda de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
9Valor nominal del título en pesos mexicanos.
9AMoneda utilizada para expresar el valor nominal del título en pesos mexicanos conforme al estándar internacional ISO 4217
10Clasificación contable del título que forma parte del Capital Neto.
11Fecha de emisión del título que forma parte del Capital Neto.
12Especificar si el título tiene vencimiento o es a perpetuidad.
13Fecha de vencimiento del título, sin considerar las fechas de pago anticipado.
14Especificar si el título incluye una cláusula de pago anticipado por el emisor donde se ejerza el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.
15Fecha en la que el emisor puede, por primera vez, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

15AEspecificar si la cláusula de pago anticipado considera eventos regulatorios o fiscales.
15BEspecificar el precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado.
16Fechas en la que el emisor puede, posterior a la especificada en la referencia 15, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.
17Especificar el tipo de rendimiento/dividendo que se mantendrá durante todo el plazo del título.
18Tasa de interés o índice al que hace referencia el rendimiento/dividendo del título
19Especificar si el título incluye cláusulas que prohíban el pago de dividendos a los poseedores de títulos representativos del capital social cuando se incumple con el pago de un cupón o dividendo en algún instrumento de capital.
20Discrecionalidad del emisor para el pago de los intereses o dividendos del título. Si la Institución en cualquier momento puede cancelar el pago de los rendimientos o dividendos deberá seleccionarse (Completamente discrecional); si solo puede cancelarlo en algunas situaciones (Parcialmente discrecional) o si la institución de crédito no puede cancelar el pago (Obligatorio).
21Especificar si en el título existen cláusulas que generen incentivos a que el emisor pague anticipadamente, como cláusulas de aumento de intereses conocidas como "Step-Up".
22Especificar si los rendimientos o dividendos del título son acumulables o no.
23Especificar si el título es convertible o no en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.
24Condiciones bajo las cuales el título es convertible en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.
25Especificar si el título se convierte en su totalidad o solo una parte cuando se satisfacen las condiciones contractuales para convertir.
26Monto por acción considerado para convertir el título en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero en la moneda en la que se emitió dicho instrumento.
27Especificar si la conversión es obligatoria u opcional.
28Tipo de acciones en las que se convierte el título.
29Emisor del instrumento en el que se convierte el título.
30Especificar si el título tiene una característica de cancelación de principal.
31Condiciones bajo las cuales el título disminuye su valor.
32Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el título baja de valor en su totalidad o solo una parcialmente.
33Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el instrumento baja de valor permanente o de forma temporal.
34Explicar el mecanismo de disminución de valor temporal.
35Posición más subordinada a la que está subordinado el instrumento de capital que corresponde al tipo de instrumento en liquidación.

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

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto
(millones de pesos al 31 de marzo de 2024)
Ref.RUBROMar-241)
TDic-23
T-1Sep-23
T-2Jun-23
T-3Mar-23
T-4

1Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones 15,792 16,280 7,799 7,585 7,638
1ªNo aplica
2Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo 464,864 471,664 461,662 456,829 459,745
3Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)3.25%3.25%1.63%1.63%1.63%
3aNo aplica
4Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones 842,238 868,289 831,882 809,032 814,737
5"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)1.88%1.88%0.94%0.94%0.94%
5aNo aplica
6aComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNoNoNo
6bComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNoNoNo
6cEn el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?0%0%0%0%0%
1).El Banco al considerarse una institución de Importancia Sistémica Local debe de constituir el suplemento al capital neto en un plazo de cuatro años:

AUMENTOS Y/O DISMINUCIONES DE CAPITAL

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

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

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

Mediante Asamblea General Extraordinaria de Accionistas de fecha 22 de noviembre del

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

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

SCOTIABANK INVERLAT / ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en equipos expertos por tipo de riesgo, lo anterior para garantizar una gestión adecuada tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

Finalmente, la gestión de riesgos está en función de mejores prácticas internacionales pues se cuenta con un marco normativo que cumple con la regulación local y con

estándares y lineamientos corporativos establecidos por BNS.
Riesgo de mercado
La administración del riesgo de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en las tasas de interés, tipos de cambio, precios del mercado accionario, índices y otros factores de riesgo en los mercados de dinero, cambios, capitales y productos derivados a los que están expuestas las posiciones de negociación del Banco.
Las posiciones de riesgo del Banco incluyen instrumentos de mercado de dinero de tasa fija y flotante, acciones, posiciones cambiarias y derivados tales como futuros de tasas de interés, contratos adelantados, opciones de divisas, swaps de tasas de interés, opciones de tasas de interés y swaps de moneda extranjera. Se tienen límites establecidos y aprobados para cada uno de los portafolios.
Para la administración del riesgo de mercado es extraída la información de los diversos aplicativos y sistemas con los que cuenta la institución, asimismo a través de sistemas especializados se realizan las estimaciones relativas al riesgo de mercado, tales como valor en riesgo, sensibilidades y pruebas de estrés.
La estructura de límites de riesgo de mercado contempla montos volumétricos o nocionales de valor en riesgo (VaR), de sensibilidad, de concentración, límites de estrés y de plazo, entre otros. Para el cálculo del VaR se utiliza la metodología de simulación histórica con 300 días. La política del Grupo Financiero para el cálculo del VaR usa como referencia un 99% de nivel de confianza y un día como período de tiempo.
El VaR global de un día para el Banco al cierre de marzo de 2024 fue de $16.67 millones y su promedio durante el primer trimestre de 2024 fue de $14.52 millones mismo que corresponde a un 0.018% del capital neto ($80,381 millones a febrero 2024, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del primer trimestre de 2024 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)Cierre
Marzo 2024Promedio
Factor de Riesgo
Tasas de interés
Derivados1,309,7461,242,575
Mercado de Dinero 53,01954,375
Tipo de cambio
Cash4,3983,392
Derivados207,927189,952
Capitales
Derivados9,55910,542

VaR 1 día (millones de pesos)Cierre
Marzo 2024Promedio
Factor de Riesgo
Tasas de interés17.0613.24
Tipo de cambio2.416.92
Capitales0.000.00
VaR Global16.6714.52
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 2024 muestra una pérdida máxima de $269.79 millones. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, México 1994 por el denominado “Error de

diciembre" y México 1997 por el efecto de la "crisis del rublo" y la crisis financiera asiática.
Asimismo, mensualmente se realizan pruebas de "backtesting" para comparar las pérdidas y ganancias teóricas y reales con el valor en riesgo observado y, en consecuencia, en su caso calibrar los modelos utilizados. El nivel de eficiencia del modelo se basa en el enfoque establecido por el BIS. Respecto de las pruebas de backtesting, durante el primer trimestre de 2024, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.
Riesgo de liquidez y tasas de interés
El Banco administra su exposición al riesgo de liquidez y de tasa de interés conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado, considerando las posiciones para el manejo estructural del balance.
Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se han establecido límites, los cuales son revisados al menos de manera anual y monitoreados de manera periódica a fin de que los mitigantes del riesgo estén actualizados y sean precisos. Entre los límites aplicables se encuentran aquellos relacionados a activos líquidos, brechas de liquidez, sensibilidad del margen y sensibilidad del valor económico, mismos que se encuentran alineados con el apetito de riesgo de la institución.
La estructura de límites de riesgo de liquidez y tasas de interés contempla montos nocionales, así como de plazo y concentración; de manera periódica se informa al Comité de Activos y Pasivos, Comité de Riesgos y al Consejo de Administración sobre el desempeño de dichos límites, así como de los indicadores en materia de riesgo de liquidez y tasas de interés.

Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés la información es extraída de los diversos aplicativos y sistemas con los que cuenta la institución, asimismo a través de sistemas especializados se realizan las estimaciones relativas al riesgo de liquidez y tasas de interés.
En adición, es importante señalar que para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se cuenta con métricas prospectivas, las cuales son incorporadas en el ejercicio anual del Plan de Exposiciones, Ejercicios de Suficiencia de Capital Bajo Escenarios propios y regulatorios, así como el Plan de Contingencia (para riesgos de solvencia y liquidez) de la institución; y con pruebas bajo escenarios extremos y pruebas de backtesting. Se destaca que los modelos utilizados para la gestión del riesgo de liquidez y tasas de interés son revisados al menos de manera anual.
El Banco asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que el Banco pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles, para lo cual el Banco aplica controles a las brechas de liquidez, monitorea indicadores clave de liquidez, mantiene fuentes diversificadas de fondeo, establece límites y mantiene un porcentaje mínimo de activos líquidos.
El riesgo de liquidez se monitorea y controla mediante brechas de liquidez acumuladas. Estas brechas se construyen a través de los vencimientos y flujos por pagos de los diferentes instrumentos del balance, tanto activos como pasivos, creando así una brecha diaria que corresponde a la diferencia de las obligaciones de pago y derechos de cobro generados día a día. Las brechas de liquidez incluyen los flujos de vencimiento contractuales del Banco (entradas y salidas de efectivo). Las brechas de liquidez son estimadas bajo lineamientos corporativos que consideran condiciones normales de mercado y son distintas de aquellas brechas calculadas para la estimación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez, en virtud de que éstas últimas incluyen factores de estrés tanto para los flujos de entrada como de salida.
Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de marzo 2024 así como el promedio del primer trimestre de 2024 se muestran a continuación:
Scotiabank
(millones de pesos)Posición

(Cierre) Posición
(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US43,17868,788
Liquidity Buffer
(bajo métrica CCL)134,322127,518

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales, incluyendo posiciones de derivados de cobertura. Adicionalmente, las exposiciones de riesgo de liquidez se encuentran dentro de los límites aprobados.

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el primer trimestre de 2024 de 152% y 113% respectivamente.

Por otro lado, el riesgo de tasas de interés deriva de la incertidumbre en las utilidades y/o valor del portafolio como resultado de movimientos en las tasas de interés, y se presenta cuando existen desfasamientos (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.

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de marzo 2024 y en promedio para el primer trimestre de 2024 es la siguiente:

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Valor Económico (+100 pbs) (1,612)(1,622)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)(291)(227)

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

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre)Posición

(Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender1).94,17293,678
Derivados de Cobertura86,94587,967
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 2024 y el promedio del primer trimestre del 2024 fueron $3,911 millones y $3,430 millones, respectivamente.
RIESGO DE CRÉDITO
Pérdida potencial por falta de pago de un acreditado o por el incumplimiento de una contraparte en las operaciones financieras que efectúa el Banco en carteras de crédito, cartera de valores, operaciones con derivados, etc.

La gestión del riesgo de crédito del Banco se basa en diversas estrategias como la centralización de los procesos de crédito, la diversificación de la cartera, análisis de crédito, estrecha vigilancia y un modelo de calificación de riesgo crediticio, esta gestión de riesgo de crédito incorpora instrumentos financieros.
La facultad para la autorización de créditos es responsabilidad del Consejo de Administración, quien delega esta función en los distintos niveles de resolución. Estos niveles de resolución funcionan mediante facultades mancomunadas con lo cual no se permite que un solo funcionario autorice un crédito, es decir, al menos dos funcionarios deben autorizar un crédito. Los niveles de autorización se asignan de acuerdo con la clasificación del riesgo, monto del crédito, tipo de cliente y/o naturaleza de la Presentación de Crédito (tales como crédito nuevo, incremento del crédito o revisión anual).
Para la administración del riesgo de crédito, la información se extrae de los diversos aplicativos y sistemas con los que cuenta la institución, asimismo, es a través de sistemas especializados donde se realizan estimaciones tales como la pérdida esperada, no esperada y la exposición potencial futura para el riesgo crédito de contraparte.
En el caso de la cartera comercial, las áreas de negocio y crédito evalúan constantemente la situación financiera de cada cliente, realizando cuando menos una vez al año una revisión exhaustiva y un análisis del riesgo de cada acreditado. En estas revisiones se considera el riesgo de crédito global, incluyendo operaciones con instrumentos financieros y derivados. En el caso de riesgos identificados, se realizan revisiones complementarias con mayor frecuencia. Para el caso de cartera hipotecaria y de consumo, se tienen modelos de originación que evalúan la calidad crediticia de los acreditados y se cuenta también con políticas y procedimientos establecidos para gestionar los procesos de autorización de nuevos créditos y dar seguimiento a la calidad crediticia de los distintos portafolios de crédito.
Concentraciones de riesgo crediticio- El Banco ha implementado políticas y procedimientos para mantener un portafolio sano, diversificado y con riesgo prudente y controlado, entre las que destacan el establecimiento de límites de exposición al riesgo crediticio, por unidades de negocio, moneda, plazo, sector, etc. Los límites se autorizan anualmente por el Comité de Riesgos y/o por el Consejo de Administración; su comportamiento es vigilado e informado mensualmente al Comité de Riesgos y en su caso, de manera trimestral al Consejo de Administración.
Metodología para identificar, cuantificar, administrar y controlar el riesgo de crédito- El proceso de establecimiento de límites de exposición a cada tipo de portafolio sujeto a riesgo crédito contempla el análisis de la información e identificación de los riesgos inherentes a cada acreditado, documentado en políticas

con base en un proceso de autorización y revisión continua. Todas las exposiciones de crédito incluyendo instrumentos financieros y derivados son monitoreadas por la UAIR; el proceso de monitoreo considera informar al Comité de Riesgos y al Consejo de Administración el consumo de los límites, los excesos observados a los mismos y las estrategias implementadas para el restablecimiento de parámetros. Asimismo, el Consejo delega al Comité de Riesgos la facultad de autorización de límites específicos y actualizaciones a las metodologías utilizadas para la administración de riesgo crédito y contraparte.
Metodología para determinar las estimaciones preventivas para riesgos crediticios El Banco cuenta con un sistema de clasificación de riesgos crediticios aprobado a nivel institucional para cartera Comercial y modelos de score y/o métricas de seguimiento de desempeño para la cartera de Menudeo. También se cuenta con procesos y sistemas que permiten clasificar la cartera por nivel de riesgo y estimar sus reservas conforme a los modelos regulatorios de CNBV.
Se utilizan las siguientes Agencias Calificadoras en el método estándar: S&P, MOODY´S, FITCH, HR RATINGS, A.M. Best y DBRS, con base al Anexo 1-B de la CNBV "Mapeo de Calificaciones y Grados de Riesgo".
La calificación de agencias calificadoras es utilizada por el Banco para el cálculo de la Probabilidad de Incumplimiento en:
•Estados y Municipios.
•Admisibilidad de garantes que cuenten con calificación global a largo plazo grado de riesgo 1 y 2.
•Clientes con domicilio en el extranjero y que no cuenten con información de experiencia de pago dentro de las Sociedades de Información Crediticia nacionales, que cuenten con calificación global a largo plazo grado de riesgo 1 y 2.

Las estimaciones para la cartera comercial se basan en la evaluación individual del riesgo crediticio de los deudores y su clasificación, en apego a la CUB (metodología estándar). Se exceptúa de calificar a la cartera garantizada o a cargo del Gobierno Federal, del Banco de México y del Instituto para la Protección al Ahorro Bancario, de acuerdo con las Reglas para la calificación de la Cartera Crediticia de las Instituciones de Banca Múltiple.
Proceso de administración y reconocimiento de la cobertura para el riesgo de crédito. El Banco tiene implementadas políticas para la evaluación de las garantías, mismas que implican la revisión de cada uno de los elementos y riesgos relacionados dependiendo de su tipo, considerando tanto las políticas para garantías, como las correspondientes al análisis y evaluación de crédito. El Banco aplica controles en la evaluación de los garantes / obligados identificando el detalle de la estructura corporativa, así como cualquier aspecto de subordinación significativa que afecte el respaldo otorgado.
La calificación de crédito del garante u obligado se determina de forma continua y consistente durante la vigencia del crédito.
Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del primer trimestre corresponde a $15 millones; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.
Mecanismos de control de los sistemas de calificación, incluido un análisis de su independencia, responsabilidad y evaluación. El Banco cuenta con diversos aplicativos para el control de los sistemas de calificación y el registro adecuado y completo de las características y requisitos de cada garantía, que se encuentra definido en el catálogo institucional de garantías, así como procesos de solicitud y autorización de crédito.
Los sistemas referidos realizan la clasificación de los portafolios y califican a los créditos bajo la metodología estándar de la CNBV. El cálculo de reservas de los acreditados pertenecientes a las carteras de consumo e hipotecas, además de la cartera de crédito comercial se realiza con base en las metodologías regulatorias publicadas en

la CUB, mismas que se basan en el cálculo de la Pérdida Esperada para cada uno de los créditos a partir de parámetros de Probabilidad de Incumplimiento (PI), Severidad de Pérdida (SP) y Exposición al Incumplimiento (EI) empleando información y características específicas de los créditos y/o acreditados evaluados.
Constitución de reservas adicionales por emergencia sanitaria virus SARS-CoV2 (COVID-19)
Al cierre del primer trimestre de 2024, el Banco mantiene $334 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.
INFORMACIÓN METODOLÓGICA
La medición y el monitoreo del riesgo de crédito se basa en un modelo de pérdida esperada y pérdida no esperada, cuyo cálculo es realizado en una herramienta especializada interna, robusta y de uso institucional.
•La pérdida esperada representa el monto que el Banco espera perder durante los próximos doce meses por concepto de incumplimientos dadas las características de sus carteras. Es igual al resultado de multiplicar la exposición al incumplimiento (EI), la probabilidad de incumplimiento (PI) y la severidad de la pérdida (SP) de las exposiciones crediticias.
•La pérdida no esperada, es una medida de dispersión alrededor de la pérdida esperada. Representa el capital económico necesario para mantener solvente a la Institución en caso de un evento adverso de gran magnitud que impacte las carteras crediticias.

Adicionalmente, se realizan pruebas bajo condiciones extremas para determinar su impacto sobre la pérdida esperada y no esperada del portafolio.
Métricas Riesgo de Crédito1).
(Cifras al 31 de marzo 2024)Pérdida EsperadaPérdida no Esperada
Hipotecas0.29%2.80%
Consumo3.77%15.57%
Cartera Comercial0.58%4.19%
Total0.70%4.46%
1).Excluye cartera en etapa de riesgo 3.y/o en incumplimiento El cálculo incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos inter-compañía.

Parámetros de Riesgo1).
(Cifras a millones al 31 de marzo 2024)EI2).PISP
Hipotecas219,3381.62%16.86%
Consumo57,4844.75%72.19%
Cartera Comercial277,5701.43%43.99%
1).EI (Exposición al Incumplimiento) calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en etapa de riesgo 3 o en incumplimiento.
2).Incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos Inter compañía.
TÉCNICAS DE MITIGACIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO
El Banco cuenta con políticas y procesos que le permite realizar una valoración de las garantías. En general se puede considerar que no existen restricciones respecto de la aceptación de garantías; no obstante, de forma previa a su aceptación, es necesario valorar los impactos que se tendrán en términos de rentabilidad, y como mitigante en mediciones de riesgo y cálculos regulatorios de reservas preventivas y requerimientos de capital.
La mayor parte de la concentración de garantías con las que cuenta el Banco, para mitigar el riesgo de crédito corresponden a garantías reales no financieras.
La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de marzo de 2024.
POLÍTICAS PARA ASEGURAR LAS GARANTÍAS REALES Y ESTABLECER RESERVAS DE CRÉDITO
Las garantías que cubren los créditos, dependiendo de su tipo y características pueden mejorar el nivel de riesgo de crédito y por consecuencia el monto de las reservas requeridas. Para estos efectos se consideran dos tipos de garantías: personales y

reales.
Las garantías que se utilicen para mejorar la calificación de crédito, en adición a los requisitos específicos para su tipo (personal o real), de forma general deben cubrir lo siguiente:
•La garantía esté otorgada y constituida en la forma y términos establecidos en las disposiciones legales aplicables y las políticas internas del Banco.
•Cuando un crédito esté cubierto por garantías del tipo real y personal; y están otorgadas simultáneamente por el mismo garante personal, sólo una de ellas puede mejorar la calificación.
En créditos sindicados con otra(s) Institución(es) de Crédito, el Banco podrá pactar los siguientes derechos, en el contrato de crédito correspondiente: El primer lugar en el orden al cobro sobre la garantía; o el mismo grado de prelación en el orden al cobro que los demás participantes, en los casos en que la garantía esté asignada de forma proporcional entre todas las Instituciones que participen en el crédito.

RIESGO DE CRÉDITO EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS
Constantemente se evalúa la situación financiera de cada cliente, emisor y contraparte y al menos una vez al año se realiza una revisión exhaustiva y análisis del riesgo. Estas revisiones consideran el riesgo de crédito global, incluyendo operaciones con instrumentos financieros, derivados y cambios.
Al cierre de marzo 2024 y en promedio durante el primer trimestre de 2024, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.38% y 0.42% respectivamente.
RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES DE DERIVADOS
Adicionalmente a las medidas de riesgo mencionadas anteriormente y para operaciones con derivados, el Banco cuantifica sus exposiciones de crédito con la finalidad de controlar el uso de líneas otorgadas a sus contrapartes para la operación de instrumentos derivados. Este control es llevado a cabo mediante el cálculo de la exposición potencial futura (PFE) a nivel contraparte a través de herramientas especializadas, incorporando elementos mitigantes de riesgo tales como acuerdos de compensación, contratos de garantías y colaterales. Se cuenta con políticas de riesgo de contraparte y de monitoreo de límites establecidas que contemplan el proceso a seguir en caso de presentarse excesos en los mismos.
METODOLOGÍA PARA ESTABLECIMIENTO DE LÍMITES DE CRÉDITO PARA CONTRAPARTES Y ASIGNACIÓN DE CAPITAL
El Banco, mediante el establecimiento de políticas de operación, define la asignación de capital con base en criterios de negocio y apetito de riesgo, es decir, a través de políticas y una evaluación de crédito se definen los criterios de elegibilidad de clientes y el establecimiento de límites máximos de exposición considerando como principal parámetro de riesgo la exposición potencial futura de cada contraparte, estimada de acuerdo con la metodología aprobada por el Comité de Riesgos.
Es importante destacar que previo a cualquier operación que implique riesgo de crédito, se tiene un proceso de revisión de los acreditados/contrapartes para evaluar su perfil de riesgo y definir el límite de exposición aceptado con cada uno.
Una vez aprobados los límites, son monitoreados por la UAIR y revisados de manera anual por el área de Crédito o con mayor frecuencia en caso de que se detecte algún riesgo potencial o bien la línea de negocio así lo solicite.
El requerimiento de capital para operaciones con derivados se calcula bajo metodología regulatoria, tal es el caso del valor ajustado por valuación crediticia o CVA por sus siglas en inglés.
Asimismo, se cuenta con lineamientos de BNS para identificar el riesgo de correlación adversa durante el proceso de autorización de crédito para operaciones con contrapartes.
RIESGO OPERACIONAL
El riesgo operacional es un riesgo no discrecional que se define como la pérdida

potencial por fallas o deficiencias en los controles internos, por errores en el procesamiento y almacenamiento de las operaciones o en la transmisión de información, así como por resoluciones administrativas y judiciales adversas, fraudes o robos, eventos externos, y comprende, entre otros, al riesgo tecnológico y al riesgo legal.
METODOLOGÍA GENERAL
El Banco ha implementado políticas y procedimientos que le permiten tener un adecuado proceso de gestión del riesgo operacional, mismos que a continuación se detallan.

POLÍTICAS PARA LA GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL
Tienen como propósito establecer los principios y el marco de gestión, para identificar, medir, monitorear, limitar, controlar, divulgar y gestionar los riesgos operacionales inherentes a sus actividades diarias, además de promover una cultura de administración de riesgos en todo el Banco.
EVALUACIÓN DE RIESGO OPERACIONAL
El Banco cuenta con una metodología estructurada de evaluación de riesgo operacional, que le permite identificar, evaluar y mitigar, los riesgos inherentes a sus procesos y su actividad de negocios misma que se aplica a toda su estructura, la evaluación se basa en la identificación del riesgo operacional inherente, la evaluación de la eficacia de los controles de dichos riesgos, con lo que se determina un nivel de riesgo residual en función del cual se establecen acciones de mitigación sobre los riesgos identificados.
MANUAL PARA LA RECOLECCIÓN Y CLASIFICACIÓN DE DATOS DE RIESGO OPERACIONAL
Define los requerimientos para reportar la información que soporta los procesos de medición, así como el alcance del proceso de recolección de información, las funciones y responsabilidades de las unidades de negocio para recolectar y reportar los datos de pérdida, y los requerimientos específicos de esta.
NIVELES DE TOLERANCIA DE RIESGO OPERACIONAL
Es una herramienta de gestión de pérdidas operacionales, que permite a cada área del Banco conocer los niveles de tolerancia de pérdidas aplicables a cada evento de pérdida asumido, así como incentivar mejoras en el proceso de gestión del Riesgo Operacional y que se adopten las acciones necesarias para minimizar el riesgo de futuras pérdidas.
INDICADORES CLAVE DE RIESGO (KRI)
Este proceso permite al Banco establecer indicadores a partir de variables extraídas de los procesos, cuyo comportamiento está relacionado con el nivel de riesgo asumido. Mediante el seguimiento de cada indicador se identifican tendencias que permiten gestionar en el tiempo los valores del indicador; se establecen umbrales admisibles para cada uno de los indicadores seleccionados.
RIESGO LEGAL
El Riesgo Legal se define como la pérdida potencial por el incumplimiento de las disposiciones legales y administrativas aplicables, la emisión de resoluciones administrativas y judiciales desfavorables y la aplicación de sanciones, en relación con las operaciones que la Institución lleva a cabo.
CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO OPERACIONAL
La Institución calcula su requerimiento de capital por riesgo operacional a través del Método del Indicador de Negocio, mismo que entró en vigor en enero 2023.
VALOR PROMEDIO DE LA EXPOSICIÓN
Durante el periodo de enero - marzo 2024, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por $103.7 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de marzo 2024 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman $61.9 millones, donde $2.5 millones corresponden al Riesgo Operacional y $59.4 millones al Riesgo Legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

RIESGO TECNOLÓGICO
El Riesgo Tecnológico se define como la pérdida potencial por daños, interrupción, alteración o fallas derivadas del uso del hardware, software, sistemas aplicaciones, redes y cualquier otro canal de transmisión de información en la prestación de

servicios a los clientes del Banco.
Para gestionar el Riesgo Tecnológico, el Banco cuenta con la Política de Gestión del Riesgo Tecnológico y de Ciberseguridad que describe las políticas y los principios generales para gestionar y vigilar los riesgos asociados con las Tecnologías de la Información y la Ciberseguridad.
Las auditorías habituales realizadas por un departamento independiente y experimentado de Auditoría Interna de Tecnologías de la Información incluyen revisiones totales del diseño, implementación y explotación de los sistemas de control interno en todas las áreas de negocio y apoyo, nuevos productos y sistemas y la confiabilidad e integridad de las operaciones de procesamiento de datos.
En la sección Estados Financieros Relación con Inversionistas del portal oficial de Scotiabank, se presenta información adicional con la finalidad de dar cumplimiento a la totalidad de requerimientos establecidos en el artículo 88 de la CUB sobre la revelación de información relativa a los distintos tipos de riesgo gestionados por la Institución.

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)
Periodo Reportado: enero 2024 – marzo 2024 (T1 2024)
Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

	Calculo Individual T1 2024		Calculo Consolidado T1 2024	
(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOSCOMPUTABLES				
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	114,362.12	No aplica	114,362.12
SALIDAS DE EFECTIVO				
2	Financiamiento minorista no garantizado	165,826	13,362	165,826	13,362
3	Financiamiento estable	97,220	6,501	97,220	6,501
4	Financiamiento menos estable	68,606	6,861	68,606	6,861
5	Financiamiento mayorista no garantizado	269,908	100,986	269,908	100,986
6	Depósitos operacionales	139,621	34,144	139,621	34,144
7	Depósitos no operacionales	123,550	60,106	123,550	60,106
8	Deuda no garantizada	6,736	6,736	6,736	6,736
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	500	No aplica	500
10	Requerimientos adicionales:	244,821	17,619	244,821	17,619
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,125	5,547	7,125	5,547
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	0	0	0	0
13	Líneas de crédito y liquidez	237,695	12,065	237,695	12,065
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	185	185	185	185
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,854	2,854	2,854	2,854
16	TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	135,505	No aplica	135,505
ENTRADAS DE EFECTIVO				
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	7,215	7,917	7,215	7,917
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	50,114	31,950	50,114	31,950
19	Otras entradas de efectivo	16,263	16,263	16,263	16,263
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	73,591	48,872	73,591	48,872
	Importe ajustado				
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	131,723	No aplica	131,723
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	86,633	No aplica	86,633
23	COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]	No aplica	151.78	No aplica	151.78

a) Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando.
91 días naturales
b) Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

(CCL) y la evolución de sus principales componentes.

Durante marzo 2024, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):
Principales Salidas de Efectivo:
Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por $74,005 millones y depósitos a plazo tradicionales por $34,877 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por $1,904 millones y $3,911 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por $12,181 millones.
Principales Entradas de Efectivo:
Entradas por flujo de carteras de $19,947 millones y por operaciones de call money de $10,653 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por $14,918 millones.
Activos Líquidos:
Activos Líquidos totales de $135,059 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; $98,605 millones en títulos de deuda de nivel 1, $25,319 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por $8,022 millones y $3,664 millones en títulos de nivel 2.
c)Los cambios de los principales componentes dentro del trimestre que se reporte;

Promedio del cuarto trimestre 2023: 150% – promedio del primer trimestre 2024: 152%
El coeficiente de cobertura de liquidez incrementó 200 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:
•En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron $3,998 millones y los depósitos en bancos crecieron en MXN $7,015 millones.
•Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de $12655 millones.
•Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en $22,459 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en $7,982, millones.

d)La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables ;
Evolución de Activos Líquidos T1-2024EneroFebreroMarzo
Efectivo 6%6%6%
Reservas en el Banco Central37%28%19%
Nivel 155%64%73%
Nivel 2ª2%2%2%
Nivel 2B0%0%0%
Total de Activos Líquidos Ponderados100%100%100%

e)La concentración de sus fuentes de financiamiento;
Concentración de fuentes de FinanciamientoEneroFebreroMarzo
CAPTACION TRADICIONAL
Depósitos de exigibilidad inmediata48%47%50%
Depósitos a plazo
Del público en general37%38%36%
Mercado de dinero7%5%4%
Títulos de crédito emitidos2%4%4%
Cuenta global de captación sin movimientos0%0%0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS
De exigibilidad inmediata0%0%0%

De corto plazo4%4%4%
De largo plazo2%2%2%
Total100%100%100%

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

•El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo con las políticas establecidas.
•Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:
•Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo-rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.
•Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.
•Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
•Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.
Los derivados operados podrán ser clasificados como de negociación, cobertura o arbitraje.
El Banco cuenta con políticas y manuales, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y a la administración de derivados. Entre los procedimientos aplicables para el monitoreo y mitigación de los riesgos asociados a los derivados se calcula la exposición potencial futura, se monitorean el colateral asociado, posibles llamadas de margen y como medida conservadora y a manera de estar preparados para un posible aumento de requerimientos de liquidez como resultado de una posible baja en calificación del Banco se calcula periódicamente el impacto potencial en aumento en colaterales.
Exposición Potencial Futura (marzo 2024)
(Cifras en millones de pesos)
Con contrato de compensación2,716
Sin contrato de compensación8,189
Posibles llamadas de margen (marzo 2024)
Colateral en Tránsito21
Downgrade (marzo 2024)
Baja calificación 3 niveles3, 911

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de marzo 2024 es la siguiente:
Scotiabank-Exposición en Derivados
(cifras en millones de pesos)Posición Cierre
Factor de Riesgo
 Tasas de interés 1,309,746
 Tipo de cambio 207,927
 Capitales 9,559
Total1,527,232
g)El descalce en divisas;
La política general es fondear los activos con la misma moneda en que se otorguen.
h)Una descripción del grado de centralización de la administración de la liquidez y la interacción entre las unidades del grupo;
Dentro del grupo existe una unidad encargada de la gestión de la liquidez, Tesorería Grupo, en cuya responsabilidad está cubrir los excedentes y faltantes de la liquidez de

la institución, para lo cual recibe información de forma diaria acerca de los flujos contractuales que tendrán lugar en un día corriente de mercado, así como las expectativas de liquidez de corto y mediano plazo esperadas para los principales productos.
Las diferentes áreas del banco generadoras de negocios tienen que informar con anticipación al menos 24-48 horas en los diferentes comités (pipeline) o directamente a la Tesorería de Grupo su estrategia de corto, mediano y largo plazo, a fin de que la misma programe su estructura de fondeo para hacer frente a dichos compromisos.
i)Los flujos de efectivo de salida y de entrada que, en su caso, no se capturen en el presente marco, pero que la Institución considera relevantes para su perfil de liquidez.
Es relevante mencionar que para el cálculo del coeficiente de cobertura de liquidez se registran los flujos de efectivo de salida y de entrada a nivel contractual; no obstante la institución de manera diaria calcula las brechas de liquidez considerando no solo los flujos de efectivo de salida y entrada a nivel contractual sino que también considera flujos estimados, en adición extiende la programación de flujos a un periodo de más allá de 30 días, por lo que la institución tiene la posibilidad de anticipar y tomar medidas a fin de hacer frente a los compromisos posteriores a este periodo.
j)El impacto en el Coeficiente de la incorporación de las Entidades Objeto de Consolidación, así como de las salidas derivadas del apoyo financiero a entidades y sociedades que formen parte del mismo grupo financiero, consorcio o grupo empresarial que, de acuerdo con las Políticas y Criterios, el consejo de administración de la Institución haya autorizado otorgar.
El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el primer trimestre del 2024, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de 5% al cierre de marzo del 2024 y en promedio durante primer trimestre del 2024 fue de 7%.
Asimismo, las Instituciones deberán como mínimo revelar la información que corresponda al trimestre inmediato anterior que al que se revele, conforme a lo siguiente:

I. Información cuantitativa:
a)Los límites de concentración respecto de los distintos grupos de garantías recibidas y las fuentes principales de financiamiento;
Dentro de las políticas aprobadas por la institución en términos de liquidez, se encuentra establecido que la institución tendrá una baja dependencia del mercado mayorista, así como, mantener diversificadas las fuentes de fondeo y una baja concentración de recursos en depositantes específicos. Esta diversificación, no solo se realiza por fuentes de fondeo, sino por plazos y variedad de productos.
En adición, también se establece la calidad crediticia mínima de las garantías recibidas. Estas garantías no podrán ser inferiores a una calificación de crédito nivel A.
Adicionalmente, la institución establece límites de concentración de depósitos con la finalidad de asegurar la diversificación de sus fuentes de fondeo entre sus monedas relevantes.
Concentración de Depósitos Límite MM
Concepto
Concentración de Depósitos (MXN)9,500 MXN
Concentración de Depósitos (USD)175 USD
Por otro lado, la institución monitorea el potencial future exposure (PFE) a nivel contraparte para la operación de instrumentos financieros derivados y por otro lado cuenta con límites de crédito para monitorear la exposición al riesgo de crédito de contraparte.
La exposición al riesgo liquidez y las necesidades de financiamiento son monitoreadas teniendo en cuenta posibles limitaciones legales, regulatorias y operacionales; para esto el Banco asume una política prudente de riesgos de manejo de liquidez;

adicionalmente se han establecido límites internos de brechas de liquidez y activos líquidos. Los descalces de liquidez se muestran en el siguiente inciso.
Las exposiciones al riesgo de liquidez son cubiertos desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.
Actualmente el cálculo del CCL incorpora posiciones de la entidad legal banco y sus subsidiarias.
b)La exposición al riesgo liquidez y las necesidades de financiamiento a nivel de la Institución, teniendo en cuenta las limitaciones legales, regulatorias y operacionales a la transferibilidad de liquidez.
Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con las siguientes exposiciones a finales de marzo 2024.

Descripción Promedio
T1 2024Marzo 2024
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)41,34725,801
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)87,640114,336
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)4140
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)4139
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)4140
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)4139
c)Las operaciones del balance desglosadas por plazos de vencimiento y las brechas de liquidez resultantes, incluyendo las operaciones registradas en cuentas de orden.
Para tener un control sobre el descalce generado por la naturaleza del balance entre activos y pasivos, Scotiabank establece límites para sus brechas de liquidez en diferentes plazos. Asimismo, el banco monitorea las brechas diarias durante los próximos 360 días, con la finalidad de tener un panorama más amplio de las obligaciones que la institución tiene a más de 30 días; las brechas incorporan posiciones activas y pasivas del balance, así como posiciones fuera del mismo.
Los resultados al cierre de marzo 2024 y el promedio del primer trimestre de 2024 son
Scotiabank Posición
(Cierre) Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)43,17868,788
Liquidity Buffer
(bajo métrica CCL)134,322127,518
Asimismo, el banco monitorea brechas diarias durante los próximos 360 días, con la finalidad de tener un panorama más amplio de las obligaciones que la institución tiene a más de 30 días.
II. Información cualitativa
a)La manera en la que se gestiona el riesgo de liquidez en la Institución, considerando para tal efecto la tolerancia a dicho riesgo; la estructura y responsabilidades para la administración del riesgo de liquidez; los informes de liquidez internos; la estrategia de riesgo de liquidez y las políticas y prácticas a través de las líneas de negocio y con el consejo de administración;
Uno de los principales objetivos de Scotiabank es la generación de valor para sus accionistas manteniendo la estabilidad y solvencia de la organización.
Los principios del proceso de Administración de Riesgo de Liquidez son:
•Asegurar un gobierno y supervisión del Riesgo de liquidez, incluyendo lineamientos claros de roles y responsabilidades para asegurar que el monitoreo, valuación, contabilización, medición de riesgo, y procesos de gestión de riesgo, sean conducidos y

reportados independientemente.
•Identificar, medir y administrar la relación riesgo/rendimiento, dentro de los límites de tolerancia y apetito al riesgo establecidos por el Consejo de Administración, asegurando que estas actividades se realicen de manera prudente.

Dentro del Grupo Financiero existe una unidad encargada de la gestión de la liquidez, el área Tesorería Grupo, cuya responsabilidad es cubrir los excedentes y faltantes de liquidez de la institución, para lo cual recibe información de forma diaria acerca de los flujos contractuales que tendrán lugar en un día corriente de mercado, así como las expectativas de liquidez de corto y mediano plazo esperadas para los principales productos. Por otro lado el área de Administración del Riesgo de Liquidez tiene la responsabilidad de velar por que los principales indicadores de liquidez se encuentren bajo los límites aprobados y a su vez se encuentren alineados con el apetito de riesgo de la institución, para tales efectos el área de Administración del Riesgo de Liquidez produce información periódica relativa activos líquidos y brechas de liquidez; en caso de que hubiese alguna desviación, debe notificar a Tesorería Grupo y área involucradas con la finalidad de corregir cualquier desviación que pudiera impactar a la liquidez estructural de la institución.
En secciones posteriores se enuncian los informes internos de liquidez, así como las políticas puestas en marcha que tienen como finalidad la Administración Integral del Riesgo de Liquidez.
b)La estrategia de financiamiento, incluyendo las políticas de diversificación, y si la estrategia de financiamiento es centralizada o descentralizada;
La estrategia de fondeo es determinada por Tesorería Grupo de la institución, pero consensada y autorizada por el Comité de Activos y Pasivos. Donde participan diversas áreas del banco incluyendo áreas de negocio.
c)Las técnicas de mitigación del riesgo de liquidez utilizadas por la Institución;
La institución monitorea el riesgo de liquidez a través de distintas métricas e informes alineados con el apetito del riesgo las cuales contemplan:
•Cálculo de CCL (Coeficiente de Cobertura de Liquidez)
•Cálculo de CFEN (Coeficiente de Financiamiento Estable Neto)
•Cómputo de Activos Líquidos
•Cálculo de LDR (Loan to Deposit Ratio)
•Monitoreo de la concentración de fondeo profesional
•Monitoreo de Brechas de Liquidez
•Monitoreo de Concentración de Depósitos
•Monitoreo de Depósitos con Bancos
•Monitoreo del Portafolio de Inversión
•Monitoreo de créditos cedidos como garantía de fondeo
•Pruebas de Estrés de Liquidez
•Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez
•Reportes periódicos al Comité de Activos y Pasivos de la Institución
•Reportes periódicos al Comité de Riesgos
•Reportes al Consejo de Administración
•Políticas y Manuales alusivos a la Administración del Riesgo de Liquidez
•Plan de Contingencia para Riesgos de Solvencia y Liquidez

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

•Medición, supervisión y pronóstico de compromisos que involucren flujos de efectivo para las principales monedas manejadas por el Banco (MXP+UDIs y USD).
•Procurar una distribución uniforme de los flujos de efectivo, minimizando las brechas de liquidez entre activos y pasivos, considerando el impacto potencial de renovaciones, prepagos, retiros de depósitos, otorgamiento de crédito y el incumplimiento en pago de créditos.

•Mantener fuentes diversificadas de fondeo.
•Establecer programas de corresponsalías y préstamos interbancarios para ayudar a mantener el acceso a mercado.
•Instrumentar y mantener disponibles programas para la emisión de pasivos, y descuento de cartera con fondos especializados.
•Mantener la capacidad operativa en los sistemas de liquidación establecidos por Banco de México, considerando para esto los requerimientos de garantía y límites establecidos para tal efecto.
•Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.

El Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez incorpora las acciones correctivas que la institución tendría que poner en marcha en caso de contingencia.
d)Una explicación de cómo se utilizan las pruebas de estrés; y
De acuerdo con la norma vigente estipulada en el anexo 12-B de la Circular Única para Bancos, que requiere la realización de ejercicios de liquidez en escenarios de estrés, el banco realiza pruebas de forma periódica esto con la finalidad de cerciorarse de su capacidad para afrontar escenarios adversos y ser capaz de honrar sus obligaciones de corto plazo basados en un horizonte de supervivencia de 30 días.
Estos escenarios de estrés contemplan entre otros, los siguientes supuestos:
•Aumento en la pérdida esperada de las carteras de crédito
•Aumento en retiro de los depósitos
•Disposición de líneas de crédito
•Aumento en las obligaciones del Banco por degradación de la calificación de la institución.
•Salida de los principales depositantes del Banco
•Pérdida de Valor de Mercado de los Activos Líquidos de la Institución
Las pruebas de estrés de liquidez de la institución contemplan distintos escenarios (i.e. idiosincrático, sistémico y combinado) con 3 niveles de severidad cada uno. Los resultados de las pruebas de estrés son presentados de manera periódica a los órganos colegiados de la institución.
Los escenarios de estrés indican una visión sobre las brechas de liquidez, los activos líquidos y el horizonte de supervivencia de la institución, esta información es fundamental para la toma de decisiones con el fin de mantener una posición sólida en torno a activos líquidos, así como sus obligaciones a corto plazo en escenarios adversos. Es relevante apuntar que la institución cuenta con el Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez el cual incorpora las acciones correctivas que la institución tendría que poner en marcha en caso de contingencia.
e)Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.
Periódicamente, el Grupo Financiero Scotiabank Inverlat revisa todos los aspectos de liquidez para la administración de los riesgos potenciales. El Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez es un componente integral de dicha revisión y proporciona un marco de referencia para determinar las acciones a realizar en evento de crisis y poder reestablecer la situación financiera del Grupo.
Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:
•Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
•Apegarse a los sistemas de alertas tempranos, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.
•Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.
•Plantear acciones que aseguren que el riesgo de liquidez global del Grupo este dentro de los límites de tolerancia aprobados por el Consejo de Administración.
•Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.
•Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital

de manera oportuna.
En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de estás: (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 2024, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del primer trimestre 2024, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)
Periodo Reportado: primer trimestre del 2024
Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

(Cifras en millones de pesos)Cifras IndividualesCifras Consolidadas
Importe sin ponderar por plazo residualImporte ponderadoImporte sin ponderar por plazo residualImporte ponderado
Sin vencimiento< 6 mesesDe 6 meses a < 1 año>1 añoSin vencimiento< 6 mesesDe 6 meses a < 1 año>1 año
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE
1Capital:84,048.850.000.000.0084,048.8584,048.850.000.000.0084,048.85
2Capital fundamental y capital básico no fundamental.84,048.850.000.000.0084,048.85 84,048.850.000.000.0084,048.85
3Otros instrumentos de capital.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
4Depósitos minoristas:0.00205,057.082,213.1021.20191,128.150.00205,057.082,213.1021.20 191,128.15
5Depósitos estables.0.0090,483.33792.4017.5086,729.440.0090,483.33792.4017.5086,729.44
6Depósitos menos estables.0.00114,573.761,420.703.70104,398.710.00114,573.761,420.70 3.70104,398.71
7Financiamiento mayorista:0.00374,751.1234,652.1926,967.67181,599.840.00374,751.12 34,652.1926,967.67181,599.84
8Depósitos operacionales.0.0042,741.140.000.0021,370.570.0042,741.140.000.0021,370.57
9Otro financiamiento mayorista.0.00332,009.9834,652.1926,967.67160,229.270.00332,009.98 34,652.1926,967.67160,229.27
10Pasivos interdependientes0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
11Otros pasivos: 113.2840,702.382,103.765,638.646,690.52113.2840,702.382,103.765,638.64 6,690.52
12Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto113.28 0.000.000.000.00113.280.000.000.00
13Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores. 0.00 40,702.382,103.765,638.646,690.520.0040,702.382,103.765,638.646,690.52
14Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible84,162.13620,510.5838,969.05 32,627.52463,467.3684,162.13620,510.5838,969.0532,627.52463,467.36

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO
15Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica7,717.89No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica7,717.89
16Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.0.000.00

0.000.000.000.000.000.000.00
17Préstamos al corriente y valores:0.00123,901.8535,615.11327,360.85353,183.780.00
123,901.8535,615.11327,360.85353,183.78
18Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.0.007,750.570.000.00775.060.007,750.570.000.00775.06
19Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.0.0010,743.672,422.145,154.427,977.040.0010,743.67
2,422.145,154.427,977.04
20Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:0.0086,504.4629,851.05133,415.68165,084.700.0086,504.46
29,851.05133,415.68165,084.70
21Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
22Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:0.003,831.134,036.86232,583.23
169,850.890.003,831.134,036.86232,583.23169,850.89
23Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.0.00650.81694.9445,715.6330,388.040.00650.81
694.9445,715.6330,388.04
24Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).0.0015,722.840.001,923.149,496.090.0015,722.840.00
1,923.149,496.09
25Activos interdependientes.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
26Otros Activos:0.0051,906.65954.066,397.7038,513.790.0051,906.65954.066,397.70
38,513.79
27Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.
0.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.000.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.00
28Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centralesNo Aplica
1,506.540.000.001,280.56No Aplica1,506.540.000.001,280.56
29Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No Aplica0.000.000.002,001.39No Aplica0.000.000.002,001.39
30Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicialNo Aplica0.000.000.002,483.29No Aplica0.000.000.002,483.29
31Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 50,400.11
954.066,397.7032,748.550.0050,400.11954.066,397.7032,748.55
32Operaciones fuera de balance.No Aplica240,378.940.000.0012,018.95No Aplica240,378.94
0.000.0012,018.95
33Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica411,434.41No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica411,434.41
34Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica
112.65No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica112.65
a)Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto y la evolución de sus principales componentes.
Durante marzo 2024, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:
•Fondeo Estable Disponible:
Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por $190,204 millones y depósitos a plazo tradicionales por $140,253 millones, Capital (fundamental y complementario) por $89,198 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por $16,993 millones y $26,670 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por $6,067 millones.

•Fondeo Estable Requerido:
Fondeo Requerido ponderado por carteras de $346,048 millones y por operaciones mercado de dinero de $19,495 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades

financieras del grupo por $14,848 millones, deducciones de capital por $11,132 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por $4,220 millones.
b)Los cambios de las principales componentes dentro del trimestre que se reporte.
Promedio del cuarto trimestre del 2023: 107.02% - Promedio del primer trimestre del 2024: 112.65%
El coeficiente de financiamiento neto incrementó 560pb respecto al cuarto trimestre del 2023, esto debido principalmente a::
a.El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 22,465 millones. El fondeo profesional disminuyó en MXN 9,219 millones.
b.El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas disminuyó $7,533 millones.
c)La evolución de la composición del Monto de Financiamiento Estable Disponible y del Monto de Financiamiento Estable Requerido.
Monto Computable (MXN MM)EneroFebreroMarzo
Financiamiento Estable Disponible456,980463,840469,582
Financiamiento Estable Requerido413,803412,800407,701
Coeficiente de Fondeo Estable Neto110.43%112.36%115.18%
d)El impacto en el Coeficiente de Financiamiento Estable Neto de la incorporación de las entidades objeto de consolidación.
Las entidades objeto de consolidación de acuerdo con las reglas contables, y con aprobación del consejo de administración son las siguientes:
•Inmobiliaria Scotia Inverlat, S.A. de C.V.
•Scotia Servicios de Apoyo, S.A. de C.V.
•Scotia Inverlat Derivados
Derivado a que sus actividades son limitadas ya sea a posiciones de clientes, o un volumen reducido, el impacto en el CFEN es menor al 1%.
Posiciones en Acciones
Al cierre de marzo de 2024 la posición accionaria de títulos para negociar asciende $16.37 millones de pesos, con una minusvalía de $0.41 millones de pesos.

InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosImporte ValuadoCostoPlusvalía/ Minusvalía
ScotiabankPública1A_BABA_N 2,200 2.60 2.72 (0.12)
ScotiabankPública1I_PSQ_* 383 0.06 0.06 -
ScotiabankPública1_NEMAK_A 182,950 0.60 0.59 0.01
ScotiabankPública1_AMX_B 200,000 3.12 3.07 0.05
ScotiabankPública1_LASITE_B-1 9,373 0.05 0.05 -
ScotiabankPública1I_MCHI_* 8,800 5.75 5.99 (0.24)
ScotiabankPública1I_SHV_* 2,200 4.02 4.13 (0.11)
ScotiabankPública1E_FRES_* 1,736 0.17 0.17 -
Total 407,642.00 16.37 16.78 (0.41)

Al cierre del primer trimestre del año 2024, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por $0.20 millones de pesos.
La posición se integra como sigue:
InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosUtilidadPérdidaUtilidad/ Pérdida
ScotiabankPública1_GMEXICO_B 20,000 - (0.01)(0.01)
ScotiabankPública1I_MCHI_* 300 - (0.03)(0.03)
ScotiabankPública1_GCARSO_A1 6,000 0.01 - 0.01
ScotiabankPública1_GMEXICO_B 30,000 - - -
ScotiabankPública1_ALFA_A 71,731 0.03 - 0.03
ScotiabankPública1_CEMEX_CPO 69,395 0.01 - 0.01

ScotiabankPública1_GCARSO_A1 34,487 0.05 (0.01) 0.04
ScotiabankPública1_ALPEK_A 114,427 0.03 (0.05)(0.02)
ScotiabankPública1_CUERVO_* 35,000 0.01 - 0.01
ScotiabankPública1_AMX_B 423,976 0.01 (0.10)(0.09)
ScotiabankPública1A_BABA_N 3,125 0.17 (0.05) 0.12
ScotiabankPública1E_FRES_* 23 - - -
ScotiabankPública1I_GDX_* 2,010 0.02 - 0.02
ScotiabankPública1I_SHV_* 1,100 - (0.01)(0.01)
ScotiabankPública1I_MCHI_* 209 - (0.02)(0.02)
ScotiabankPública1I_IB1MXX_N 717 0.02 - 0.02
ScotiabankPública1I_IEF_* 10,175 - (0.11)(0.11)
ScotiabankPública1_GFNORTE_O 72,275 0.02 (0.05)(0.03)
ScotiabankPública1_GFINBUR_O 288,529 0.04 (0.06)(0.02)
ScotiabankPública1_ALFA_A 40,000 0.02 - 0.02
ScotiabankPública1_CEMEX_CPO 154,890 0.06 - 0.06
ScotiabankPública1_ALPEK_A 107,760 0.03 (0.14)(0.11)
ScotiabankPública1_AMX_B 72,288 0.01 (0.01) -
ScotiabankPública1A_BABA_N 500 - (0.03)(0.03)
ScotiabankPública1E_FRES_* 168 - (0.01)(0.01)
ScotiabankPública1I_EWZ_* 1,000 0.01 - 0.01
ScotiabankPública1I_GDX_* 200 - - -
ScotiabankPública1I_SHV_* 812 0.01 - 0.01
ScotiabankPública1I_MCHI_* 309 - (0.04)(0.04)
ScotiabankPública1I_IB1MXX_N 300 0.02 - 0.02
ScotiabankPública1_ALPEK_A 45,516 - (0.04)(0.04)
ScotiabankPública1_ARA_* 28,106 - - -
ScotiabankPública1_GFINBUR_O 58,977 0.02 - 0.02
ScotiabankPública1_ALPEK_A 101,618 0.07 (0.01) 0.06
ScotiabankPública1_AMX_B 100,000 0.07 - 0.07
ScotiabankPública1_ARA_* 278,502 0.01 - 0.01
ScotiabankPública1_CEMEX_CPO 180,000 0.14 - 0.14
ScotiabankPública1_GFINBUR_O 136,779 0.02 (0.03)(0.01)
ScotiabankPública1_LASITE_B-1 190,460 0.05 - 0.05
ScotiabankPública1_NEMAK_A 190,155 0.03 - 0.03
ScotiabankPública1_WALMEX_* 5,000 - - -
ScotiabankPública1A_BABA_N 2,000 0.01 (0.04)(0.03)
ScotiabankPública1E_FRES_* 4,700 0.01 (0.04)(0.03)
ScotiabankPública1I_GDX_* 7,500 0.16 (0.02) 0.14
ScotiabankPública1I_IB1MXX_N 228 - - -
ScotiabankPública1I_MCHI_* 305 - (0.02)(0.02)
ScotiabankPública1I_PSQ_* 11,517 - (0.04)(0.04)
Total 2,903,069 1.17 (0.97) 0.20

La posición accionaria de títulos por cobrar o vender asciende $0 millones de pesos, con una plusvalía de $0 millones de pesos.
InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosImporte ValuadoCostoPlusvalía/ Minusvalía
ScotiabankSin cotizaciónEMPRESAS FRISCO, S.A. DE C.V.1,222---
ScotiabankSin cotizaciónBLADEX COM8,095---
Total9,317---

31 de marzo de 2024, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de $4.93 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de $ 3.59 millones de pesos y el requerimiento por riesgo especifico asciende a la cantidad de $1.34 millones de pesos.
Requerimientos de CapitalizaciónTotal LargaTotal CortaValor Absoluto de la posición

Coeficiente de Riesgo de mercadoRequerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado16.460.3116.1522.23% 3.59
Por riesgo específico
Canasta de acciones, 16.370.1016.468.00%1.32
Índices accionarios0.100.220.324.00%0.01
Requerimiento por riesgos específico0.100.220.324.00%0.01
Total Requerimiento de capital4.93

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

ReferenciaRubrodic-23mar-24
1Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance) 789,130 760,478
2(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)(10,610)(11,132)
3Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) 778,520 749,346
Exposiciones a instrumentos financieros derivados
4Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible) 6,359 6,311
5Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados 5,352 6,032
6Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo
7(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)(2,626)(2,207)
8(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)
9Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos
10(Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)
11Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10) 9,085 10,136
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores
12Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas 8,004 17,083
13(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)(998)(17,083)
14Exposición Riesgo de Contraparte por SFT 11 9
15Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros - -
16Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) 7,017 9
Otras exposiciones fuera de balance
17Exposición fuera de balance (importe nocional bruto) 258,234 336,181
18(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)(185,583)(253,435)
19Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) 72,651 82,747

Capital y exposiciones totales
20Capital de Nivel 1 71,660 73,538
21Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) 867,273 842,238
Coeficiente de apalancamiento
22Coeficiente de apalancamiento de Basilea III8.26%8.73%

TABLA II.1
COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS
ReferenciaDESCRIPCIONdic-23mar-24
1Activos totales 839,876 822,459
2Ajuste por inversiones en el capital de entidades bancarias, financieras, aseguradoras o comerciales que se consolidan a efectos contables, pero quedan fuera del ámbito de consolidación regulatoria(574)(797)
3Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento
4Ajuste por instrumentos financieros derivados(33,657)(34,762)
5Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores(987)(17,074)
6Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden 72,651 82,747
7Otros ajustes(10,036)(10,335)
8Exposición del coeficiente de apalancamiento 867,273 842,238

TABLA III.1
CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE
ReferenciaDESCRIPCIONdic-23mar-24
1Activos totales 839,876 822,459
2Operaciones en instrumentos financieros derivados(42,742)(44,897)
3Operaciones en reporto y prestamos de valores(8,004)(17,083)
4Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento
5Exposiciones dentro del Balance 789,130 760,478

TABLA IV.1
PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS (NUMERADOR Y DENOMINADOR) DE LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO
CONCEPTO/PERIODOdic-23mar-24Variación
Capital Básico 1) 71,660 73,538 1,877
Activos Ajustados2) 867,273 842,238 (25,035)
Razón de Apalancamiento 3)8.26%8.73%47 pb
1).Reportado en la fila 20
2).Reportado en la fila 21 y
3).Reportado en la fila 22, de la Tabla I.1
Cifras previas a la réplica de Banxico
Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la Razón de Apalancamiento por el periodo de diciembre 2023 a marzo de 2024.
El indicador se ubicó en 8.73%, 47pb mayor respecto el trimestre anterior, debido a la disminución en los activos ajustados por $25,035 millones o 25pb; principalmente por las exposiciones dentro del balance y a un incremento del capital nivel 1 por $1,877 millones o 22pb, debido principalmente por la utilidad del periodo.

TABLA I.2
NOTAS AL FORMATO DE REVELACIÓN ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO
ReferenciaExplicación
1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico

(menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.
2Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.
3Suma de las líneas 1 y 2
4Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:
a)Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución.
b)La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.
c)El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.
d)El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente.
e)El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.
En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.
5Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.
En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.
6No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8No aplica.
9No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
10No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11Suma de las líneas 4 a 10
12Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)

13Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por

cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:
a) Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.
b) Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.
c) Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.
d) Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.
El monto se debe registrar con signo negativo.
14Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.
15Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado.
Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.
16Suma de las líneas 12 a 15
17Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.
18Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%.
El monto se debe registrar con signo negativo.
19Suma de las líneas 17 y 18
20Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
21Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19
22Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

TABLA II.2
NOTAS AL COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS
ReferenciaExplicación
1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.
2Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos b), d), e), f), g), h), i), j) y l) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
El monto se debe registrar con signo negativo.
3No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.
4Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 11 de la Tabla I.1 y la cifra presentada en operaciones con instrumentos financieros derivados contenidos en el balance de la Institución.
.El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo

5Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 16 de la Tabla I.1 y la cifra presentada por operaciones de reporto y préstamo de valores contenidos en el balance de la Institución.
El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.
6Importe registrado en la fila 19 de la Tabla I.1. El monto se debe registrar con signo positivo.
7Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos c), k), m), n), p), q) y r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
8Suma de las líneas 1 a 7, la cual debe coincidir con la línea 21 de la Tabla I.1.

TABLA III.2
NOTAS A LA CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE
ReferenciaDescripción
1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.
2El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados presentadas en el activo de los últimos estados financieros.
El monto se debe registrar con signo negativo.
3El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores presentadas en el activo de los últimos estados financieros.
El monto se debe registrar con signo negativo.
4No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.
5Suma de las líneas 1 a 4, la cual debe coincidir con la línea 1 de la Tabla I.1

AGENCIAS CALIFICADORAS
Scotiabank-Calificaciones Escala NacionalLargo plazoCorto plazoPerspectiva
Fitch RatingsAAA(mex)F1+(mex)Estable
Standard & Poor’smxAAAmxA-1+Estable
La información aquí publicada ha sido preparada por Scotiabank con el único fin de informar a sus clientes las calificaciones vigentes que le han sido otorgadas por las Agencias Calificadoras (Fitch Ratings y Standard & Poor’s), en su calidad de emisor a escala nacional y están sujetas a modificaciones sin previo aviso por parte de las Agencias Calificadoras.

DIVIDENDOS
Mediante sesión del Consejo de Administración del 26 de febrero del 2013, se acordó proponer a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de un dividendo en efectivo por la cantidad de $164’795,248.00 (Ciento sesenta y cuatro millones setecientos noventa y cinco mil doscientos cuarenta y ocho pesos 00/100 M.N).
En Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 12 de abril del 2013, se aprobó decretar un dividendo en efectivo hasta por la cantidad de $164’795,248.
Fecha de pago Importe
23 de abril de 2013 $ 165 millones
Asimismo, se aprobó la nueva política para el decreto y pago de dividendos para el año 2013, por medio de la cual, al término de cada trimestre, se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de un dividendo en efectivo por el 30% de las utilidades generadas en dicho trimestre por Scotiabank, con cargo a la cuenta de “Utilidad de Ejercicios Anteriores”, para ser pagado en el mes inmediato posterior a la celebración de la Asamblea referida.
Mediante Asamblea General ordinaria de Accionistas de fecha 24 de mayo del 2013, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo por la cantidad de $299’944,566.00 (Doscientos noventa y nueve millones novecientos cuarenta y cuatro mil quinientos sesenta y seis pesos 00/100) M.N. a razón de $0.0483781558065 pesos por acción, para

distribuirlo entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6’200,000,000 (Seis mil doscientas millones) de acciones de las series “F” y “B, que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank, mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta “Resultados Ejercicios Anteriores”, el cual fue pagado el 31 de mayo del 2013, a través de la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V.

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

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

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

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

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

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

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

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

Mediante carta instrucción los señores Enrique Zorrilla Fullaondo y/o Michael Coate, con base a las facultades otorgadas por las Asambleas Generales Ordinarias de Accionistas de Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, GFSBI, celebradas el pasado 25 de mayo y 6 de junio ambas del 2018 respectivamente, solicitaron llevar a cabo todas las gestiones necesarias para que el 11 de septiembre del año en curso, se efectuaran el pago del dividendo decretado por las Asambleas de Accionistas referidas, por un monto total de $3,547,492,638.09 (Tres mil quinientos cuarenta y siete millones cuatrocientos noventa y dos mil seiscientos treinta y ocho pesos 09/100) M.N., para Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, GFSBI, para distribuirse sobre la totalidad de las acciones en circulación.
Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de octubre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de $2,400’000,000.00 (Dos mil cuatrocientos millones de pesos 00/100) M.N., a razón de $0.254768944692 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientas veinte millones trescientas mil cuatrocientos treinta y tres) de acciones de las series “F” y “B” que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de “Utilidad de Ejercicios Anteriores”.
Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de diciembre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de $2,000’000,000.00 (Dos mil millones de pesos 00/100) M.N., a razón de $0.212307453910 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientos veinte millones trescientos mil cuatrocientos treinta y tres) de acciones de las series “F” y “B” que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de “Resultado de Ejercicios Anteriores”.
Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 8 de febrero del 2023, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de $2,850,000,000.00 (Dos mil ochocientos cincuenta millones de pesos 00/100) M.N., a razón de $0.302538121822 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientos veinte millones trescientos mil cuatrocientos treinta y tres) de acciones de las series “F” y “B” que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de “Resultado de Ejercicios Anteriores”.
El 31 de mayo de 2023, la Asamblea General Ordinaria de Accionistas acordó decretar dividendos provenientes de utilidades retenidas por la cantidad de $5,000 a razón de $0.530768634776 por acción, mismos que fueron provisionados y registrados en el rubro de “Acreedores diversos y cuentas por pagar” y fueron pagados el 26 de enero 2024.
FUENTES INTERNAS Y EXTERNAS DE LIQUIDEZ
Al 31 de marzo de 2024, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:
•Instrumentos de Mercado por un valor de MXN$114,318 millones de pesos.
•Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN$46,028 millones de pesos.

Adicionalmente:

•Se cuenta con líneas comprometidas con Instituciones Extranjeras por USD $250 millones de dólares.
•Se mantiene una buena calificación de crédito para asegurar acceso a préstamos a tasas y plazos competitivos.
•Se cuenta con una amplia base de depósitos tradicionales (Vista y Plazo), bien diversificada y segmentada entre los diferentes tipos de depositantes de tal forma que no se cuenta con dependencias relevantes que comprometan la liquidez de la institución.
•Adicionalmente se cuenta con préstamos de la banca de desarrollo y de fomento (Fovi, Nafin, Fira, entre otros) cuyas funciones son contar con una fuente de fondeo destinada a apoyar sectores específicos de la economía.

INVERSIONES RELEVANTES EN CAPITAL

Al 31 de marzo de 2024, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital

Instrumentos
Financieros Derivados

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

A) DISCUSIÓN SOBRE LAS POLÍTICAS DE USO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

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

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

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

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

El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a

los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo con las políticas establecidas.

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

1)Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo-rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.

2)Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

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

4)Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

1)Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

2)Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.

3)Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

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

1)Manual de Operación de Derivados.

2)Política de Administracion de Riesgo de Mercado y Estructural.

3)Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

4)Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

5)Política de Riesgo de Contraparte

6)Política de Sobregiros

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

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

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

Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de Mercado Derivado

1.Flujos de Efectivo Pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija PasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
2.Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir 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 flotanteActivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
4.Valor RazonableCartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera ActivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
5.Flujos de EfectivoCertificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
6.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
7.Flujos de EfectivoReportosPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de Mercado Derivado
8.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXNCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional
9.Flujo de EfectivoBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesosCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

En lo que respecta a los productos de negociación aprobados Casa se encuentran:
SubyacenteFuturosOpcionesSwaps
MRMRMRMEMRME
Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.
Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.
Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas
Operaciones de Opción sobre futuros de índice.
Moneda nacional, Divisas y UDIS;
Oro y Plata
Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.
1).Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (CurrencySwaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (ForwardStarting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de

riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.
2).(MR) Mercados reconocidos
3).(ME) Mercados extrabursátiles
Las operaciones de derivados de cobertura se incluirán dentro del cálculo de medidas de sensibilidad (i.e. Valor Económico y Sensibilidad del Margen). En adición, se monitorearán bajo los límites establecidos para ALM previamente aprobados por el Comité de Riesgos.
El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.
Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algortihmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.
Con esta metodología se generan 300 escenarios a partir de las observaciones históricas y los principales supuestos del modelo son:
•El modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo
•El modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.
•El modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados).
•El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.
Debido a que la medida de VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución realiza diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.
Adicionalmente se realizan pruebas de backtest donde se compara el P&L (teórico y real) diario vs VaR de 1 día. Este análisis es realizado mensualmente y es presentado al Comité de Riesgos del Consejo de Administración al menos trimestralmente.
Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles. Scotiabank Inverlat administra su exposición al riesgo de liquidez conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado.
Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:
•Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.
•Eliminar la necesidad de obtener fondos a tasas por arriba de las de mercado o a través de ventas forzadas de activos.
•Satisfacer los límites y requerimientos de liquidez exigidas por las autoridades.
•Establecer e implementar políticas de liquidez prudentes.
•Desarrollar e implementar técnicas y procedimientos efectivos para monitorear, medir y controlar los requerimientos de liquidez.
Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:
•Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo.

•Diversificar fuentes de fondeo.
•Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes activos líquidos para hacer frente a eventos inesperados.
•Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo
Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de marzo 2024 y en promedio para el primer trimestre de 2024 es de:
Scotiabank-
Brechas de liquidez acumuladas
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)43,17868,788
Liquidity Buffer134,322127,518

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

INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS
Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration – Grupo Financiero Scotiabank (México). El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los aplicativos desarrollados en casa matriz (K2/Peak & Wall Street).
INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE
ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
Cross Currency Interest Rate Swap(All Interest Rate)MXN,CAD,USD,
EUR,JPY,GBP SwapInterest Rate CurveVALMER
FX RateVALMER
Interest Rate Swap(All Interest Rate)MXN,CAD,USD,
EUR,JPY,GBP SwapInterest Rate CurveVALMER
Interest Rate Cap/Floor(All Interest Rate)MXN,USD Cap/Floor Black'sInterest Rate Curve VALMER
SurfaceBloomberg/Reuters
OTC Binary Interest rate Option(All Interest Rate)MXN,USD Cap/Floor Black'sInterest Rate CurveVALMER
SurfaceBloomberg/Reuters
IRS FuturesTIIE FondeoMXNPricePriceVALMER
Listed Interest Rate Swap (CME)TIIE FondeoMXN SwapInterest Rate CurveVALMER
OTC European Index Call Spread OptionOTC European Index Call Spread OptionMXN,CAD,USD,
EUR,JPY Call Spread OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
OTC European Basket OptionEquity Index, Common StockMXN,CAD,USD,
EUR,JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-FactorCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
OTC European Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETF and Bond Index whith Target Volatility (Vol Under 15%)MXN,CAD,USD,
EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark

Correlation
Dividend
OTC Index Binary Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETFMXN,CAD,USD,
EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend

ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,
EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
Bond Futures(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER
Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVALMER
Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER
Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVALMER
FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,
MXN,PEN,AUD,EUR,
JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVALMER
OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER
FX Rate
Surface
Precious Metals European OptionGold/Silver BullionGold/Silver Black 76CurveVALMER
Price
SurfaceBloomberg/Reuters
Precious Metals ForwardGold/Silver BullionGold/Silver Forward OTC ModelCurveVALMER
Price
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,
BRL,CLP,COP,PEN,
AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO
ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,

EUR,JPY PricePriceVALMER

POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO
Se informa a esa H. Comisión que en el Manual de Políticas de Crédito Cartera Comercial, en su "Manual de Productos y Programas Especiales de Crédito Cartera Comercial, Apartado III Mercado Financiero, 1.1 Operaciones del Banco en el Mercado Financiero" se norman las operaciones del Banco en el Mercado Financiero estableciendo:
TIPOS DE OPERACIÓN QUE SON OFRECIDOS EN FUNCIÓN AL TIPO DE ACREDITADO
a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:
•Necesidades de tesorería del Banco
•Relación de corresponsalía
•Límites recíprocos
b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:
•Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.
c)Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:
•Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.
PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO
1)Tesorería: Call Money
2)Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores
3)Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles
4)Cambios: FOREX
5)Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)
6)Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos
7)Metales
SUJETOS DE CRÉDITO
Podrán ser sujetos de crédito en productos de este mercado, los siguientes:
•Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
•Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.
•Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)
•Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público
REGLAS PARTICULARES
Metodología utilizada para el consumo de Líneas:
•La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure".
•La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar.
•Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.
•La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.
IDONEIDAD DEL CLIENTE
La celebración de operaciones de productos de Mercado Financiero implica la necesidad de que el Banco cuente con elementos razonables que le garanticen, que:
•El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar
•Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.
Para tales efectos, en toda Solicitud de línea para este tipo de productos, se deben aplicar las reglas de la Política de Idoneidad del Grupo Scotiabank, que establece los procesos a seguir para la clasificación del riesgo de idoneidad, basado en la

complejidad de las operaciones y en el conocimiento/ experiencia que el cliente tenga al respecto. Asimismo, en cada revisión anual se debe evaluar si la clasificación de riesgo de idoneidad del cliente es la misma o ha cambiado desde la última revisión.

POLÍTICAS DE VAR

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

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

B)DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN

MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:

CÁLCULO DE SENSIBILIDADES

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

PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)

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

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

BONOS DE TASA FLOTANTE

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

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

BONOS CUPÓN CERO

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

RIESGO DE CRÉDITO

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

SENSIBILIDAD DEL PASIVO

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

DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS
SWAPS DE TASA DE INTERÉS
Para efectos de determinar la sensibilidad a cambios en la curva de rendimiento de los Swaps de TIIE, se efectúa un cambio de 1 punto base en cada uno de los puntos relevantes de la curva de rendimientos, además de un cambio de 1 y cien puntos base de forma paralela, valuando el portafolio con las diferentes curvas y calculando cual es el cambio en el valor del portafolio con cada uno de esos cambios.
En el caso de Swaps sobre otro tipo de tasas de interés, lo cual puede incluir CETES y/o Libor, los cálculos se realizan directamente haciendo un shock de 1 y 100 puntos base sobre la curva cupón cero. Todas las transacciones realizadas sobre subyacentes distintos de TIIE están autorizados sólo en una base back to back
FUTUROS DE TIIE
Se considera la duración para estimar su sensibilidad.
FUTUROS DE BONO M
Para el cálculo de sensibilidad de estos derivados a la tasa de interés, se utilizan los conceptos de duración y convexidad.
FUTUROS DE CETE
El tratamiento de futuros de Cete es análogo al tratamiento de futuros de TIIE.
EFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:
Se realizan pruebas y análisis, al inicio de cada operación de cobertura y de manera continua, con base en la comparación de los cambios pasados en el valor razonable o en los flujos de efectivo del instrumento de cobertura con los cambios que hayan experimentado en el pasado el valor razonable o los flujos de efectivo de la posición primaria.
Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios mensuales históricos, es decir una ventana de observación de cinco años con base en un análisis de regresión.
Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos).
Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:
Grado de relación entre los cambios observados: $R2 \geq 80\%$.
Pendiente de la regresión entre [-1.25 y -0.80].
Significancia de la regresión: $F > 5$.
Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2024 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.
Durante el primer trimestre de 2024 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por inefectividad.
La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.
COBERTURA DE FLUJOS DE EFECTIVO:
La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de "Otro Resultado Integral" (ORI) y cualquier ganancia o pérdida remanente debe tratarse como inefectividad de cobertura y reconocerse de inmediato en la utilidad o pérdida neta.
El componente que forma parte de "Otro Resultado Integral" asociado con la posición

primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre: la ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.
COBERTURA DE VALOR RAZONABLE:
La ganancia o pérdida que resulte de valuar el instrumento de cobertura a su valor razonable es reconocida de forma inmediata en los resultados del período en que ocurre.
La ganancia o pérdida que resulte de valuar la posición cubierta atribuible al riesgo cubierto debe ajustar el valor en libros de dicha posición y se reconoce inmediatamente en los resultados del período en que ocurre.
En adición, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base en los sistemas especializados internos.
C)INFORMACIÓN DE RIESGOS POR EL USO DE DERIVADOS
Scotiabank Inverlat asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que el Banco pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles, para lo cual el Banco aplica controles a las brechas de liquidez, monitorea indicadores clave de liquidez, mantiene fuentes diversificadas de fondeo, establece límites y mantiene un porcentaje mínimo de activos líquidos.
Las exposiciones al riesgo de liquidez son cubiertos desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.
Al cierre de marzo de 2024 y promedio del primer trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:
Scotiabank–
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Liquidity Buffer134,322127,518

Se realizó un análisis de sensibilidad para las operaciones con instrumentos financieros derivados mismo que refleja requerimientos adicionales que pudieran suscitarse por eventualidades en el mercado, lo anterior podría verse reflejado en una pérdida potencial o en salidas de efectivo adicionales para Scotiabank Inverlat.
Para estos efectos el cálculo de la exposición potencial para derivados considera lo siguiente:
Considerando 3 escenarios (probable, posible y de estrés), Scotiabank Inverlat podría tener salidas de efectivo adicionales por posible baja en su calificación crediticia, dado que el colateral entregado sería mayor. Esto en conexión con instrumentos financieros derivados OTC que tengan asociados contratos marco.
La salida/pérdida potencial para los 3 escenarios dada la baja de 3 escalafones en la calificación crediticia del GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat, está dada por:
Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:
ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market
En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.
Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:
Scotiabank
(millones de pesos)NormalEscenario
PosibleEscenario
ProbableEscenario
Estrés
Gap 30d Gap Acum43,17839,24239,19239,144
Cambios en el Gap respecto al escenario normal(3,936)(3,986)(4,034)

D)ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD Y CAMBIOS EN EL VALOR RAZONABLE.
Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.
El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.
DELTA
La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.
Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.
Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes.
Exposición Delta: Se define como el monto nocional equivalente del subyacente (en cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.
GAMMA
El riesgo gamma es complementario al riesgo delta, y es otra medida de sensibilidad del valor de una opción con respecto al valor de un subyacente. Gamma mide la tasa de cambio de la delta ante un cambio en el nivel del subyacente, y análogo al cálculo de delta, puede ser interpretada de manera analítica, como la segunda derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto el subyacente.
Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos de medición de riesgos no se realizan de manera analítica, sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo

gamma, denominadas gamma1 y gamma5.-
Gamma1 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que gamma5 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio ante un cambio de 5% en el valor del subyacente. Ambas mediciones cuentan con límites de riesgos.
VEGA
Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.
Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.
RHO
Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portafolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).
RHO es entonces definida como el cambio en el valor de un portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.
THETA
Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio ante el paso del tiempo. Analíticamente, Theta puede ser expresado como la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al tiempo.
Theta es calculada mediante el procedimiento de valuación completa (tal como es el caso de las otras griegas) en lugar de analíticamente, sólo con fines informativos y de atribución de P&L.
DIVIDEND RISK
La valoración de opciones sobre índices o acciones supone una tasa de dividendos compuesta continua conocida. Los dividendos, sin embargo, son una estimación y por tanto una variable desconocida, representando un factor de riesgos para la valuación y el consiguiente P&L de las operaciones con opciones.

II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA
Cifras expresadas en pesos
A)ANÁLISIS DE SENSIBILIDADES DEL PORTAFOLIO DE OPERACIONES DERIVADAS DE TASA.
Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a marzo 27, 2024:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	471,137.00	(129,463.00)	259,339.00	(82,166.00)	(102,568.00)	(28,900.00)	387,379.00
CCS	(12.00)	(55.00)	(140.00)	75.00	176.00	28.00	72.00
Caps&Floors	(230.00)	3,826.00	60.00	21.00	-	-3,677.00	
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total DERIVATIVES	470,895.00	(125,692.00)	259,259.00	(82,070.00)	(102,392.00)	(28,872.00)	391,128.00

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

Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.
Los impactos en los estados de resultados son:
a)Bajo el escenario probable una pérdida de (176.24) Millones de pesos.
b)Con escenario poco probable un P&L de (352.49) Millones de pesos.
c)Y finalmente con el escenario muy poco probable (861.66) Millones de pesos.
Los escenarios de stress están basados en el movimiento al alza que pudieran tener las tasas de interés, en el escenario probalble de 50 pb, en el escenario poco probalble de 100 pb y en el escenario muy poco probable 200pb. Los escenarios se muestran a continuación.
Tipo SensibilidadInstrumentoSensibilidadMTMProbable
Shock
(+/-)P&LStress 1
Shock
(+/-)P&LStress 2
Shock
(+/-)P&L
 - 1pb a la tasaFuturos de TIIE y Bono M--50.00-100.00-200.00-
 - 1pb a la tasaIRS & CCS & Delta Caps0.39(90.56)50.00(19.56)100.00(39.11)200.00(78.23)
Volatilidad al 1%Caps &Floors(0.02)(0.46)0.10(0.00)0.40(0.01)1.00(0.02)
a FX %Forwards87.161,566.830.10(156.68)0.20(313.37)0.50(783.42)
a FX %Opciones Divisa--0.10-0.20-0.50-
Total (176.24) (352.49) (861.67)

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 27 de marzo de 2024 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).
OpcionesDeltaVegaGamma
Options AAPL.OQ---
Options AMZN.OQ---
Options BNPUI5.INDX251,607.006,261.0067,064.00
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options GOOG.OQ---
Options IDBTV1.INDX---
Options META.OQ---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total251,607.006,261.0067,064.00

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 AAPL.OQ---
Options AMZN.OQ---
Options BNPUI5.INDX(25,160.70)(75,482.10)(125,803.50)
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options GOOG.OQ---
Options IDBTV1.INDX---
Options META.OQ---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total(25,160.70)(75,482.10)(125,803.50)

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:
Escenarios al alza0.050.150.2
Options AAPL.OQ---
Options AMZN.OQ---
Options BNPUI5.INDX12,580.3537,741.0550,321.40
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options GOOG.OQ---
Options IDBTV1.INDX---
Options META.OQ---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total12,580.3537,741.0550,321.40

Y están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5%, 15% y 20% de escenarios al alza.
Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:
EscenarioMonto
Probable(25,160.70)
Poco Probable(75,482.10)
Muy poco Probable(125,803.50)

DESCRIBIR Y NUMERAR LAS LLAMADAS DE MARGEN QUE SE HAYAN PRESENTADO DURANTE EL TRIMESTRE
Respecto a las llamadas de margen, al 27 de marzo de 2024 se tienen los siguientes

saldos:
ContraparteColateral Recibido MXNColateral Enviado MXNColateral Recibido USDColateral Enviado USD
CLIENTE 1--1,285,000(2,035,000)
CLIENTE 2167,000,000(186,000,000)--
CLIENTE 3---(5,125,000)
CLIENTE 4--20,620,000(265,000)
CLIENTE 53,000,000(16,600,000)--
CLIENTE 6148,300,418(163,100,000)25,325,000(20,575,000)
CLIENTE 7--18,220,000(13,340,000)
CLIENTE 8--57,580,000(25,640,000)
CLIENTE 9--205,300,000(142,100,000)
CLIENTE 10--1,550,000-
SUBTOTAL318,300,418(365,700,000)329,880,000(209,080,000)

ContraparteColateral Recibido MXNColateral Enviado MXNColateral Recibido USDColateral Enviado USD
CLIENTE 11--15,200,000(3,360,000)
CLIENTE 12--33,120,000(14,330,000)
CLIENTE 13--530,000-
CLIENTE 145,600,000(61,300,000)--
CLIENTE 15202,200,000(246,600,000)--
CLIENTE 16300,000---
CLIENTE 17566,100,000(252,400,000)94,840,000(72,300,000)
CLIENTE 181,049,349,143(249,207,953)--
CLIENTE 192,200,000---
CLIENTE 20--6,280,000(490,000)
CLIENTE 21--1,050,000-
CLIENTE 22--3,670,000-
CLIENTE 23--12,970,000(11,160,000)
CLIENTE 242,144,049,560(1,175,207,953)497,540,000(310,720,000)
TOTAL4,288,099,121(2,350,415,906)995,080,000(621,440,000)

REVELACIÓN DE CUALQUIER INCUMPLIMIENTO QUE SE HAYA PRESENTADO A LOS CONTRATOS RESPECTIVOS
ProductoFechaClienteDivisaMontoMotivo del incumplimiento
Interest Rate Swap02/01/2024Cliente 1USD23,943No envió los fondos
Opcion fx09/01/2023Cliente 2MXN82,007No confirmaron la operación
Opcion eq11/01/2024Cliente 3MXN10,026,500No envió los fondos
Interest Rate Swap15/01/2024Cliente 4MXN811Problemas SPEI
Interest Rate Swap29/01/2024Cliente 5MXN(844,184)Retención Pago
Interest Rate Swap29/01/2024Cliente 6MXN(1,254,771)Retención Pago
Interest Rate Swap30/01/2024Cliente 7USD93,000No confirmaron la operación
FORWARD01/02/2024Cliente 8USD500,000Problemas con Banca
FORWARD13/02/2024Cliente 9MXN57,654,300Problemas envío de pago
Interest Rate Swap19/02/2024Cliente 10MXN168,986No envió los fondos
Interest Rate Swap28/02/2024Cliente 11MXN(784,229)Retención Pago
Interest Rate Swap29/02/2024Cliente 12MXN(1,243,268)Retención Pago
Opcion fx04/03/2024Cliente 13MXN19,400Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 14USD47,550Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 15USD17,451Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 16USD17,451Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 17USD9,881Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 18USD9,678Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 19USD3,283Problemas sistemas
FORWARD15/03/2024Cliente 20MXN9,528Solo hizo pago parcial

Opcion fx15/03/2024Cliente 21MXN281,775No envió los fondos
FORWARD19/03/2024Cliente 22MXN138,470Problemas Instrucciones
FORWARD19/03/2024Cliente 23MXN139,192Problemas Instrucciones
FORWARD19/03/2024Cliente 24MXN169,182Problemas Instrucciones
FORWARD22/03/2024Cliente 25MXN163,929Problemas Instrucciones
FORWARD25/03/2024Cliente 26MXN139,726Problemas Instrucciones
FORWARD25/03/2024Cliente 27MXN140,570Problemas Instrucciones
FORWARD25/03/2024Cliente 28MXN133,100Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 29USD(7,976)Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 30USD(8,139)Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 31USD(8,181)Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 32USD(8,278)Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 33USD(9,944)Problemas Instrucciones
FORWARD26/03/2024Cliente 34USD(7,990)Problemas Instrucciones
Opcion fx26/03/2024Cliente 35USD200,000Discrepancia en la liquidación
FORWARD27/03/2024Cliente 36MXN(7,681)Problemas Instrucciones
FORWARD27/03/2024Cliente 37MXN1,789,800No envió los fondos
Interest Rate Swap27/03/2024Cliente 38USD36Discrepancia en la liquidación
DESCRIBIR Y NUMERAR LOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS QUE HAYAN VENCIDO DURANTE EL TRIMESTRE
Cifras expresadas en pesos

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
Cifras expresadas en pesos

"ver archivo completo en pdf"

Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 18 de Abril de 2024, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Julián Felipe Vásquez Wilches (Director Corporativo Contabilidad General y Reportes Regulatorios), Ángel Omar Estrada Valencia (Director General Adjunto Interino de Auditoría de México) y Berenice Martínez Mendoza (Director Ejecutivo Reportes Financieros y Regulatorios), autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos.

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 2023 y 2022.

De conformidad con la Ley General de Sociedades Mercantiles (LGSM), los estatutos del Banco y las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito (las Disposiciones), emitidas por la Comisión los accionistas y la Comisión tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2024 adjuntos, se someterán a la aprobación de los Accionistas.

Bases de presentación

Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados están preparados con fundamento en la legislación bancaria y de acuerdo con los criterios de contabilidad para instituciones de crédito en México (los Criterios de Contabilidad) establecidos en el Anexo 33 de las Disposiciones, y las reglas de operación aplicables, establecidos por la Comisión, quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las instituciones de crédito y realiza la revisión de su información financiera.

Los Criterios de Contabilidad establecen que la contabilidad de las instituciones de crédito debe ajustarse a la estructura básica de las Normas de Información Financiera (NIF) definida por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A.C. (CINIF) en la NIF A-1 “Estructura de las normas de información financiera”, considerando en primera instancia las NIF contenidas en la Serie NIF A “Marco conceptual”, así como lo establecido en el criterio de contabilidad A-4 “Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad”. Asimismo, establecen que las instituciones deben observar los lineamientos contables de las NIF, excepto cuando sea necesario, a juicio de la Comisión, aplicar una normatividad o criterios de contabilidad específicos sobre el reconocimiento, valuación, presentación y revelación aplicables a rubros específicos de los estados financieros consolidados y los aplicables a su elaboración.

Los Criterios de Contabilidad señalan que a falta de criterio contable específico de la Comisión para las instituciones de crédito, o en un contexto más amplio, de las NIF, se aplicarán las bases de supletoriedad previstas por la NIF A-8 “Supletoriedad”, y sólo en caso de que las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) a que se refiere la NIF A-8 no den solución al reconocimiento contable, se podrá optar por una norma supletoria que pertenezca a cualquier otro esquema normativo, siempre que cumpla

con todos los requisitos señalados en la citada NIF y el mismo criterio contable, debiéndose aplicar la supletoriedad en el siguiente orden: los principios de contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP por sus siglas en inglés) y cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando cumpla con los requisitos del criterio A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad" de la Comisión.
(Continúa)
Uso de juicios y estimaciones

La preparación de los estados financieros consolidados requiere que la Administración efectúe estimaciones y suposiciones que afectan los importes registrados de activos y pasivos y la revelación de activos y pasivos contingentes a la fecha de los estados financieros consolidados, así como los importes registrados de ingresos y gastos durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

Juicios

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

Nota 7 – Inversiones en instrumentos financieros: definición del modelo de negocio: Instrumento Financiero para Cobrar Principal e Interés (IFCPI), Instrumento Financiero para Cobrar o Vender (IFCV), o Instrumento Financiero Negociable (IFN).
Nota 9 – Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: determinación sobre si los instrumentos financieros son de negociación o son designados con fines de cobertura.
Nota 10 y 11 – Cartera de crédito: definición del modelo de negocio, ya sea para cobrar principal e interés (IFCPI), o para cobrar o vender (IFCV).
Nota 14 – Activos por derecho de uso: determinación de si un acuerdo contiene un arrendamiento.
Nota 17 – Inversiones en asociadas y otras inversiones permanentes: determinación si el Banco tiene influencia significativa (inversiones en asociadas) y determinación de si el Banco tiene control de facto sobre una participada.

Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

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

-Nota 3j – Valuación de instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo.
-Nota 4 – Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.
-Nota 7 – Inversiones en instrumentos financieros.
-Nota 10 y 11 – Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios y de recuperabilidad de cuentas por cobrar: supuestos e insumos utilizados en su determinación.
-Nota 18 – Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables, y la materialización de los impuestos diferidos.
-Nota 21 – Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves.

Determinación del valor razonable

Algunas de las políticas y revelaciones contables del Banco requieren la medición de los valores razonables tanto de los activos y pasivos financieros como de los no financieros.

(Continúa)

El Banco cuenta con un marco de control establecido en relación con la medición de los valores razonables. Esto incluye la autorización por parte del Consejo de Administración de la contratación de un proveedor de precios, además de la autorización por parte del Comité de Riesgos del Banco de los modelos de valuación internos y sus modificaciones, los métodos de estimación de las variables usadas en estos modelos de valuación cuando no son proporcionadas directamente por el proveedor de precios que el Banco haya contratado, y de aquellos valores y demás instrumentos financieros a los que les son aplicables los modelos de valuación internos.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable, incluyendo los valores razonables de Nivel 3, y que reporta directamente a la Dirección de Finanzas. El equipo de valuación revisa regularmente los datos de entrada no observables significativos y los ajustes de valuación. Si se usa información de terceros, como cotizaciones de corredores o servicios de fijación de precios, para medir los valores razonables, el equipo de valuación evalúa la evidencia obtenida de los terceros para respaldar la conclusión de que esas valuaciones satisfacen los requerimientos de las NIF, incluyendo el nivel dentro de la jerarquía del valor razonable dentro del que deberían clasificarse esas valuaciones. Los asuntos de valuación significativos son informados al Comité de Auditoría y al Consejo de Administración del Banco.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable.

Cuando se mide el valor razonable de un activo o pasivo, el Banco utiliza datos de mercado observables siempre que sea posible. Los valores razonables se clasifican en distintos niveles dentro de una jerarquía del valor razonable que se basa en los datos de entrada (observabilidad de los insumos) usados en las técnicas de valoración, como sigue:

Nivel 1: precios cotizados (no-ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos, que corresponde al nivel más alto.

Nivel 2: datos de entrada diferentes de los precios cotizados incluidos en el Nivel 1, que sean observables para el activo o pasivo, ya sea directa (es decir, precios) o indirectamente (es decir, provenientes de los precios).

Nivel 3: datos o insumos para medir el activo o pasivo que no se basan en datos de mercado observables (datos de entrada no observables), que corresponde a el nivel más bajo.

Los instrumentos financieros que son valuados mediante el uso de un modelo de valuación interno del Banco no son considerados bajo ninguna circunstancia como Nivel 1.

Si los datos de entrada usados para medir el valor razonable de un activo o pasivo se

clasifican en niveles distintos de la jerarquía del valor razonable, entonces la medición del valor razonable se clasifica en su totalidad en el mismo nivel de la jerarquía del valor razonable que la variable de más baja observabilidad que sea significativa para la medición total.

Conforme a lo establecido en las Disposiciones, el Banco determina el valor razonable de los siguientes instrumentos financieros mediante la valuación directa a vector, que consiste en aplicar a la posición en títulos o contratos del Banco el precio actualizado para valuación proporcionado por un proveedor de precios:

Valores inscritos en el registro nacional de valores o autorizados, inscritos o regulados en mercados reconocidos por la Comisión.
(Continúa)
Instrumentos financieros derivados que cotizan en bolsas de derivados nacionales o que pertenecen a mercados reconocidos por el Banco Central.
Activos subyacentes y demás instrumentos financieros que forman parte de las operaciones estructuradas o paquetes de derivados, cuando se trata de valores o instrumentos financieros previstos en las fracciones l y II referidas anteriormente.

El proveedor de precios contratado por el Banco que le proporciona los precios e insumos para la determinación de la valuación de los instrumentos financieros es Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S. A. de C. V. (VALMER).

Durante los años terminados al 31 de diciembre de 2023 y 2022, no se observó una disminución significativa en el volumen (o nivel de actividad) en relación con la actividad normal del mercado. Lo anterior considerando el tipo de instrumentos financieros que mantiene el Banco, su baja complejidad y por la disminución de la volatilidad en los mercados financieros en 2023 y 2022.

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022, no existe una reducción en la disponibilidad de precios e insumos proporcionados por el proveedor de precios, por lo que no hay un deterioro evidente y que resulte significativo de las condiciones observables en los insumos utilizados para la valuación de los valores y los otros instrumentos financieros que requiera el reconocimiento de un deterioro en su valor. Como parte de los controles del Banco, se monitorea la evolución de los mercados financieros, liquidez y condiciones de disponibilidad de precios e insumos para la valuación de los instrumentos con el fin de anticipar cualquier deterioro en el valor de los mismos.

El Banco reconoce las transferencias entre los niveles de la jerarquía del valor razonable al final del período sobre el que se informa durante el cual ocurrió el cambio.

Las siguientes notas incluyen información adicional sobre los supuestos hechos al medir los valores razonables:

-Nota 4 – Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.
- Nota 7 – Inversión en instrumentos financieros; y
- Nota 9 – Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura.

Moneda funcional y de informe

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

Para propósitos de revelación en las notas a los estados financieros consolidados,

cuando se hace referencia a pesos o "$", se trata de millones de pesos mexicanos, y cuando se hace referencia a dólares o USD, se trata de millones de dólares de los Estados Unidos de América.

Presentación del resultado integral

En cumplimiento con el criterio contable D-2 "Estado de resultado integral" establecido por la Comisión, el Banco presenta el resultado integral en un solo estado que presenta en un único documento todos los rubros que conforman el resultado neto, incrementado o disminuido por los Otros Resultados Integrales (ORI) del período, así como de la participación en los ORI de otras entidades, y se denomina "Estado de resultado integral".

(Continúa)
Reconocimiento de activos y pasivos financieros en su fecha de concertación

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

Resumen de las principales políticas contables

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en la preparación de los estados financieros consolidados que se adjuntan.

Reconocimiento de los efectos de la inflación

Los estados financieros consolidados que se acompañan fueron preparados de conformidad con los Criterios de Contabilidad, los cuales debido a que el Banco opera en un entorno económico no inflacionario conforme lo establece la NIF B-10 "Efectos de la inflación", incluyen el reconocimiento de los efectos de la inflación hasta el 31 de diciembre de 2007 con base en el valor de la Unidad de Inversión (UDI), que es una unidad de cuenta cuyo valor es determinado por el Banco de México (Banco Central) en función de la inflación. El porcentaje de inflación anual, acumulada en los tres últimos ejercicios y los valores de la UDI utilizados para determinar la inflación, se muestran a continuación:

31 de diciembre de	UDI	Inflación Del año	Acumulada
2023	7.9816	4.38%	20.83%
2022	7.6468	7.58%	19.50%
2021	7.1082	7.61%	14.16%

Bases de consolidación

Los estados financieros consolidados incluyen los del Banco, S. A. y los de sus subsidiarias en las que ejerce control. Los saldos y operaciones importantes entre las compañías del grupo se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las entidades al 31 de diciembre de 2023 y 2022, los que se prepararon de acuerdo con los Criterios de Contabilidad establecidos por la Comisión.

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2023 y 2022, se detallan a continuación:

Subsidiaria ParticipaciónUbicaciónActividad

Inmobiliaria 99.99%Ciudad de MéxicoAdministración de activo fijo
Scotia Servicios 99.99%Ciudad de MéxicoApoya la administración del negocio adquirente de tarjeta de crédito
Scotia Derivados100%Ciudad de MéxicoOperador de contratos de futuros y opciones en Mexder

(Continúa)
Operaciones en moneda extranjera

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio de cierre de jornada de operación determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el período en que se originan dentro del rubro "Resultado por intermediación", según sea el caso.

Compensación de activos financieros y pasivos financieros

Un activo y pasivo financiero serán objeto de compensación de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado su importe neto, sólo cuando el Banco tiene el derecho legalmente exigible y vigente de compensarlos en cualquier circunstancia, y a su vez la intención de liquidarlos sobre una base compensada, o de realizar el activo financiero y liquidar el pasivo financiero simultáneamente.

Efectivo y equivalentes de efectivo

El efectivo se reconoce a su valor nominal. Se consideran efectivo, la moneda de curso legal y moneda extranjera en caja, los depósitos en el Banco Central y los depósitos en entidades financieras del país y el extranjero, ya sea en cuentas de cheques, giros bancarios, telegráficos o postales y remesas en tránsito.

Los equivalentes de efectivo se reconocen inicialmente a su valor razonable. Éstos incluyen valores a corto plazo, de alta liquidez, fácilmente convertibles en efectivo que están sujetos a riesgos poco importantes en su valor (donde estos últimos son aquellos cuyo plazo de vencimiento se prevé dentro de un máximo de 48 horas a partir de su adquisición), entre otros, los préstamos interbancarios con vencimientos iguales o menores a tres días hábiles (operaciones de "Call Money"), las compras de divisas que no se consideren instrumentos financieros derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable, y otros equivalentes de efectivo tales como corresponsales, documentos de cobro inmediato, metales preciosos amonedados e inversiones disponibles a la vista.

La valuación de los equivalentes de efectivo representados por metales preciosos amonedados se realiza a su valor razonable, considerándose como tal a la cotización aplicable a la fecha de valuación, excepto aquellos que por su naturaleza no tengan valor razonable, los cuales se reconocen a su costo de adquisición.

Las divisas adquiridas que se pacta liquidar en una fecha posterior a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como efectivo y equivalentes de efectivo restringidos (divisas a recibir); en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de efectivo y equivalentes de efectivo (divisas a entregar). Los derechos originados por las ventas de divisas se registran en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y las obligaciones derivadas de las compras de divisas se registran en el rubro de "Acreedores por liquidación de operaciones".

(Continúa)
El monto de los sobregiros en cuentas de cheques, el saldo compensado, de divisas a recibir y divisas a entregar, o de algún concepto que integra el efectivo y equivalentes de efectivo, cuando muestran saldos negativos, se presenta en el rubro de "Otras cuentas por pagar".

Las operaciones de préstamos interbancarios pactadas a un plazo menor o igual a 3 días hábiles, así como los depósitos en el Banco Central sobre las cuales no pueda disponer el Banco, se reconocen como equivalentes de efectivo restringidos.

Los intereses ganados y las utilidades o pérdidas por valuación se incluyen en los resultados del ejercicio conforme se devengan como parte de los ingresos o gastos por intereses. Los resultados por valuación y compraventa de metales preciosos amonedados y divisas se reconocen en el resultado por intermediación.

Cuentas de margen

Las cuentas de margen están asociadas a transacciones con instrumentos financieros derivados celebrados en mercados o bolsas reconocidos, y corresponden al margen inicial, aportaciones y retiros posteriores efectuados en la vigencia de los contratos correspondientes. En las cuales se depositan activos financieros altamente líquidos destinados a procurar el cumplimiento de las obligaciones correspondientes a dichos instrumentos, a fin de mitigar el riesgo de incumplimiento. El monto de los depósitos corresponde al margen inicial y a las aportaciones o retiros posteriores que efectúen el Banco y la cámara de compensación durante la vigencia del contrato de los instrumentos financieros derivados.

Las cuentas de margen en efectivo se reconocen a su valor nominal y se presentan dentro del rubro de "Cuentas de margen". Los rendimientos y las comisiones que afectan a las cuentas de margen, distintos a las fluctuaciones en los precios de los derivados, se reconocen en los resultados del ejercicio conforme se devengan dentro de los rubros de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas pagadas", respectivamente.

Las liquidaciones parciales o totales depositadas o retiradas por la cámara de compensación con motivo de las fluctuaciones en los precios de los derivados se reconocen dentro del rubro de "Cuentas de margen", afectando como contrapartida una cuenta específica que puede ser de naturaleza deudora o acreedora, según corresponda y que representa un anticipo recibido, o bien, un financiamiento otorgado por la cámara de compensación y que reflejará los efectos de la valuación de los derivados previos a su liquidación.

Inversiones en instrumentos financieros

i.Reconocimiento y medición inicial

Las inversiones en instrumentos financieros comprenden instrumentos de patrimonio neto,

obligaciones, bonos, certificados y demás títulos de crédito y documentos que se emiten en serie o en masa, cotizados y no cotizados, que la entidad mantiene como posición propia. Se miden y reconocen inicialmente a su valor razonable más, en el caso de activos o pasivos financieros no medidos a valor razonable con cambios en éste, llevados a través de resultado integral, los costos de transacción directamente atribuibles a su adquisición o emisión, cuando en lo subsecuente se midan a su costo amortizado.

ii.Clasificación y medición posterior

En el reconocimiento inicial, las inversiones en instrumentos financieros se clasifican en las siguientes categorías, conforme al modelo de negocio y las características de los flujos contractuales de los mismos, como se muestra en la hoja siguiente.
(Continúa)
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), que tienen por objeto en su tenencia, recuperar los flujos contractuales que conlleva el instrumento. Los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden sólo a pagos de principal e interés (rendimiento), usualmente sobre el monto del principal pendiente de pago. El IFCPI debe tener características de un financiamiento otorgado y administrarse con base en su rendimiento contractual.

Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV), medidos a valor razonable con cambios en otros resultados integrales (VRCORI), que tienen por objetivo tanto cobrar los flujos contractuales de principal e interés, como obtener una utilidad en su venta cuando ésta resulte conveniente. El Banco de forma irrevocable reconoce los cambios en el valor razonable de los IFCV a través del ORI; e

Instrumentos financieros negociables (IFN), medidos a valor razonable con cambios en resultados (VRCR) que representan la inversión en instrumentos financieros de deuda o de capital, y que tienen por objetivo obtener una utilidad entre el precio de compra y el de venta.

La clasificación de las inversiones en instrumentos financieros se basa tanto en el modelo de negocios como en las características de los flujos contractuales de los mismos. Atendiendo al modelo de negocios, un instrumento financiero o una clase de instrumentos financieros (un portafolio), puede ser administrado bajo:

Un modelo que busca recuperar los flujos contractuales (representado por el monto del principal e intereses).

Un modelo de negocio que busca, tanto la recuperación de los flujos contractuales como en el modelo anterior, como la obtención una utilidad mediante la venta de los instrumentos financieros, lo cual conlleva a desplazar un modelo combinado de gestión de estos instrumentos financieros.

Un modelo que busca obtener un máximo rendimiento a través de compra y venta de los instrumentos financieros.

Los instrumentos financieros no se reclasifican después de su reconocimiento inicial, excepto si el Banco cambia su modelo de negocio, en cuyo caso todos los instrumentos financieros afectados son reclasificados a la nueva categoría en el momento en que el cambio en el modelo de negocio ha ocurrido.

La reclasificación de inversiones en instrumentos financieros entre categorías se aplica prospectivamente a partir de la fecha de cambio en el modelo de negocio, sin modificar ninguna utilidad o pérdida reconocida con anterioridad, tales como intereses

o pérdidas por deterioro.

Cuando se realice alguna reclasificación conforme a lo antes mencionado, el Banco deberá informar de este hecho por escrito a la Comisión dentro de los 10 días hábiles siguientes a su determinación, exponiendo detalladamente el cambio en el modelo de negocio que las justifique. Dicho cambio deberá estar autorizado por el Comité de Riesgos del Banco.

Un instrumento financiero se mide al costo amortizado si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a su valor razonable con cambios a través de resultados conforme se describe en la hoja siguiente.

(Continúa)
el instrumento financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los instrumentos financieros para obtener la recuperación de los flujos de efectivo contractuales; y

las condiciones contractuales del instrumento financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe del principal pendiente (Sólo Pago del Principal e Intereses, o SPPI por sus siglas).

Una inversión en un instrumento de deuda se mide a valor razonable con cambios en ORI si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a valor razonable con cambios en resultados:

—el activo financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo se logra tanto obteniendo los flujos de efectivo contractuales como vendiendo los activos financieros; y

—las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe de SPPI.

Todos los instrumentos financieros no clasificados como medidos al costo amortizado o a valor razonable con cambios en ORI como se describe anteriormente, son medidos a valor razonable con cambios en resultados. Esto incluye todos los instrumentos financieros derivados (ver inciso (j) de esta nota).

Instrumentos financieros: Evaluación del modelo de negocio –

El Banco determina su modelo de negocio para la administración de sus inversiones en instrumentos financieros y para clasificarlos adecuadamente. El modelo de negocio se basa en la forma en que los instrumentos financieros se administran para generar flujos de efectivo para el negocio y no en una intención particular de tenencia del instrumento. Se requiere de juicio para determinar el modelo de negocio, ya que este no se basa en un solo factor o actividad, por lo que se considera toda la evidencia disponible al momento de realizar la evaluación. De forma enunciativa mas no limitativa, la evidencia relevante a evaluar es la siguiente:

las políticas y los objetivos señalados para el portafolio y la operación de esas políticas en la práctica. Estas incluyen si la estrategia de la Administración se enfoca en cobrar ingresos por intereses contractuales, mantener un perfil de tasa de interés concreto o coordinar la duración de los instrumentos financieros con la de los pasivos que dichos instrumentos están financiando o las salidas de efectivo esperadas, o realizar flujos de efectivo mediante la venta de los instrumentos;

cómo se evalúa el rendimiento del portafolio y cómo éste se informa a la Administración del Banco;

los riesgos que afectan al rendimiento del modelo de negocio (y los instrumentos financieros mantenidos en el modelo de negocio) y, en concreto, la forma en que se gestionan dichos riesgos;

cómo se retribuye a los gestores del negocio (por ejemplo, si la compensación se basa en el valor razonable de los instrumentos gestionados o sobre los flujos de efectivo contractuales obtenidos); y

la frecuencia, el volumen y la oportunidad de las ventas en períodos anteriores, las razones de esas ventas y las expectativas sobre la actividad de ventas futuras. (Continúa)

Las transferencias de instrumentos financieros a terceros en transacciones que no califican para la baja en cuentas no se consideran ventas para este propósito, de forma consistente con el reconocimiento continuo de los instrumentos por parte del Banco.

Los instrumentos financieros que son mantenidos para negociación y cuyo rendimiento es evaluado sobre una base de valor razonable son medidos a valor razonable con cambios en resultados.

Instrumentos financieros: Evaluación de si los flujos de efectivo contractuales son solo pagos del principal y los intereses (SPPI).

Para propósitos de esta evaluación, el monto del "principal"' se define como el valor razonable del instrumento financiero en el momento del reconocimiento inicial. El "interés" se define como la contraprestación por el valor del dinero en el tiempo y por el riesgo crediticio asociado con el importe principal pendiente, durante un período de tiempo concreto y por otros riesgos y costos básicos de los préstamos (por ejemplo, el riesgo de liquidez y los costos administrativos), así como un margen de utilidad.

Al evaluar si los flujos de efectivo contractuales son SPPI, el Banco considera los términos contractuales del instrumento. Esto incluye evaluar si un instrumento financiero contiene una condición contractual que pudiera cambiar la oportunidad o importe de los flujos de efectivo contractuales de manera que no cumpliría esta condición.

Al hacer esta evaluación, el Banco toma en cuenta:

eventos contingentes que cambiarían el importe o la oportunidad de los flujos de efectivo;

términos que pudieran generar apalancamiento;

términos que hacen referencia al valor del dinero en el tiempo, como por ejemplo ajustar la tasa del cupón, incluyendo las características de tasa variable;

términos que generen instrumentos derivados implícitos, o cambios en sus términos y condiciones, por indexación a variables ajenas a la naturaleza del contrato;

características de pago anticipado y prórroga; y

términos que limitan el derecho del Banco a los flujos de efectivo procedentes de

instrumentos específicos (por ejemplo, características de "sin recurso").

Una característica de pago anticipado es consistente con el criterio de únicamente pago del principal e intereses si el importe del pago anticipado representa sustancialmente los importes no pagados del principal e intereses sobre el importe principal, que puede incluir compensaciones adicionales razonables para el termino anticipado del contrato. Adicionalmente, en el caso de un instrumento financiero adquirido con un descuento o prima significativo de su importe nominal contractual, una característica que permite o requiere el pago anticipado de un importe que representa sustancialmente el importe nominal contractual más los intereses contractuales devengados (pero no pagados) (que también pueden incluir una compensación adicional razonable por termino anticipado) se trata como consistente con este criterio si el valor razonable de la característica de pago anticipado es insignificante en el reconocimiento inicial.

(Continúa)
Instrumentos financieros: Medición posterior y ganancias y pérdidas –

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

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

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio neto a favor se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de "Ingresos por intereses". No obstante, ver inciso (j) de esta nota en el caso de los derivados designados como instrumentos de cobertura.
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI)Estos instrumentos se miden posteriormente al costo amortizado usando el método del interés efectivo. El costo amortizado se reduce por las pérdidas por deterioro. El ingreso por intereses, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en resultados. Cualquier ganancia o pérdida en la baja en cuentas se reconoce en resultados del ejercicio.
Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV)Estos instrumentos se miden posteriormente a valor razonable. El ingreso por intereses calculado bajo el método de interés efectivo, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en los resultados del ejercicio. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otros resultados integrales (VRCORI), el cual se ajusta por el efecto de impuestos diferidos. En el momento de la baja en cuentas, las ganancias y pérdidas acumuladas en otros resultados integrales se reclasifican en resultados.

La valuación de los instrumentos de esta categoría designados como partida cubierta por derivados de cobertura a valor razonable, es reconocida en el rubro de "Resultado por intermediación".
Inversiones en acciones a través de ORIEstos activos se miden posteriormente al valor razonable. Los dividendos se reconocen como ingresos en resultados a menos que el dividendo claramente represente una recuperación de parte del costo de la inversión. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otro resultado integral.

iii.Baja en cuentas

El Banco da de baja en cuentas un instrumento financiero cuando expiran los derechos contractuales sobre los flujos de efectivo del instrumento financiero, o cuando transfiere los derechos a recibir los flujos de efectivo contractuales en una transacción en la que se transfieren sustancialmente todos los riesgos y beneficios de la propiedad del instrumento financiero, o en la cual el Banco no transfiere ni retiene sustancialmente todos los riesgos y beneficios relacionados con la propiedad y no retiene el control sobre los instrumentos financieros.

(Continúa)
El Banco participa en transacciones en las que transfiere los instrumentos reconocidos en su estado de situación financiera consolidado, pero retiene todos o sustancialmente todos los riesgos y beneficios de los instrumentos financieros transferidos. En estos casos, los instrumentos financieros transferidos no son dados de baja en cuentas. (ver incisos (h) e (i) de esta nota).

iv.Deterioro

El Banco evalúa desde su reconocimiento inicial las pérdidas crediticias esperadas (PCE) de los IFCV y los IFCPI, las cuales se determinan considerando el nivel de recuperabilidad esperada que corresponda a los distintos IFCV y reconoce el efecto de la pérdida, con base en el costo amortizado de los IFCV y los IFCPI. Dado que el valor razonable del IFCV ya reconoce el deterioro por pérdidas crediticias esperadas, el Banco no procede a crear una estimación que reduzca el valor razonable del IFCV; por lo tanto, el efecto se reconoce en la utilidad o pérdida neta, afectando el valor del IFCV antes de reconocer el efecto en ORI por valuación a valor razonable. Para los IFCPI, se reconoce la PCE determinada afectando el valor razonable del IFCPI. Lo anterior no afecta a los IFN, pues en éstos no surge la cuestión de cobrabilidad al no existir la intención de cobro y porque el valor de mercado de los mismos capta generalmente los efectos de pérdidas crediticias esperadas de los mismos.

Las PCE son el promedio ponderado por la probabilidad de las pérdidas crediticias y se miden como el valor presente de las insuficiencias de efectivo. Al estimar las PCE, el Banco considera la información razonable y sustentable que sea relevante y esté disponible sin costos o esfuerzos indebidos. Esto incluye información cuantitativa y cualitativa y análisis, basados en la experiencia histórica del Banco y en una evaluación de crédito informada e incluyendo información prospectiva.

El Banco vigila que las PCE por el deterioro de los títulos emitidos por una contraparte, guarda consistencia con el deterioro determinado para créditos que se otorguen a la misma contraparte.

En caso de que existan cambios favorables en la calidad crediticia de los IFCV que estén debidamente sustentados con base en eventos posteriores observables, la PCE ya reconocida se revierte en el período en que ocurren dichos cambios, contra la utilidad o pérdida neta del período, como una reversión de PCE previamente reconocida.

Operaciones fecha valor-

Los títulos adquiridos que se pacte liquidar en fecha posterior hasta un plazo máximo de cuatro días hábiles siguientes a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como títulos restringidos, en tanto que, los títulos vendidos se reconocen como títulos por entregar disminuyendo las inversiones en valores. La contraparte deberá ser una cuenta liquidadora, acreedora o deudora, según corresponda. Cuando el monto de títulos por entregar excede el saldo de títulos en posición propia de la misma

naturaleza (gubernamentales, bancarios, accionarios y otros títulos de deuda), se presenta en el pasivo dentro del rubro de "Valores asignados por liquidar".

(Continúa)
Operaciones de reporto

Las operaciones de reporto que no cumplen con los términos establecidos en la NIF C-14 "Transferencia y baja de activos financieros", se les da el tratamiento de financiamiento con colateral atendiendo a la sustancia económica de dichas transacciones e independientemente si se trata de operaciones de reporto "orientadas a efectivo" u "orientadas a valores". En las transacciones "orientadas a efectivo" la intención como reportada es obtener un financiamiento en efectivo y la intención de la reportadora es el invertir su exceso de efectivo, y en la transacción "orientada a valores" la reportadora tiene como objetivo acceder a ciertos valores en específico y la intención de la reportada es la de aumentar los rendimientos de sus inversiones en valores.

Actuando como reportada

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco reconoce la entrada de efectivo o equivalentes de efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar medida inicialmente al precio pactado que se presenta en el rubro "Acreedores por reporto", la cual representa la obligación de restituir dicho efectivo a la reportadora. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por pagar se valúa a su costo amortizado mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Gastos por intereses". Los activos financieros transferidos a la reportadora ("colateral otorgado") se reclasifican en el estado de situación financiera consolidado, presentándolos como restringidos, y se siguen valuando de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda al activo.

Actuando como reportadora-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, se reconoce la salida de efectivo y equivalentes de efectivo, o bien una cuenta liquidadora acreedora, registrando una cuenta por cobrar al precio pactado que se presenta en el rubro de "Deudores por reporto", la cual representa el derecho a recuperar el efectivo entregado. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por cobrar se valúa a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Ingresos por intereses". Los activos financieros recibidos como colateral, se registran en cuentas de orden y se valúan a valor razonable.

En caso de que el Banco venda el colateral o lo otorgue en garantía, se reconoce la entrada de los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral a la reportada (inicialmente al precio pactado), la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. El diferencial que llegara a resultar entre el precio recibido y el valor de la cuenta por pagar se reconoce en los resultados del ejercicio, en adición, se lleva en cuentas de orden el control de dicho colateral vendido o dado en garantía siguiendo para su

valuación el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

Asimismo, en el caso en que la reportadora se convierta a su vez en reportada por la concertación de otra operación de reporto con el mismo colateral recibido en garantía de la operación inicial, el interés por reporto pactado en la segunda operación se deberá reconocer en los resultados del ejercicio conforme se devengue, de acuerdo al método de interés efectivo, afectando la cuenta por pagar valuada a costo amortizado mencionada anteriormente.

(Continúa)
Las cuentas de orden reconocidas por colaterales recibidos o colaterales recibidos que a su vez hayan sido vendidos o dados en garantía por la reportadora, se cancelan cuando la operación de reporto llega a su vencimiento o exista incumplimiento por parte de la reportada.

Estimación de perdidas crediticias esperadas –

La estimación para pérdidas crediticias esperadas se determina conforme a lo establecido en la NIF C-16 "Deterioro de instrumentos financieros", lo cual implica que se determina inicialmente una etapa de riesgo a cada posición, y posteriormente calcular la estimación de pérdidas crediticia esperada asociada a cada etapa.

El Banco ha desarrollado el procedimiento para determinar las pérdidas crediticias esperadas para los instrumentos financieros, con el objeto de determinar el deterioro de los deudores por reporto para su posterior reconocimiento contable.

Préstamo de valores

Es aquella operación en la que se conviene la transferencia de valores, del prestamista al prestatario, con la obligación de devolver tales valores u otros substancialmente similares en una fecha determinada o a solicitud, recibiendo como contraprestación un interés. En esta operación se solicita un colateral o garantía por parte del prestamista al prestatario.

Actuando como prestamista-

A la fecha de la contratación del préstamo de valores actuando como prestamista, el Banco registra el valor objeto del préstamo transferido al prestatario como restringido, para lo cual se siguen las normas de valuación, presentación y revelación de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda. Asimismo, se registra en cuentas de orden el colateral recibido que garantiza los valores prestados.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Ingresos por intereses".

Actuando como prestatario-

Actuando como prestatario, a la fecha de la contratación del préstamo de valores, el Banco registra el valor objeto del préstamo recibido en cuentas de orden, siguiendo para su valuación los lineamientos para los títulos reconocidos en el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

El valor objeto de la operación se presenta en cuentas de orden en el rubro de colaterales recibidos por el Banco. Por lo que se refiere a colaterales recibidos provenientes de otras transacciones se deberán presentar en el rubro de colaterales

recibidos y vendidos o entregados en garantía.

En la fecha en que el Banco venda el valor objeto de la operación, deberá reconocer la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir dicho valor al prestamista (medida inicialmente al precio pactado) que se valuará a valor razonable.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Gastos por intereses" y en el estado de situación financiera consolidado dentro del rubro de "Acreedores y otras cuentas por pagar".

(Continúa)
Instrumentos financieros derivados y operaciones de cobertura (IFD)

El Banco clasifica los instrumentos financieros derivados con base a su intencionalidad en las dos categorías que se muestran a continuación:

Con fines de negociación - Consiste en la posición que asume el Banco con la intención de obtener ganancias basadas en los cambios en su valor razonable.

Con fines de cobertura - Consiste en la posición que asume el Banco con el objeto de compensar o transformar el perfil de uno o varios de los riesgos generados por una partida cubierta.

El reconocimiento en los estados financieros consolidados de los activos y/o pasivos provenientes de operaciones con IFD, se realiza en la fecha en que se concreta la operación, independientemente de la fecha de liquidación o entrega del bien.

El Banco reconoce todos los activos o pasivos financieros resultantes de los derechos y obligaciones establecidos en los contratos de IFD, inicialmente a su valor razonable, el cual, presumiblemente, corresponde al precio de transacción, es decir, el precio de contraprestación recibida o entregada. Los costos de transacción que sean directamente atribuibles a la adquisición de IFD se reconocen directamente en resultados dentro del "Resultado por intermediación".

Posteriormente, todos los IFD se valúan a su valor razonable, sin deducir los costos de transacción en los que se pudiera incurrir en la venta u otro tipo de disposición, reconociendo dicho efecto de valuación en los resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Los derivados se presentan en el estado de situación financiera consolidado en un rubro específico del activo o del pasivo, dependiendo de si su valor razonable corresponde a un saldo deudor o un saldo acreedor, respectivamente. Dichos saldos deudores o acreedores se compensan siempre y cuando cumplan con las reglas de compensación de activos y pasivos financieros.

Para la determinación del valor razonable, se consideran los datos e insumos provistos por un proveedor de precios autorizado por la Comisión, siempre y cuando no sean instrumentos financieros derivados que coticen en bolsas nacionales o que no sean intercambiados en mercados reconocidos por el Banco Central.

Operaciones con fines de negociación-

Contratos adelantados forwards:

El contrato adelantado o "forward" se opera en forma privada (fuera de los mercados organizados de futuros o de opciones). El saldo de dichos IFD representa la diferencia entre el valor razonable del contrato y el precio "forward" estipulado del mismo. Si la diferencia es positiva es plusvalía y se presenta en el activo; si es negativa es minusvalía y se presenta en el pasivo.

Opciones:

En opciones compradas, su saldo deudor representa el valor razonable de los flujos futuros a recibir, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

(Continúa)
En opciones vendidas, su saldo acreedor representa el valor razonable de los flujos futuros a entregar, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

Futuros:

El contrato a futuro opera con términos estandarizados (condiciones generales de contratación), tiene mercado secundario y requiere el establecimiento obligatorio de colaterales en cuentas de aportaciones o de margen de liquidación diaria.

Swaps:

Es un IFD mediante el cual se establece la obligación bilateral de intercambiar flujos de efectivo en fechas futuras preestablecidas, sobre un valor nominal o de referencia durante un periodo determinado.

Su saldo representa la diferencia entre el valor razonable de la parte activa y de la parte pasiva.

Operaciones con fines de cobertura-

El Banco utiliza instrumentos financieros derivados con el objetivo de manejar adecuadamente los riesgos de tasas de interés y de tipos de cambio inherentes a las operaciones de crédito, depósitos, inversiones en valores y reportos, todas ellas propias de la banca comercial. Los instrumentos más utilizados son swaps de tasas de interés y de monedas, mediante los cuales se transforma instrumentos de tasa flotante a tasa fija y de tasa fija a tasa flotante, o en su caso, se trasforma activos denominados en moneda extranjera a nacional o viceversa. Los derivados pueden ser utilizados para cubrir flujos de caja o valor económico de diferentes activos y pasivos del Banco, existiendo políticas de control definidas para la designación y seguimiento continuo de la efectividad de tales coberturas.

Al inicio de las relaciones de cobertura designadas, el Banco documenta el objetivo y estrategia de gestión de riesgos para llevar a cabo la cobertura. El Banco también documenta la relación económica entre la partida cubierta y el instrumento de cobertura, fueron formalmente designados a exposiciones alojadas en el estado de situación financiera consolidado, incluyendo si se espera que los cambios en los flujos de efectivo de la partida cubierta y el instrumento de cobertura se compensen entre sí.

Los derivados con fines de cobertura, que cumplen con todas las condiciones, se valúan a valor razonable y el efecto se reconoce dependiendo del tipo de cobertura, de acuerdo con lo que se muestra a continuación:

Coberturas de valor razonable. Cubren la exposición a los cambios en el valor razonable de un activo o pasivo reconocido o de un compromiso en firme no reconocido, o un componente de alguna de las partidas anteriores, o una exposición agregada. La posición primaria cubierta y el instrumento derivado de cobertura se valúan a su valor razonable, registrándose el efecto neto en los resultados del período dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

(Continúa)

Coberturas de flujos de efectivo. Cubren la exposición a la variabilidad de flujos de efectivo atribuible a un riesgo particular asociado con un activo o pasivo reconocido, un portafolio o un componente de los mismos, o una o varias transacciones pronosticadas altamente probables o porciones de éstas, o una exposición agregada. Se valúa a valor razonable el instrumento derivado de cobertura y la valuación correspondiente a la parte efectiva de la cobertura, se registra dentro de la cuenta "Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo" en los Otros Resultados Integrales. La parte inefectiva se registra en resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Una relación de cobertura debe descontinuarse prospectivamente cuando deja de cumplir con los criterios para reconocer una relación de cobertura, esto incluye cuando el instrumento de cobertura se vende, expira, se rescinde o se ejerce, así como después de que se ha considerado o llevado a cabo cualquier reequilibrio en la relación de cobertura y la relación de cobertura resulta ser no efectiva o no cumple con el objetivo de la administración de riesgo del Banco.

Derivados implícitos-

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

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

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

Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de IFD fuera de mercados o bolsas reconocidos-

La cuenta por cobrar que se genera por el otorgamiento de colaterales en efectivo en operaciones de IFD no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que la cuenta por pagar que se genera por la recepción de colaterales en efectivo se presenta dentro del rubro "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en activos no realizables, como títulos, se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

Ajuste de valoración por riesgo crédito contraparte y riesgo de crédito propio

El Credit Valuation Adjustment (CVA) es un ajuste a la valuación de los instrumentos financieros derivados Over the Counter (OTC) por el riesgo asociado a la exposición crediticia asumida con cada contraparte.

Actualmente el Banco tiene implementada una metodología de cálculo de CVA bilateral a nivel contraparte que incorpora mitigantes de riesgo de crédito tales como acuerdos de compensación y colaterales.

(Continúa)

La determinación de la exposición se basa en insumos de mercado consistentes con los utilizados en los procesos de valuación de instrumentos y los parámetros de pérdida (severidad de la pérdida y probabilidad de incumplimiento) se revisan periódicamente y se someten a validaciones y pruebas de estrés (en su caso, para las contrapartes que tienen asociados Credit Default Swaps (CDS) a mercado, estos son utilizados para la obtención de la probabilidad de pérdida).

Los modelos de riesgo contraparte correspondientes a las metodologías implementadas para obtener las exposiciones de crédito para el portafolio de derivados.

El Debit Valuation Adjustment (DVA) es un ajuste de valoración similar al CVA, pero, en este caso, surge por el riesgo de crédito propio del Banco asumido por sus contrapartes en derivados financieros OTC.

Todos los valores razonables de los instrumentos financieros se calculan diariamente.

Compensación de cuentas liquidadoras

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reportos, préstamos de valores, activos virtuales y/o de operaciones con instrumentos financieros derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados, se registran en cuentas liquidadoras dentro de los rubros de “Otras cuentas por cobrar, neto” y “Acreedores por liquidación de operaciones”, respectivamente, así como los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día. Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados.

Los activos y pasivos financieros se compensan de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado el saldo deudor o acreedor, según corresponda, siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y se tenga la intención de liquidar la cantidad neta, provengan de la misma naturaleza de la operación, se celebren con la misma contraparte y se liquiden en la misma fecha de vencimiento o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

Cartera de crédito

La cartera de crédito se compone de financiamientos otorgados a clientes por el Banco a través de contratos de crédito, operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito financiero, los cuales se reconocen cuando son originados y, en caso de adquisiciones, en la fecha de concertación de la adquisición.

La cartera de crédito incluye:

Cartera de crédito valuada a costo amortizado. El modelo de negocio de esta cartera de crédito consiste en conservarla para cobrar los flujos de efectivo contractuales y los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden únicamente a pagos de principal e interés sobre el monto del principal pendiente de pago. Se reconoce inicialmente a su valor razonable que corresponde al precio de transacción, es decir al monto neto financiado que resulta de adicionar o restar al monto original de crédito, el seguro que se haya financiado, los costos de transacción, las comisiones, intereses y otras partidas cobradas por anticipado. Para su reconocimiento posterior, la cartera de crédito se valúa a su costo amortizado. El costo amortizado corresponde al valor presente de los flujos de efectivo contractuales por cobrar de la cartera de crédito, más los costos de transacción por amortizar, utilizando el método de interés efectivo y restando la estimación preventiva para riesgos crediticios.

(Continúa)
Los costos de transacción a que se hacen referencia incluyen, entre otros, honorarios y comisiones pagados a agentes, asesores e intermediarios, avalúos, gastos de investigación, así como la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades. Por otra parte, los costos de transacción no incluyen premios o descuentos, los cuales forman parte del valor razonable de la cartera de crédito al momento de la transacción.

Tanto las comisiones cobradas como los costos de transacción que origina una línea de crédito se reconocen como un crédito o cargo diferido, respectivamente, presentándose netos y afectando la cartera de crédito, los cuales se amortizan en resultados conforme se devengan, excepto si se trata de los relacionados a tarjeta de crédito o líneas de crédito revolvente, los cuáles se reconocen directamente en resultados al momento del otorgamiento.

Clasificación de la cartera de crédito

La cartera de crédito se presenta en las categorías de comercial, vivienda y consumo, conforme a lo descrito a continuación:

Créditos comerciales:

los otorgados a personas morales o personas físicas con actividad empresarial y destinados a su giro comercial o financiero;
créditos otorgados a entidades financieras distintos de los préstamos interbancarios con un plazo menor a 3 días hábiles;
créditos por operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito;
créditos otorgados a fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos y los esquemas de crédito comúnmente conocidos como “estructurados” en los que exista una afectación patrimonial que permita evaluar individualmente el riesgo asociado al esquema;
los créditos concedidos al Gobierno Federal, entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados y los créditos a empresas productivas del estado, y aquellos con garantía expresa de la Federación registrados ante la SHCP y el Banco Central, así como los garantizados expresamente por las entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados, asentados en el Registro Público Único a que hace referencia la Ley de Disciplina Financiera de las entidades federativas y los municipios.

Créditos a la vivienda. Se clasifican como créditos a la vivienda los créditos directos otorgados a personas físicas y destinados a la adquisición o construcción de la vivienda sin propósito de especulación comercial, que cuentan con garantía hipotecaria sobre la vivienda del acreditado. Asimismo, se consideran créditos a la vivienda, los destinados a la construcción, remodelación o mejoramiento de la vivienda que están respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado, o bien cuentan con una garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo o por un fideicomiso público constituido por el Gobierno Federal para el fomento económico (remodelación o mejoramiento). Adicionalmente, se incluyen los créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades y aquellos créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado.

(Continúa)
La cartera de crédito de vivienda incluye créditos originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT), adquiridos por el Banco. Esta cartera de crédito incluye la denominada cartera en prórroga, que se integra por créditos que, en términos de la Ley del INFONAVIT, cuentan con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios. Lo anterior, siempre y cuando la entidad está contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos de los organismos de referencia. Al concluir la prórroga la cartera recibe el tratamiento que le corresponde conforme a si se trata de "Régimen Ordinario de Amortización" (ROA) o el "Régimen Especial de Amortización" (REA).

ROA es una a modalidad de pago que es aplicable a los acreditados que tienen una relación laboral, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

REA es una modalidad de pago que es aplicable a acreditados que ya no cuentan con una relación laboral, a la que le son aplicables las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

Las obligaciones y derechos que el INFONAVIT tienen sobre los créditos adquiridos son las siguientes:

El Banco fue seleccionado mediante el proceso de subasta para adquirir los derechos de coparticipación en la originación de los créditos del producto "Segundo Crédito" que serán otorgados a los derechohabientes del INFONAVIT.

El INFONAVIT conserva la administración, cobranza y recuperación correspondiente a los créditos cedidos al Banco y está obligado a realizar las gestiones de cobro necesarias para la recuperación de los créditos exigibles.

Créditos de consumo. Son créditos directos otorgados a personas físicas, derivados de operaciones de tarjeta de crédito, de créditos personales, de nómina, de créditos para la adquisición de bienes de consumo duradero (conocidos como ABCD), que contempla entre otros al crédito automotriz y las operaciones de arrendamiento financiero que son celebradas con personas físicas; incluyendo aquellos créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades, así como los de liquidez que no cuenten con garantía de inmuebles.

Líneas de crédito

En el caso de líneas de crédito y cartas de crédito que el Banco ha otorgado, en las cuales no todo el monto autorizado esté ejercido, la parte no utilizada de las mismas se reconoce en cuentas de orden.

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

Los créditos otorgados en garantía se reconocen como créditos restringidos.

Operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito

(Continúa)
El descuento es una operación por la cual el Banco, como "descontante", se obliga a anticipar a un cliente, como "descontatario", el importe de un crédito, contra tercero y de vencimiento futuro, a cambio de la enajenación a favor de del Banco de dicho crédito, disminuido por un interés a favor del descontante.

Las cesiones de derechos de crédito son operaciones de financiamiento mediante las cuales se transmite al Banco la titularidad de derechos de crédito, siendo distintas de las adquisiciones de cartera de crédito.

Para cualquiera de las operaciones mencionadas anteriormente, el Banco reconoce inicialmente como cartera de crédito el valor nominal de la cartera recibida contra la salida de efectivo, el aforo pactado reconocido en "Otras cuentas por pagar" por importe del valor nominal de los derechos de crédito transferidos que no financia el Banco, y el ingreso financiero por devengar.

El ingreso financiero por devengar de estas operaciones corresponde a la diferencia entre el valor de la cartera recibida deducida del aforo y el monto financiado. Su devengamiento en el resultado integral se determina y reconoce conforme a la tasa de interés efectiva de las operaciones.

Pagos en especie

Los pagos en especie se reconocen de conformidad con lo establecido en la política contable de bienes adjudicados en la nota 3s.

Modelo de negocio de la cartera de crédito

La determinación del modelo de negocio para la cartera de crédito se basa en el historial de cómo el Banco la administra. El Banco considera lo siguiente:

La forma en cómo se determina e informa el desempeño de la cartera de crédito.
Los riesgos que afectan el desempeño del modelo de negocio y de la cartera de crédito y cómo son administrados esos riesgos.
Los lineamientos sobre los que se basa la remuneración de la dirección de crédito, si con base en maximizar el valor de la cartera de crédito o en cobrar sus flujos contractuales.

El Banco considera también la frecuencia, el valor y la oportunidad de las ventas de cartera de crédito en períodos anteriores, las razones de dichas ventas, así como las expectativas sobre la actividad de ventas futuras dentro del contexto y condiciones en que se presentaron, y la influencia que tienen en la forma en que se logra el objetivo de la entidad para administrar o gestionar la cartera de crédito y, específicamente sobre cómo se realizan los flujos de efectivo.

Trimestralmente el Banco evalúa las características de sus modelos de negocio para clasificar la cartera de crédito con base en el objetivo del mismo, conforme a sus políticas establecidas.

Renegociaciones

Se consideran renegociaciones a las reestructuras y renovaciones de las operaciones de cartera de crédito, las cuales se describen, en la hoja siguiente.

(Continúa)
Reestructuración. Es una renegociación de la que se deriva cualquier modificación a las condiciones originales del crédito, entre las cuales se encuentran:

cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;
cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, Veces Salario Mínimo (VSM), Unidad de Medida y Actualización (UMA) o Unidades de Inversión (UDI);
concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito, excepto por los que forman parte de los programas de apoyo para la Atención de Emergencias por Amenazas Naturales “OTIS”;
prórroga del plazo del crédito;
modificación al esquema de pagos pactado, o
ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate.

Renovación. Es una renegociación en la que el saldo de un crédito es liquidado parcial o totalmente por el deudor, sus obligados solidarios u otra persona que por sus nexos patrimoniales constituya riesgos comunes con el deudor, a través del incremento al monto original del crédito, o bien con el producto proveniente de otro crédito contratado con la misma entidad o con un tercero que por sus nexos patrimoniales con esta última constituya riesgos comunes.

No obstante lo anterior, el Banco no considera renovado un crédito por las disposiciones que se efectúen durante la vigencia de una línea de crédito preestablecida, siempre y cuando el acreditado haya liquidado la totalidad de los pagos que le sean exigibles conforme a las condiciones originales del crédito.

Por las reestructuras, así como por las renovaciones con las que se liquida parcialmente el crédito original, el Banco reconoce una utilidad o pérdida por la diferencia entre los flujos de efectivo del nuevo crédito descontados a la tasa de interés efectiva original y el valor en libros del crédito original a la fecha de la renegociación, sin considerar su estimación preventiva para riesgos crediticios.

Para efectos de lo anterior, se considera valor en libros al monto efectivamente al acreditado, ajustado por los intereses devengados, otros conceptos financiados, los cobros de principal e intereses, así como por las quitas y condonaciones, bonificaciones y descuentos que se hayan otorgado, y en su caso los ingresos o gastos financieros por devengar.

Para la determinación de la tasa de interés efectiva del nuevo crédito, consecuencia de la reestructura o la renovación parcial, se toma de base el resultado sumar al monto financiado se le adicionan los costos de transacción incurridos y en su caso las comisiones cobradas en por su originación y el resultado se toma de base para aplicar la tasa de interés efectiva original. Los costos de transacción y comisiones cobradas se reconocen como un cargo o crédito diferido, respectivamente, y se amortizan durante la vida remanente del crédito.

En el caso de renovaciones totales, el Banco considera que existe un nuevo crédito, por lo que da de baja el crédito original.

(Continúa)
Nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito

La cartera de crédito es evaluada periódicamente a efecto de determinar el riesgo de crédito, el cual representa la pérdida potencial por la falta de pago de un acreditado o contraparte en las operaciones que efectúa el Banco, incluyendo las garantías reales o personales que les otorguen, así como cualquier otro mecanismo de mitigación utilizado por las entidades. El nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito se clasifica por etapas que son, en orden ascendente en su nivel de riesgo, Etapa 1, Etapa 2 y Etapa 3.

Etapa 1

Se refiere a cartera de crédito cuyo riesgo de crédito no se ha incrementado significativamente desde su reconocimiento inicial hasta la fecha de los estados financieros consolidados, es decir que no se encuentra en los supuestos para considerarse en las Etapas 2 y 3 que se mencionan posteriormente.

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 1:

Sobre créditos de consumo no revolvente (para adquisición de bienes de consumo duradero o ABCD, Auto, Nómina, Personal y Otros), cuando presentan hasta un mes de atraso.
Para tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presenta hasta un impago en los períodos consecutivos inmediatos anteriores.
Para la cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, cuando presentan atrasos de hasta un mes o atrasos de hasta tres meses para cartera que cuenta con prórroga; en el caso de cartera de crédito ROA cuando presenta de tres a seis meses de atraso, siempre que cada uno de los pagos realizados durante dicho período representa al menos el 5% de la amortización pactada.
En el caso de cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos menores o iguales a 30 días naturales o un mes calendario.

Etapa 2

Incluye créditos que han mostrado un incremento significativo de riesgo desde su reconocimiento inicial y hasta la fecha de los estados financieros consolidados conforme a los modelos de cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios (ver nota 3p).

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 2:

Para créditos de consumo no revolvente, cuando presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses.

En el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de uno y hasta tres impagos en períodos consecutivos inmediatos anteriores.
Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, si presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses, incluyendo los clasificados como REA.
Cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos mayores a 30 días naturales o un mes calendario y menores a 90 días naturales tres meses calendario.

(Continúa)
Los créditos que estando en Etapa 2 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a
Etapa 1.

Etapa 3

Corresponde a la cartera de crédito con deterioro crediticio originado por la ocurrencia de uno o más de los eventos, los cuales tienen un impacto significativo sobre los flujos de efectivo futuros de dichos créditos. En específico, se consideran los créditos en esta etapa los que se muestran a continuación:

Aquéllos por los que el Banco tiene conocimiento de que el acreditado ha sido declarado en concurso mercantil.

Sin perjuicio de lo previsto previamente, los créditos que continúan recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles (LCM), así como los créditos otorgados al amparo del artículo 75 en relación con las fracciones II y III del artículo 224 de la citada Ley, son traspasados a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 cuando incurren en los supuestos previstos por el numeral 2 siguiente.

Tratándose de créditos de consumo no revolventes y créditos a la vivienda, que han sido pagados parcialmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.
Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

Créditos distintos a los mencionados en el numeral anterior, cuyas amortizaciones no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.
Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.
Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de "Efectivo y equivalentes de efectivo", al momento en que no han sido cobrados.

(Continúa)
Créditos adquiridos al INFONAVIT, conforme a la modalidad de pago REA o ROA, y créditos

destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda, cuando sus amortizaciones o pagos, respectivamente, no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presentan 90 días naturales o más de vencidos.

El traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 de los créditos a que se refiere el numeral 5 del párrafo anterior se sujeta al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

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

Las excepciones mencionadas anteriormente no se consideran excluyentes entre sí.

Para créditos de consumo en los que las condiciones de pago establecidas en el contrato establecen pagos con periodicidad menor a un mes calendario, el Banco considera las siguientes equivalencias:

Periodicidad de pago
contractualEquivalencia
30 días90 días

Quincenal2 quincenasMás de 6 quincenas
Catorcenal2 catorcenasMás de 6 catorcenas
Decenal3 decenasMás de 9 decenas
Semanal4 semanasMás de 13 semanas

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 3:

Para créditos de consumo no revolvente cuando presenta atrasos mayores a tres meses.
Sobre tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de tres impagos en períodos consecutivos inmediatos anteriores.
Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda. Cuando presentan atrasos de mayores a tres meses, en el caso de créditos ROA, si presentan tres a seis meses de atraso, si alguno de los pagos realizados durante dicho período no representa al menos el 5% de la amortización pactada, y para créditos ROA cuando presentan atrasos mayores a 6 meses.
Cartera de crédito comercial, si presenta atrasos mayores o iguales a 90 días naturales o 3 meses calendario.

En el caso de adquisiciones de cartera de crédito, para la determinación de los días naturales de vencimiento, se consideran los incumplimientos que se hayan presentado desde su originación.

Los créditos que estando en Etapa 3 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, son reclasificados a Etapa 1, excepto los créditos reestructurados y/o renovados.

(Continúa)
Efecto de renegociaciones en el nivel de riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito Etapa 2 o Etapa 3 que se reestructuren o se renueven no se reclasifican a una etapa con menor riesgo de crédito por efecto de su reestructura o renovación, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, que se reestructuren durante su plazo o se renueven en cualquier momento, son traspasados a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, y permanecen en dicha etapa hasta que existe evidencia de pago sostenido.

Las líneas de crédito dispuestas, que se han reestructurado o renovado en cualquier momento, se traspasan a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, excepto cuando se cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del acreditado y se ha cumplido lo siguiente:

se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y
se ha cubierto la totalidad de los pagos a que esté obligado en términos del contrato a la fecha de la reestructuración o renovación.

Tratándose de disposiciones de crédito hechas al amparo de una línea de crédito, cuando se reestructuran o renuevan en forma independiente de dicha línea, son evaluadas de conformidad con las reglas para reestructuraciones y renovaciones aplicables antes descritas, atendiendo a las características y condiciones de la disposición o disposiciones reestructuradas o renovadas.

Si posterior a la evaluación descrita en el párrafo anterior se concluye que una o más disposiciones otorgadas al amparo de una línea de crédito deben traspasarse a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito por efecto de dicha reestructura o renovación y tales disposiciones, de manera individual o en su conjunto, representan al menos 25% del total del saldo dispuesto de la línea de crédito al a fecha de la reestructura o renovación, el saldo total dispuesto, así como sus disposiciones posteriores, son traspasadas a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, distintos de créditos referentes a i) créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia que los intereses se paguen periódicamente, ii) líneas de crédito dispuestas, y iii) disposiciones de crédito hechas al amparo de líneas de crédito, que se han reestructurado o renovado de los que no ha transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se mantienen en la misma categoría únicamente si cumplen con lo siguiente:

el acreditado ha cubierto la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación ó reestructuración, y
el acreditado ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación ó reestructuración debió haber sido cubierto.

Sobre el mismo tipo de créditos mencionados en el párrafo anterior, con riesgo de crédito en Etapa 1 y
Etapa 2, pero que han sido reestructurados o renovados durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, son traspasados a la categoría inmediata siguiente, con mayor riesgo de crédito, excepto si cumplen con lo que se muestra en la hoja siguiente.
(Continúa)
se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración;

se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación ó reestructuración debió haber sido cubierto, y
se ha cubierto el 60% del monto original del crédito.

Si no se cumplen todas las condiciones descritas en los dos párrafos anteriores, según corresponda, el crédito se traspasa a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito desde el momento en que se reestructura o renueve y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Se considera cumplido el requisito de los incisos a) de los dos párrafos anteriores, cuando habiéndose cubierto el interés devengado a la última fecha de corte, el plazo transcurrido entre dicha fecha y la reestructura o renovación no excede el menor entre la mitad del período de pago en curso y 90 días.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 o Etapa 2 que se reestructuren o renueven en más de una ocasión, son traspasados a cartera con riesgo de crédito en Etapa 3, excepto cuando el Banco cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del deudor. En el caso de cartera comercial, tales elementos son debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

Cuando se consolidan diversos créditos otorgados por el Banco a un mismo acreditado mediante una reestructura o renovación, se analiza cada uno de los créditos consolidados como si se reestructuraran o renovaran por separado y, si se concluye que uno o más de dichos créditos se habría traspasado a cartera con riesgo de crédito en Etapa 2 o Etapa 3 por la propia reestructura o renovación, el saldo total del crédito consolidado es traspasado a la categoría que correspondería al crédito objeto de consolidación con mayor riesgo de crédito.

Los créditos clasificados en el nivel de riesgo de crédito Etapa 2 por efecto de una reestructura son evaluados periódicamente a fin de determinar si existe un incremento en su riesgo que origine que deben ser traspasados a la Etapa de riesgo de crédito 3, conforme a lo descrito en el primer párrafo de la subsección “Etapa 3” de esta nota.

Los créditos no son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, por efecto de su reestructuración, si a la fecha de o la operación presentan cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las condiciones originales del crédito mencionados a continuación, no se reclasificarán al rubro de “Etapa 3”.

Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.
Tasa de interés: cuando se mejora al acreditado la tasa de interés pactada.

Moneda o unidad de cuenta: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda o unidad de cuenta.

Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago permite la omisión de pago en período alguno.

Ampliación de la línea de crédito: sólo en el caso de créditos de consumo otorgados mediante líneas de crédito revolventes.

(Continúa)
Pago sostenido del crédito.

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado cubre el monto total exigible de principal e intereses sin retraso, conforme a lo siguiente:

Cuando se trata de amortizaciones menores o iguales a 60 días, se cubre un mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito.
Para créditos con períodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.
En el caso de créditos con amortizaciones que cubran períodos mayores a 90 días naturales, se realiza el pago de una amortización.

Cuando los períodos de amortización pactados en la reestructura o renovación no son homogéneos, se considera el número de períodos que representan el plazo más extenso, conforme a lo descrito previamente.

Para reestructuras en las que se modifica la periodicidad del pago a períodos menores, para la determinación de si existe pago sostenido, se considera el número de amortizaciones que correspondería al esquema original del crédito.

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

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan el traspaso a cartera con riesgo Etapa 2 o Etapa 3, para determinar las amortizaciones requeridas para la existencia de pago sostenido, se considera el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalgan al plazo más extenso.

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

El acreditado ha cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura ó renovación, o bien,
Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo.

Los créditos que se reestructuran o renuevan en más de una ocasión, que se ha pactado con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, acreditarán pago sostenido del crédito cuando:

El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura o renovación;

(Continúa)
Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al nuevo esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo, y
La entidad cuenta con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor. En el caso de créditos comerciales, tales elementos están debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados,

distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido. Tal es el caso de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a los períodos requeridos conforme al primer párrafo de esta subsección.

Los créditos que por efecto de una reestructura o renovación son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, en todos los casos permanecen un mínimo de tres meses en dicha etapa hasta acreditar pago sostenido. Se deberá de acreditar el pago sostenido en cada etapa de riesgo de crédito y en consecuencia ser traspasados a la etapa inmediata siguiente con menor riesgo de crédito. Lo anterior con excepción de los créditos con pago de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, en los que se aplica lo descrito previamente para estos casos.

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

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

Reconocimiento de ingresos, costos y gastos

El interés efectivo determinado mediante la aplicación de la tasa de interés efectiva se reconoce conforme se devenga. El interés efectivo incluye el devengamiento de los intereses de cartera y la amortización de comisiones por el otorgamiento de crédito, ambos presentados en el rubro de “Ingresos por intereses”, así como la amortización de los costos de transacción por el otorgamiento de crédito presentada en el rubro de “Gastos por intereses”.

Para determinar la tasa de interés efectiva, el Banco realiza lo siguiente:

Determina el monto de los flujos de efectivo futuros estimados a recibir. Consiste en sumar el principal y los intereses que se recibirán conforme al esquema de pagos del crédito, durante el plazo contractual, o en un plazo menor si es que existe una probabilidad de pago antes de la fecha de vencimiento u otra circunstancia que justifique la utilización de un plazo menor, para lo cual el Banco documenta la evidencia correspondiente.

(Continúa)
Determinar el interés efectivo. Es el resultado de restar a los flujos de efectivo futuros estimados a recibir, el monto neto financiado determinado como se describe en el numeral 1 del segundo párrafo de esta nota.
Determinar la tasa de interés efectiva. Representa la relación entre el interés efectivo y el monto neto financiado.

Cuando conforme a los términos del contrato, la tasa de interés se modifica periódicamente, la tasa de interés efectiva calculada al inicio del período, es la que se utiliza durante toda la vida del crédito, es decir, no se determina nuevamente para cada período.

Existe la presunción de que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito pueden ser confiablemente estimados, lo que sucede en la mayoría de las circunstancias; sin embargo, en aquellos casos en los que no sea posible estimar confiablemente los flujos de efectivo futuros o la vida estimada del o de los créditos, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales documentando las circunstancias y hechos que llevaron a dicha conclusión, previa autorización del Comité de Crédito.

Las comisiones y costos de transacción se amortizan contra los resultados del ejercicio por el período correspondiente al plazo de la línea de crédito asociada. Si la línea de crédito se cancela, el saldo pendiente por amortizar se reconoce totalmente en resultados.

Las comisiones reconocidas con posterioridad al otorgamiento de crédito que se generan como parte del mantenimiento de dichos créditos, así como las que se cobran con motivo de créditos no colocados, se reconocen contra los resultados del ejercicio conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito se reconocen inicialmente como un crédito diferido y se amortizan en un período de 12 meses contra los resultados del ejercicio, en el rubro de “Comisiones y tarifas cobradas”.

Programa de lealtad de tarjetas de crédito

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

(Continúa)
Criterios contables especiales derivado de las inundaciones y daños ocasionados por el Huracán “OTIS”.

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

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

Créditos a la vivienda con garantía hipotecaria.
Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).
Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial (PYME).

Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.
Microcréditos individuales o grupales.

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

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

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

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

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

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

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

Partidas diferidas

Se integra por el monto neto entre costos de transacción y comisiones por otorgamiento de crédito.

Estimación preventiva para riesgos crediticios

La determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios de cada categoría de la cartera de crédito se realiza con base en las metodologías generales establecidas en las Disposiciones, las cuales se basan en el enfoque de Pérdida Esperada, que se determina multiplicando la Probabilidad de Incumplimiento (PI) por el producto de la Severidad de la Pérdida en caso de Incumplimiento (SP) y la Exposición al Incumplimiento (EI).

Tratándose de líneas de crédito comprometidas no dispuestas, el Banco reconoce la estimación correspondiente al saldo no dispuesto conforme a las Disposiciones, lo cual también es aplicable a las cartas de crédito que el Banco ha emitido.

La PI es la probabilidad expresada como porcentaje de que ocurra cualquiera o ambas de las siguientes circunstancias con relación a un deudor específico y determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones:

El deudor se encuentra en situación de mora durante 90 días naturales o más respecto a

cualquier obligación crediticia frente a la Institución, o bien dicha obligación crediticia cumple con los supuestos para ser clasificada con riesgo de crédito Etapa 3, descritos anteriormente (ver nota 3l).
Se considera probable que el deudor no abone la totalidad de sus obligaciones crediticias frente al Banco.

La SP en caso de Incumplimiento corresponde a la intensidad de la pérdida en caso de incumplimiento expresada como porcentaje de la EI, una vez tomados en cuenta el valor de las garantías y los costos asociados a los procesos de realización (judiciales, administrativos de cobranza y de escrituración, entre otros); es determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

La EI es la posición esperada, bruta de reservas, de la operación de crédito si se produce el incumplimiento del deudor. La EI no puede ser inferior a la cantidad dispuesta de la operación al momento del cálculo del requerimiento de reservas ni de capital; se determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

(Continúa)
En su caso, el Banco determina o reconoce las estimaciones adicionales, las cuales se constituyen para cubrir riesgos que no se encuentran previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia, y sobre las que previo a su constitución, el Banco informa a la Comisión sobre lo siguiente:

origen de las estimaciones;
metodología para su determinación;
monto de estimaciones por constituir, y
tiempo que se estima serán necesarias.

Sobre los créditos con riesgo de crédito en Etapa 3, en los que en su reestructuración se acuerda la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, el Banco reconoce una estimación por el 100% de dichos intereses, la cual cancela cuando existe evidencia de pago sostenido.

Cartera de crédito comercial

El cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito comercial se realiza conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos, así como su clasificación previa en cinco diferentes grupos, según a quienes se han otorgado:

Entidades federativas y municipios.

Proyectos con fuente de pago propia.

Fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, no incluidos en la fracción anterior, así como esquemas de crédito comúnmente conocidos como “estructurados”.

Entidades financieras.

Personas morales no incluidas en las fracciones anteriores y físicas con actividad empresarial que, a su vez, se divide en los siguientes subgrupos:

Con ingresos netos o ventas netas anuales menores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Con ingresos netos o ventas netas anuales iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Para el cálculo de la PI de los créditos comerciales se realiza de acuerdo con las Disposiciones, conforme a cada uno de los grupos descritos anteriormente, que consiste en evaluar factores cuantitativos y cualitativos del acreditado y asignarles un puntaje crediticio, el cual es totalizado y utilizado para calcular la PI.

(Continúa)
Para el cálculo de la SP, si los créditos carecen de cobertura de garantías reales, personales o derivados de crédito, se determina conforme a los meses transcurridos de atraso, dependiendo del grupo al que pertenecen, y considerando si son o no créditos subordinados o sindicados en los que el Banco es subordinado respecto de otros acreedores; asimismo, se considera la determinación de la SP mediante un cálculo diferenciado para los créditos de acreditados que han sido declaradas en concurso mercantil. En caso de que los créditos cuenten con garantías reales, garantías personales y seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación de la SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito. Para la cartera de crédito que cuenta con el beneficio de un esquema de cobertura de paso y medida, el cálculo de la SP considera dicha cobertura.

La EI, en el caso de líneas crédito no comprometidas que son cancelables incondicionalmente o que permiten la cancelación automática en cualquier momento y sin previo aviso del Banco, corresponde al saldo insoluto del crédito. Para líneas de crédito distintas a las mencionadas anteriormente, la determinación de la EI se realiza conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Cartera hipotecaria y de vivienda

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito hipotecaria de vivienda se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

El cálculo se realiza utilizando las cifras correspondientes al último día de cada mes constituyendo la calificación de reserva en crédito por crédito.

Asimismo, se consideran principalmente, factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) atraso, vi) información proveniente de las sociedades de información crediticia, vii) ROA, viii) REA y ix) prórroga.

En caso de que los créditos cuenten con seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito.

El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la PI por la SP y la EI o las diferentes reglas en las Disposiciones.

Cartera de consumo

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito de consumo se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando principalmente, factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia; así como, viii) antigüedad del acreditado en el Banco y ix) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia. El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento o las diferentes reglas establecidas en las Disposiciones.

(Continúa)
La EI, en el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, se determina conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a la cartera crediticia de consumo no revolvente considera principalmente, lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) atraso, (iv) antigüedad del acreditado en el Banco, (v) antigüedad del acreditado con otras instituciones, (vi) monto a pagar al Banco, (vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, (viii) saldo reportado en las sociedades de información crediticia, (ix) endeudamiento (xi) importe original del crédito, (xii) saldo del crédito y xiii) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia.

Grado de riesgo de la estimación preventiva para riesgos crediticios

Las reservas preventivas constituidas por el Banco son clasificadas conforme a su grado de riesgo, de acuerdo con la tabla que se muestra a continuación.

Rangos de porcentaje de estimación preventiva para riesgos crediticios
Consumo
Grado de riesgoNo revolventeTarjeta de crédito y otros créditos revolventesHipotecario y de vivienda Comercial
DeADeADeADeA

A-10%2.0%0%3.0%0%0.50%0%0.90%
A-22.01%3.0%3.01%5.0%0.501%0.75%0.911.5%
B-13.01%4.0%5.01%6.5%0.7511.0%1.512.0%
B-24.01%5.0%6.51%8.0%1.0011.5%2.012.5%
B-35.01%6.0%8.01%10.0%1.5012.0%2.515.0%
C-16.01%8.0%10.01%15.0%2.0015.0%5.0110.0%
C-28.01%15.0%15.01%35.0%5.00110.0%10.0115.5%
D15.01%35.0%35.01%75.0%10.00140.0%15.5145.0%
E35.01% 100%75.01%100%40.001100%45.01100%

Castigos, eliminaciones y recuperaciones de cartera de crédito

El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo con plazos establecidos de 6 y 60 meses, respectivamente que determinan la imposibilidad práctica de recuperación. El castigo se reconoce cancelando el saldo del crédito que determine la Administración, contra la estimación preventiva para riesgo crediticios. Cuando el crédito a castigar excede el monto de la estimación, antes de efectuar el castigo, el Banco reconoce una estimación hasta por el monto de la diferencia.

En todo caso, el Banco cuenta con evidencia de las gestiones formales de cobro que se han ejercido respecto de estos créditos, así como de los elementos que acreditan la imposibilidad práctica de recuperación del crédito de acuerdo con sus políticas internas establecidas en el manual de crédito.

El Banco podrá optar por eliminar de su activo aquellos créditos con riesgo de crédito etapa 3 que se encuentren provisionados al 100% aun cuando no cumplan con las condiciones para ser castigados. Para tales efectos, el Banco deberá cancelar el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios.

(Continúa)
Cualquier recuperación derivada de créditos previamente, castigados o eliminados es reconocida en los resultados consolidados del ejercicio dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios", salvo que las recuperaciones provengan de pagos en especie, cuyo tratamiento se realiza conforme a las políticas establecidas para Bienes Adjudicados en la nota 3s.

Los costos y gastos incurridos por la recuperación de cartera de crédito deberán reconocerse como un gasto dentro del rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera

Las quitas sobre el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total que el Banco realice a los acreditados se realizarán cancelando el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios asociada al crédito y, si esta es menor al monto perdonado, el Banco previamente constituye estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

La cancelación de la estimación preventiva para riesgos crediticios sobre las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera, es aplicable a los montos perdonados derivado de incrementos en el riesgo crédito, en caso contrario deberán disminuirse de los ingresos que le dieron origen.

Otras cuentas por cobrar, neto

Las cuentas por cobrar reconocidas en este rubro no tienen interés ya sea explícito o implícito: por lo tanto, incluyen:

cuentas por cobrar de corto plazo; y
otras cuentas por cobrar de corto plazo

No deberán incluirse las cuentas por cobrar derivadas de las operaciones a que se refieren:

los criterios B-3 "Reportos", B-4 "Préstamos de Valores" y B-6 "Cartera de Crédito" emitidos por la Comisión;
las correspondientes a los derechos de cobro definidos en el criterio "B-6"; y
las cuentas por cobrar en el rubro de otras cuentas por cobrar provenientes de operaciones de arrendamiento operativo.

Las otras cuentas por cobrar se integran de las cuentas por cobrar liquidadoras por operaciones de venta de divisas, inversiones en valores, reportos, préstamo de valores, derivados y por emisión de títulos, así como de los deudores de cuentas de margen, deudores por colaterales otorgados en efectivo por operaciones con valores, crédito y derivados realizadas en mercados OTC. Asimismo, incluye los deudores diversos por

premios, comisiones y derechos por cobrar sobre operaciones vigentes no crediticias, partidas asociadas a operaciones crediticias, saldos a favor de impuestos acreditables, préstamos y otros adeudos del personal, amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas y otros deudores.

Las cuentas por cobrar se deben valuar en su reconocimiento inicial al precio de la transacción (la contraprestación a la que el Banco considera tener derecho de cobro a cambio de transferir el control sobre los bienes o servicios a un cliente) en el momento de considerarse devengada la operación que le dio origen, lo cual ocurre cuando, se transfiera el control sobre los bienes o servicios acordados con el cliente a cambio de una contraprestación, en acuerdo con los términos del contrato celebrado.

(Continúa)
Las cuentas por cobrar deben incluir los impuestos y derechos trasladables al cliente y cualquier otro cobro al cliente por cuenta de terceros. El Banco debe reconocer un pasivo por el monto de cobro por cuenta de terceros incluidos en las cuentas por cobrar.

Las cuentas por cobrar denominadas en moneda extranjera se deben reconocer inicialmente en la moneda funcional, utilizando el tipo de cambio histórico; que es aquél con el cual el Banco pudo haber realizado las cuentas por cobrar a la fecha de la transacción.

Las cuentas por cobrar deben valuarse en su reconocimiento posterior al precio de la transacción pendiente de cobro.

Estimación para pérdidas crediticias esperadas

La estimación de pérdidas crediticias esperadas se debe reconocer desde su inicio en las cuentas por cobrar, afectando resultados del ejercicio dentro del rubro “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

En su reconocimiento posterior, se deben reconocer los cambios requeridos en la estimación para pérdidas crediticias esperadas por las modificaciones en las expectativas de las pérdidas crediticias esperadas que surjan en cada periodo en los resultados del ejercicio dentro del rubro “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

La estimación para pérdida crediticias esperadas se debe determinar a través del juicio profesional del Banco, considerando la evaluación de las pérdidas esperadas por el deterioro de las cuentas por cobrar, utilizando factores como la experiencia histórica de las pérdidas crediticias, condiciones actuales y pronósticos razonables y sustentables de los diferentes eventos futuros cuantificables que pudieran afectar el flujo de efectivo futuro por recuperar de las cuentas por cobrar.

La estimación para incobrabilidad para cuentas por cobrar comerciales se reconoce desde el momento en que se devenga el ingreso, con base en las pérdidas crediticias esperadas.

Desde el reconocimiento inicial, deberá considerarse el valor del dinero en el tiempo, por lo que, si el efecto del valor presente de la cuenta por cobrar es importante en atención a su plazo, deberá ajustarse con base en dicho valor presente.

Por lo anterior la Administración del Banco ha desarrollado el procedimiento para el cálculo de pérdida crediticia esperada para constituir dicha estimación basado en la siguiente ecuación:

$$PE=\sum_{i=1}^{n} EI_{ij} * TP_j$$

(Continúa)
En donde:

PE:Pérdida esperada;
EI_ij:Exposición al incumplimiento de la operación i en el grupo de atraso j;
TP_j:Tasa de pérdida del grupo de atraso j;
j:j-ésimo grupo de atraso;
n:El número de operaciones.

La tasa de pérdida se calcula con ayuda del análisis de la proporción de saldo que se ha pagado en cada bucket de atraso, de esta manera, se analiza la concentración del saldo por bucket de atraso y con ello, definir el umbral de deterioro y la asignación del 100% de pérdida.

El Banco puede determinar la pérdida esperada de manera individual para deudores que tienen características particulares, en caso de que sea impráctico, éstos se califican agrupándolos por características homogéneas o comunes.

En este sentido, el Banco ha desarrollado una metodología en donde se determinó impráctico realizar una evaluación individual de las cuentas por cobrar, por lo cual se derivaron de modelos estadísticos desarrollados con datos históricos de las cuentas por cobrar en donde se calificaron y agruparon por características comunes y homogéneas en términos de riesgo en donde basados en elementos clave para la medición de la pérdida esperada crediticia se determinaron las siguientes variables: Tasa de pérdida (TP) y Exposición al incumplimiento (EI).

Para estimar los parámetros y aplicarlos de forma colectiva, los activos que integran las cuentas por cobrar fueron agrupados de acuerdo con los días de atraso que poseen al momento de la estimación del deterioro, asignándoles un grupo de morosidad para lo cual se identificó en el caso particular del Banco, dicho período es de 120 días, conforme al proceso de cobro.

Cuando el Banco considere nula la probabilidad de cobro de una cuenta por cobrar, debe dar de baja el valor neto en libros de la cuenta por cobrar, aplicando la cuenta por cobrar a la estimación para pérdidas crediticias esperadas. Si la estimación fuera insuficiente, debe ajustarse de inmediato afectando los resultados del ejercicio en el rubro “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

Las cuentas por cobrar, en su caso, se presentan deducidas de la estimación para pérdidas crediticias esperadas dentro del estado de situación financiera consolidado en el rubro “Otras cuentas por cobrar (neto)".

Otras consideraciones de la estimación de pérdidas crediticias esperadas para otras cuentas por cobrar:

Los sobregiros de cuentas de cheques de clientes que no cuentan con líneas de crédito de sobregiro, se clasifican, al momento de su reconocimiento, como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

(Continúa)

El Banco no constituye estimación de pérdidas crediticias esperadas por:

Saldos a favor de impuestos,

Impuesto al valor agregado acreditable y
Cobros a clientes por cuenta de terceros.

No es objeto de este inciso las cuentas por cobrar con riesgo operacional, que su eliminación se reconoce en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Arrendamientos

Actuando como arrendador

Clasificación de los arrendamientos

El Banco clasifica cada uno de sus arrendamientos como un arrendamiento operativo o financiero. Se consideran como arrendamientos financieros todos los créditos que otorgue la entidad para operaciones de arrendamiento financiero, que son aquéllos en donde el Banco transfiere al arrendatario sustancialmente todos los riesgos y beneficios inherentes a la propiedad del activo subyacente, en caso de contrario se consideran como operativos.

Actuando como arrendatario

Al inicio de un contrato, el Banco evalúa si un contrato es, o contiene, un contrato de arrendamiento. Un contrato es, o contiene, un arrendamiento si el contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado por un período de tiempo a cambio de una contraprestación. El Banco evalúa si un contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado de manera implícita o explícita en un contrato.

Al comienzo o en la modificación de un contrato que contiene un componente de arrendamiento, el Banco asigna la contraprestación en el contrato a cada componente de arrendamiento o servicio sobre la base de sus precios independientes relativos.

El Banco reconoce un activo por derecho de uso y un pasivo por arrendamiento en la fecha de inicio del arrendamiento. El activo por derecho de uso se mide inicialmente al costo, que comprende el monto inicial del pasivo por arrendamiento ajustado por cualquier pago de arrendamiento realizado en o antes de la fecha de inicio, más los costos directos iniciales incurridos y una estimación de los costos para desmantelar o para restaurar el activo subyacente o el sitio en el que se encuentra, menos los incentivos de arrendamiento recibidos.

El activo por derecho de uso se deprecia posteriormente utilizando el método de línea recta desde la fecha de inicio hasta el final del plazo del arrendamiento, a menos que el arrendamiento transfiera la propiedad del activo subyacente al Banco al final del plazo del arrendamiento o el costo del activo por derecho de uso refleja que el Banco ejercerá una opción de compra. En ese caso, el activo por derecho de uso se depreciará a lo largo de la vida útil del activo subyacente, que se determina sobre la misma base que los de propiedades y equipo. Además, el activo por derecho de uso se reduce periódicamente por pérdidas por deterioro, si corresponde, y se ajusta por ciertas nuevas valuaciones del pasivo por arrendamiento como cambios en el monto de la renta por ajuste de inflación.
(Continúa)
El pasivo por arrendamiento se mide inicialmente al valor presente de los pagos de arrendamiento que no se pagan en la fecha de inicio, descontados utilizando la tasa de interés implícita en el arrendamiento o, si esa tasa no puede determinarse fácilmente, la tasa incremental de financiamiento del Banco o la tasa libre de riesgo determinada con referencia al plazo del arrendamiento. Generalmente, el Banco usa su tasa de

interés incremental como tasa de descuento.

El Banco determina su tasa incremental de financiamiento obteniendo tasas de interés de varias fuentes de financiamiento externo y realiza ciertos ajustes para reflejar los términos del arrendamiento (como plazo del arrendamiento y moneda en que se encuentran denominados los pagos) y el tipo de activo arrendado.

Los pagos de arrendamiento incluidos en la valuación del pasivo por arrendamiento comprenden lo siguiente:

pagos fijos, incluidos los pagos en sustancia fijos;
pagos de arrendamiento variables que dependen de un índice o una tasa, inicialmente valuados utilizando el índice o la tasa en la fecha de inicio;
importes que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; y
el precio de ejercicio bajo una opción de compra que el Banco está razonablemente seguro de ejercer, los pagos de arrendamiento en un período de renovación opcional si el Banco está razonablemente seguro de ejercer una opción de extensión y las sanciones por la terminación anticipada de un arrendamiento a menos que el Banco esté razonablemente seguro de no terminar antes de tiempo.

El pasivo por arrendamiento se valúa al costo amortizado utilizando el método de interés efectivo. Se vuelve a valuar bajo las siguientes condiciones:

hay un cambio en los pagos de arrendamiento futuros que surgen de un cambio en un índice o tasa;
hay un cambio en la estimación del Banco, del monto que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; si el Banco cambia su evaluación de si ejercerá una opción de compra, extensión o terminación o
hay un pago en sustancia fijo de arrendamiento modificado.

Cuando el pasivo por arrendamiento se vuelve a valuar de esta manera, se realiza un ajuste correspondiente al importe en libros del activo por derecho de uso, o se registra en resultados si el importe en libros del activo por derecho de uso se ha reducido a cero.

El Banco presenta activos de derecho de uso que no cumplen con la definición de propiedad de inversión en el rubro “Activos por derecho de uso de propiedades, mobiliario y equipo”, y los pasivos por arrendamiento en el rubro “Pasivo por arrendamiento”, ambos en el estado de situación financiera consolidado.

Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

El Banco ha decidido no reconocer los activos por derecho de uso y los pasivos por arrendamientos para arrendamientos de activos de bajo valor y arrendamientos a corto plazo, incluidos equipos de TI. El Banco reconoce los pagos de arrendamiento asociados con estos arrendamientos como un gasto en línea recta durante el plazo del arrendamiento.

(Continúa)

Bienes adjudicados

Los bienes adjudicados o recibidos mediante dación en pago que no son destinados para uso del Banco, se reconocen en la fecha que causa ejecutoria el auto de aprobación del remate mediante el cual se decreta la adjudicación, o tratándose de bienes recibidos mediante dación en pago, en la fecha que se firma la escritura de dación, o se haya

formalizado la transmisión de propiedad del bien.

El reconocimiento de bienes adjudicados se realiza como sigue:

al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación, es decir, sin deducir la estimación preventiva para riesgos crediticios que se haya reconocido hasta esa fecha, y el valor neto de realización de los activos recibidos, cuando la intención de la entidad es vender dichos activos para recuperar el monto a cobrar; o

al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación o el valor razonable del activo recibido, cuando la intención de la entidad es utilizar el activo adjudicado para sus actividades.

En la fecha de registro del bien adjudicado o recibido mediante dación en pago, el valor del activo que dio origen a la adjudicación, así como su respectiva estimación preventiva para riesgos crediticios que se tuviera constituida, se dan de baja del estado de situación financiera consolidado por el total del activo neto de la estimación, deducido de los pagos parciales en especie en caso de cartera de crédito, o de los cobros o recuperaciones cuando se trata de derechos de cobro.

La diferencia entre el valor del activo que dio origen a la adjudicación, neto de estimaciones, y el valor del bien adjudicado determinado conforme a lo descrito en el segundo párrafo de esta nota, se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio en el rubro de “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

Valuación de bienes adjudicados

Los bienes adjudicados se valúan conforme al tipo de bien que se trate, registrando su valuación contra los resultados del ejercicio como “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

El Banco reconoce una estimación de deterioro por las pérdidas de valor por el paso del tiempo conforme a las disposiciones, reconociéndolo en resultados como “Otros ingresos (egresos) de la operación”. La determinación de las reservas por tenencia de bienes muebles o inmuebles, adjudicados o recibidos en dación en pago por el transcurso del tiempo, se determina, conforme a lo que se muestra en la tabla de la hoja siguiente.

(Continúa)

Porcentaje de reserva Meses transcurridos a partir de la adjudicación o dación en pago	Bienes inmuebles	Bienes muebles, derechos de cobro e inversiones en valores
Hasta 6 meses	0%	0%
Más de 6 y hasta 12	0%	10%
Más de 12 y hasta 18	10%	20%
Más de 18 y hasta 24	10%	45%
Más de 24 y hasta 30	15%	60%
Más de 30 y hasta 36	25%	100%
Más de 36 y hasta 42	30%	100%
Más de 42 y hasta 48	35%	100%
Más de 48 y hasta 54	40%	100%
Más de 54 y hasta 60	50%	100%
Más de 60	100%	100%

Al momento de la venta de los bienes adjudicados, el diferencial entre el precio de

venta y el valor en libros del bien adjudicado, neto de estimaciones, se reconoce directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Traspaso de bienes adjudicados para uso propio del Banco

Cuando el Banco opta por traspasar los bienes adjudicados para uso propio, el traspaso se realiza al rubro del estado de situación financiera consolidado que le corresponda según el activo de que se trate, cumpliendo con el hecho de que los bienes son utilizados para la realización de su objeto y se efectúe de acuerdo con sus estrategias de inversión y fines que se encuentran previamente establecidos en sus manuales, no existiendo la posibilidad de que dichos bienes vuelvan a considerarse como adjudicados.

Propiedades, mobiliario y equipo, neto

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

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

El monto a depreciar de las propiedades, mobiliario y equipo se determina después de deducir a su costo de adquisición su valor residual y, en su caso menos las pérdidas por deterioro acumuladas. El Banco evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichas propiedades, mobiliario y equipo.
(Continúa)
El Banco evalúa periódicamente los valores netos en libros de las propiedades, mobiliario y equipo, para determinar la existencia de indicios de que dichos valores exceden su monto recuperable. El monto recuperable es aquel que resulte mayor entre el precio neto de venta y el valor de uso. Si se determina que los valores netos en libros exceden su monto recuperable, el Banco reconoce el deterioro con cargo a los resultados del ejercicio para reducirlos a este último monto. Los gastos de mantenimiento y reparaciones menores se registran en los resultados cuando se incurren.

Inversiones permanentes

Las inversiones permanentes en las que el Banco tiene influencia significativa o control se valúan utilizando el método de participación, a través del cual se reconoce la participación en los resultados y en el capital contable de estas entidades utilizando los estados financieros a la misma fecha y por el mismo período que el Banco. Se considera que una empresa es subsidiaria del Banco, cuando se tiene el poder de dirigir sus actividades relevantes, está expuesta o tiene derecho, a rendimientos variables procedentes de esa participación y tiene la capacidad presente de afectar esos rendimientos a través de su poder sobre ésta.

Las otras inversiones permanentes en donde no se tiene el control, control conjunto, ni influencia significativa son clasificadas como otras inversiones, las cuales se reconocen inicialmente y se mantienen valuadas a su costo de adquisición. En caso de que haya dividendos provenientes de dichas inversiones se reconocen en resultados en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de períodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la

inversión permanente.

Activos de larga duración disponibles para su venta

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

El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.
Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.
Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.
Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que la entidad celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del período de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control de la entidad y existen evidencias suficientes de que la entidad se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.
Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.
No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

(Continúa)

Deterioro de activos de larga duración

El Banco evalúa periódicamente el valor neto en libros de los activos de larga duración para determinar la existencia de indicios de que dicho valor excede su valor de recuperación. El valor de recuperación representa el monto de los ingresos netos potenciales que se espera razonablemente obtener como consecuencia de la utilización o realización de dichos activos.

Si se determina que el valor neto en libros excede el valor de recuperación, el Banco registra las estimaciones necesarias. Cuando se tiene la intención de vender los activos, éstos se presentan en los estados financieros consolidados a su valor neto en libros o de realización, el menor. Los activos y pasivos de un grupo clasificado como disponible para la venta se presentan por separado en el estado de situación financiera consolidado.

Pagos anticipados y otros activos, neto

Los pagos anticipados representan aquellas erogaciones efectuadas por el Banco en donde no han sido transferidos los beneficios y riesgos inherentes a los bienes que está por adquirir o a los servicios que está por recibir. Los pagos anticipados se reconocen como un activo por el monto pagado, siempre que sea probable que los beneficios económicos futuros que estén asociados con tales pagos fluyan hacia el Banco.

Una vez recibidos los bienes y/o servicios, relativos a los pagos anticipados, estos se

reconocen como un activo o como un gasto en el estado consolidado de resultado integral, según sea la naturaleza respectiva.

Los pagos anticipados y otros activos incluyen erogaciones realizadas principalmente por gastos de licencias y anticipo de PTU. Al 31 de diciembre de 2023 y 2022, el monto asciende a $2,568 y $2,973, respectivamente.

Impuestos a la utilidad y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU)

El impuesto a la utilidad y la PTU causados en el año, se determinan conforme a las disposiciones fiscales y legales vigentes.

El impuesto a la utilidad diferidos y la PTU diferida se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad y PTU diferidos (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas, y en el caso de impuestos a la utilidad, por las pérdidas fiscales por amortizar y otros créditos fiscales por recuperar.

Los activos y pasivos por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas fiscales sobre los impuestos a la utilidad y PTU diferidos se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por PTU diferida se reconoce en el rubro de “Pagos anticipados y otros activos, neto”, en tanto que la PTU causada se reconoce en el rubro de “Pasivo por beneficios a los empleados” en el estado de situación financiera consolidado.

(Continúa)

El activo por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se evalúan periódicamente creando, en su caso, una reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los ORI. La PTU causada y diferida se incorporará dentro del rubro de “Gastos de administración y promoción” en el estado consolidado de resultado integral.

Activos intangibles

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del Banco.

Ante la presencia de algún indicio de deterioro del valor de un activo, se determina la posible pérdida por deterioro, y en caso de que el valor de recuperación sea menor al valor neto en libros se reduce el valor del activo y se reconoce la pérdida por deterioro en los resultados del ejercicio.

Captación tradicional

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del público en general y los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos en moneda nacional, extranjera o UDIS, mismos que se integran como se describe a continuación:

Depósitos de exigibilidad inmediata. Incluyen a las cuentas de cheques, cuentas de ahorro, a los depósitos en cuenta corriente, entre otros.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes del Banco, que no cuentan con una línea de crédito para tales efectos, se clasifican como adeudos vencidos en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y el Banco constituye simultáneamente a dicha clasificación una pérdida crediticia esperada por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

Depósitos a plazo. Incluyen, entre otros, a los certificados de depósito retirables en días preestablecidos, aceptaciones bancarias y pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento captados del público en general y a través de operaciones en el mercado de dinero, estos últimos referidos a depósitos a plazo realizados con otros intermediarios financieros, así como con tesorerías de empresas y de entidades gubernamentales.

Títulos de crédito. Se integran de, entre otros, los bonos bancarios y los certificados bursátiles.

Cuenta global de captación sin movimientos. Incluye el principal y los intereses de los instrumentos de captación que no tengan fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven en forma automática, así como las transferencias o las inversiones vencidas y no reclamadas.

(Continúa)
Si en el transcurso de tres años contados a partir de que los recursos se depositen en la cuenta global de captación sin movimientos, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública, El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto anteriormente descrito.

Los títulos colocados a descuento que no devenguen intereses (cupón cero), se registran al momento de la emisión tomando como base el monto de efectivo recibido.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva con base en lo establecido en la NIF C-19 "Instrumentos Financieros por Pagar (IFP)" y evaluar si la tasa determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso. Sólo en caso de que la tasa de interés de mercado sea sustancialmente distinta a la tasa efectiva, debe utilizarse la tasa de mercado como la tasa de interés efectiva en la valuación del instrumento, reconociendo en la utilidad o pérdida neta los efectos que se produzcan en el valor del IFP por el cambio de tasa de interés.

Los intereses de captación tradicional se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos de emisión, así como el descuento o premio en la colocación se reconocen como parte del pasivo que le dio origen, según se trate, el cual es amortizado en resultados conforme se devengue como gastos o ingresos por intereses, según

corresponda, tomando en consideración el plazo del título que le dio origen en proporción al vencimiento de los títulos.

Obligaciones subordinadas en circulación

Por las obligaciones subordinadas en circulación que reúnen las características establecidas por la NIF
C-12 "Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital", el instrumento es clasificado como pasivo dentro del estado de situación financiera consolidado. Los intereses se reconocen conforme al método de interés efectivo en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos que se incurran para emitir un instrumento financiero que califica como un pasivo deben deducirse del monto del pasivo y deben considerarse para determinar la tasa de interés efectiva.

Préstamos interbancarios y de otros organismos

En este rubro se registran los préstamos directos de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento. Asimismo, incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

(Continúa)
Los préstamos deberán reconocerse inicialmente al precio de la transacción, deben sumarse o restarse los costos de transacción, así como otras partidas pagadas por anticipado, tales como comisiones e intereses, el Banco deberá determinar el valor futuro de los flujos de efectivo estimados que se pagarán por principal e intereses contractuales, durante el plazo remanente del préstamo o en un plazo menor, si es que existe una probabilidad de prepago u otra circunstancia que requiera utilizar un plazo menor.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva, para el cálculo el Banco debe estimar los flujos de efectivo esperados considerando todos los términos contractuales del IFP (tales como prepago, extensión, reembolso anticipado y otras opciones similares), adicionalmente, debe evaluar si la tasa de interés efectiva determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso la entidad.

Si el Banco recibe un préstamo con una tasa de interés contractual que esté sustancialmente fuera de mercado, pero se paga una comisión por adelantado al inicio del crédito al determinar la tasa de interés efectiva con base en los anteriores párrafos, y debe tomarse en cuenta dicha comisión.

Acreedores diversos y otras cuentas por pagar

Los acreedores diversos y otras cuentas por pagar incluyen el pasivo por beneficios a los empleados de corto y largo plazo, provisiones y otras cuentas por pagar por la prestación de servicios bancarios comisiones por pagar, acreedores por adquisición de activos, dividendos por pagar, IVA trasladado y otros impuestos y derechos por pagar.

Los pasivos del Banco se valúan y reconocen en el estado de situación financiera

consolidado, para tal efecto deberán cumplir con la característica de ser una obligación presente, donde la transferencia de activos o presentación de servicios sea virtualmente ineludible, surja como consecuencia de un evento pasado y su cuantía y vencimiento se encuentran claramente establecidos.

El Banco reconoce una provisión cuando su cuantía o vencimientos son inciertos y se cumplen las siguientes condiciones: a) existe una obligación presente resultante de un evento pasado a cargo de la entidad, b) es probable que se presente la salida de recursos económicos como medio para liquidar dicha obligación y c) la obligación puede ser estimada razonablemente.

De no cumplirse las condiciones antes mencionadas, no se reconoce una provisión.

Beneficios a los empleados

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que devengan los servicios prestados. Se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

(Continúa)
Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Banco en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida- ver inciso (y) de esa nota y que se espera que el Banco pague después de los doce meses de la fecha del estado de situación financiera consolidado más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que los empleados han obtenido a cambio de su servicio en el ejercicio actual y en los anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las remediciones se reconocen en resultados en el período en que se devengan.

Beneficios por terminación

Se reconoce un pasivo y un costo o gasto por beneficios por terminación cuando el Banco no tiene alternativa realista diferente que la de afrontar los pagos o no pueda retirar la oferta de esos beneficios, o cuando cumple con las condiciones para reconocer los costos de una reestructuración, lo que ocurra primero. Si no se espera que se liquiden dentro de los 12 meses posteriores al cierre del ejercicio anual, entonces se descuentan.

Beneficios post-empleo

Planes de contribución definida

La obligación neta del Banco correspondiente a los planes de beneficios definidos por planes de pensiones y prima de antigüedad, se calcula de forma separada para cada plan, estimando el monto de los beneficios futuros que los empleados han ganado en el ejercicio actual y en ejercicios anteriores, descontando dicho monto y deduciendo al mismo, el valor razonable de los activos del plan. El Banco mantiene un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocen directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de “Gastos de administración y promoción”. Las contribuciones pagadas por anticipado se reconocen como un activo en la medida en que el pago por anticipado de lugar a una

reducción en los pagos a efectuar en el futuro o a un reembolso en efectivo (nota 21).

Planes de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos se realiza anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

(Continúa)
El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el período, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del período.

Las remediciones (antes ganancias y pérdidas actuariales), resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable.

Reconocimiento de ingresos

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan.

Los intereses devengados sobre cartera en Etapa 3 se reconocen en resultados hasta que se cobran.

Los intereses y comisiones cobradas por anticipado se registran dentro del rubro de “Créditos diferidos y cobros anticipados” y se aplican a resultados conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial de un crédito se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses durante la vida del crédito. Las comisiones por anualidad y renovación de productos de cartera comercial, consumo y vivienda se difieren, según corresponda, asimismo, los costos o gastos vinculados con el otorgamiento de créditos, se reconocen como un cargo diferido y se difieren durante el mismo plazo en el que se reconozcan los ingresos derivados por las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial del crédito; el seguro que en su caso sea financiado forma parte de la cartera de crédito.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento de crédito se presentan de manera neta de los costos y gastos asociados, presentándose en el rubro de otros activos, o bien de créditos diferidos y cobros anticipados según corresponda su naturaleza deudora o acreedora.

Las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos se adicionan a las comisiones originadas por el otorgamiento del crédito y se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito. Las demás comisiones se reconocen en el momento en que se generan en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Los intereses por inversiones en títulos de renta fija se reconocen en resultados conforme se devengan conforme al método de interés efectivo. Los intereses cobrados por operaciones de reporto se reconocen en resultados de acuerdo con el método de interés efectivo, a lo largo del plazo de la operación.

(Continúa)
Las comisiones ganadas por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devengan.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes se reconocen en los resultados conforme se devengan.

Concentración de negocio y crédito

Los productos del Banco se comercializan con un gran número de clientes, sin que exista concentración importante en algún cliente específico.

Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que pretende un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regula los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo. De acuerdo con dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400,000 UDIS por persona física o moral. El Banco reconoce en resultados del ejercicio las aportaciones obligatorias al IPAB.

Las aportaciones obligatorias al IPAB se deberán cubrir mensualmente y serán por un monto equivalente a la duodécima parte del cuatro al millar, sobre el promedio mensual de los saldos diarios de sus operaciones pasivas del mes de que se trate.

Cuentas de orden

En las cuentas de orden se registran activos o compromisos que no forman parte del estado de situación financiera consolidado del Banco ya que no se adquieren los

derechos de estos o dichos compromisos no se reconocen como pasivo de las entidades en tanto dichas eventualidades no se materialicen, respectivamente.

Compromisos crediticios:

El saldo representa el importe de cartas de crédito otorgadas por el Banco que son consideradas como créditos comerciales irrevocables no dispuestos por los acreditados y líneas de crédito autorizadas no ejercidas.

Las partidas registradas en esta cuenta están sujetas a calificación.

Bienes en fideicomiso o mandato:

El Banco registra en cuentas de orden las operaciones de Bienes o Fideicomisos acorde a lo siguiente:

Las que se limita al reconocimiento del patrimonio fideicomitido (activos del contrato), es decir, el valor de los bienes recibidos en fideicomiso netos de los pasivos, llevándose en registros independientes los datos relacionados con la administración de cada fideicomiso.

Las que por sus activos y pasivos resultan de las operaciones y cuyo reconocimiento y valuación se efectúa conforme a lo dispuesto en los criterios contables específicos aplicables al Banco.

(Continúa)
Las pérdidas a cargo del Banco por las responsabilidades en que haya incurrido como fiduciario, se reconocen en resultados en el período en el que éstas se conozcan, independientemente del momento en el que se realice cualquier promoción jurídica al efecto.

La unidad fiduciaria mantiene contabilidades especiales por cada contrato en el sistema fiduciario, y registra en las mismas y en su propia contabilidad el dinero y demás bienes, valores o derechos que se les confíen, así como los incrementos o disminuciones, por los productos o gastos respectivos, invariablemente los saldos de las contabilidades especiales de cada contrato de fideicomiso coinciden con los saldos de las cuentas de orden en que el Banco reconoce el patrimonio fideicomitido.

En ningún caso estos bienes estarán afectos a otras responsabilidades que las derivadas del fideicomiso mismo, o las que contra ellos corresponda a terceros de acuerdo con la Ley.

Cuando por la naturaleza de los fideicomisos establecidos en el Banco existan activos o pasivos a cargo o a favor de este, éstos se reconocen en el estado de situación financiera consolidado, según corresponda.

En el mandato se registra el valor declarado de los bienes objeto de los contratos de mandato celebrados por el Banco.

El reconocimiento de los ingresos por manejo de los fideicomisos se reconoce con base en lo devengado. Se suspende la acumulación de dichos ingresos, en el momento en que el adeudo por éstos presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, pudiendo volver a acumularse cuando el adeudo pendiente de pago sea liquidado en su totalidad.

En tanto los ingresos devengados por manejo de los fideicomisos se encuentren suspendidos de acumulación y no sean cobrados, el control de estos se lleva en cuentas

de orden. En caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

Bienes en custodia o en administración:

El efectivo y los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración se reflejan en las cuentas de orden respectivas y son valuados con base en el precio proporcionado por el proveedor de precios. Con excepción del efectivo o los activos virtuales recibidos para el pago de servicios por cuenta de terceros, debiéndose presentar en el rubro de efectivo y equivalentes de efectivo o en el de activos virtuales, según corresponda y, el pasivo que se genere, en el rubro de otras cuentas por pagar.

Los valores en custodia y administración están depositados en la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S. A. de C. V.

Los ingresos derivados de los servicios de custodia o administración reconocidos en los resultados del ejercicio se presentarán en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Colaterales recibidos por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos en operaciones de reporto y préstamo de valores actuando el Banco como reportadora o prestataria.

(Continúa)
Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía, cuando el Banco actúe como reportadora o prestataria.

Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito en Etapa 3:

Se registran los intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3.

Otras cuentas de registro:

Se registran principalmente por garantías recibidas por el Banco, entre otros.

Contingencias

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados.

Los ingresos o activos contingentes se deben reconocer en los estados financieros consolidados cuando la incorporación de beneficios económicos se convierta en probable, esto es, hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

Cuando se determine que los activos y pasivos contingentes no se tiene certeza razonable de la incorporación de beneficios económicos o de la existencia de una obligación presente, respectivamente, estos no se deben reconocer en los estados financieros consolidados, debido a que su existencia es posible mas no probable. En este caso, se busca revelar estimaciones de los posibles efectos financieros en las

notas a los estados financieros.

Mientras los activos y pasivos mantengan el carácter de contingentes, su control se debe llevar en cuentas de orden.

Reclasificaciones-

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

(Continúa)

Concepto	Originalmente reportadas	Reclasificadas retrospectivamente	Cifras después de reclasificaciones
Activo			
Pagos anticipados y otros activos, neto	$ 3,116	(143)	2,973
Pasivo			
Depósitos a plazo:			
Mercado de dinero	31,238	(63)	31,175
Títulos de crédito emitidos	11,845	(80)	11,765

Pronunciamientos normativos emitidos recientemente

Mejoras a las NIF 2024

Durante diciembre de 2023, el CINIF ha promulgado las siguientes Mejoras a las NIF 2024, que contiene modificaciones puntuales a algunas NIF ya existentes.

NIF A-1 Marco Conceptual de las Normas de Información Financiera - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada a partir de 2024 si se adoptan anticipadamente las revelaciones de las NIF particulares aplicables al tipo de entidad que corresponda. Incluye la definición de entidades de interés público y requiere que se revele si la entidad se considera una entidad de interés público o una entidad que no es de interés público. Divide los requerimientos de revelación de las NIF en: i) revelaciones aplicables a todas las entidades en general (entidades de interés público y entidades que no lo son), y ii) revelaciones adicionales obligatorias solo para las entidades de interés público. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF C-6, Propiedades, planta y equipo - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF B-2, Estado de flujos de efectivo/NIF B-6, Estado de situación financiera/ NIF B-17, Determinación del valor razonable/ NIF C-2, Inversión en instrumentos financieros/

NIF C-16, Deterioro de instrumentos financieros por cobrar/ NIF C-20, Instrumentos financieros para cobrar principal e interés/ INIF 24, Reconocimiento del efecto de la aplicación de las nuevas tasas de interés de referencia - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Cambia el término instrumentos financieros para cobrar o vender por instrumentos financieros para cobrar y vender. Cualquier cambio contable que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF C-10, Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Incluye el tratamiento contable de una cobertura de instrumentos financieros de capital cuya valuación a valor razonable se reconoce en el ORI. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

(Continúa)
NIF D-4, Impuestos a la utilidad - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Esta Mejora aclara cuál es la tasa aplicable que debe utilizarse para reconocer los activos y pasivos por impuestos a la utilidad causados y diferidos cuando hubo beneficios en tasas de impuestos del periodo para incentivar la capitalización de utilidades (utilidades no distribuidas). En estas circunstancias, los activos y pasivos por impuestos causados y diferidos deben determinarse con la tasa que será aplicable a las utilidades no distribuidas en el periodo, cuando se paguen como dividendos en periodos futuros. Cualquier cambio contable que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

La Administración se encuentra en proceso de evaluación para determinar los efectos de adopción de las mejoras a las NIF en los estados financieros consolidados.

ANEXO 1

Anexo - Desglose de créditosMoneda nacional [miembro]Moneda nacional [miembro]Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Acumulado Actual
(Cifras en pesos)
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Tipo de Crédito / InstituciónAño actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Desglose de créditos [partidas]
Bancarios [sinopsis]

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Con garantía (bancarios)

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Banca comercial
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si30/05/202330/05/20245.34316 + 0.66 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 2,081,359,981.94
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 17/08/202317/05/20245.31909 + 0.5 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,667,226,460.56
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 30/11/202330/08/20245.34316 + 0.44 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,248,573,072.50
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 22/12/202323/12/20245.32852 + 0.48 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,658,922,322.57
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 22/12/202322/11/20245.32852 + 0.48 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,658,922,322.57
TOTAL - - - - - - 8,315,004,160.15 - - - - -
Otros bancarios
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/11/202411.4875 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,526,288,888.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/09/202411.4875 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,526,288,888.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202331/08/202411.4875 + 0.37 SPREAD / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,526,333,333.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202331/08/202411.4875 + 0.37 SPREAD / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,526,333,333.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202431/01/202611.4875 + 0.44 SPREAD / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,526,488,888.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202431/01/202811.4875 + 0.55 SPREAD / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,526,733,333.33
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo14/12/201702/12/20278.48 + 0 SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,027,324,444.44
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo23/04/201814/04/20258.41 + 0 SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,039,246,666.67
FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo31/05/202201/01/20258.23 Tasa Fija 1,797,848.29
FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo31/05/202201/01/20268.23 Tasa Fija 489,983.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202229/01/20278.07 Tasa Fija 45,274,839.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 58,897,844.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 10,571,208.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 26,133,747.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 6,221,478.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 52,676,365.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202220/12/20287.4 Tasa Fija 23,438,795.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/03/202231/08/202512.8797 Tasa Fija 15,227,412.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202217/04/202611.7275 Tasa Fija 7,556,867.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202203/06/202711.755 Tasa Fija 13,118,856.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202206/06/202511.715

Tasa Fija 31,374,336.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202205/07/202711.7475
Tasa Fija 16,813,510.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.95852
Tasa Fija 6,861,021.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.95852
Tasa Fija 7,593,751.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/202215/09/202611.725
Tasa Fija 3,770,763.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7499
Tasa Fija 122,591,201.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7499
Tasa Fija 4,776,280.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7499
Tasa Fija 95,525,611.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202215/10/202711.7475
Tasa Fija 136,604,140.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202211/10/202711.7325
Tasa Fija 20,857,681.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202216/12/202211.37 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202216/12/202211.3957 Tasa Fija
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202223/10/20265.77941
Tasa Fija 53,388,576.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa
Fija 5,329,529.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa
Fija 18,380,927.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa
Fija 50,293,038.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202218/12/202611.7275
Tasa Fija 8,282,250.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202323/01/202511.6875
Tasa Fija 10,103,888.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202313/02/202511.6875
Tasa Fija 14,145,444.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202314/02/202511.6875
Tasa Fija 10,103,888.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202321/05/202411.5875
Tasa Fija 10,103,000.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202322/05/202411.5875
Tasa Fija 14,144,200.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202324/05/202411.5875
Tasa Fija 11,113,300.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202317/05/202411.5875
Tasa Fija 10,103,000.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/03/202315/05/202411.5875
Tasa Fija 10,103,000.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202331/03/20286.17626
Tasa Fija 62,464,697.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202310/05/202411.5875

Tasa Fija 9,092,700.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202313/05/202411.5875
Tasa Fija 9,092,700.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/05/202314/05/202711.725
Tasa Fija 955,259.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202331/05/20285.84626
Tasa Fija 13,501,224.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202325/05/20275.83941
Tasa Fija 53,598,142.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202331/05/202411.5875
Tasa Fija 12,627,422.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202330/03/20285.96822
Tasa Fija 102,771,986.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/06/202315/06/202711.725
Tasa Fija 5,895,462.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/202315/06/202811.745
Tasa Fija 33,046,694.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202320/06/202511.68 Tasa
Fija 17,060,671.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202328/06/202411.5875
Tasa Fija 20,206,000.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202306/07/202810.1 Tasa
Fija 8,151,617.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202306/07/202810.24 Tasa
Fija 5,922,948.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202322/06/20275.62941
Tasa Fija 35,672,251.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/202316/06/202811.7375
Tasa Fija 115,943,981.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/07/202329/06/202811.7375
Tasa Fija 146,272,254.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202301/07/202711.7237
Tasa Fija 4,298,278.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202325/08/20285.72941
Tasa Fija 79,886,692.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/07/202315/01/202511.625
Tasa Fija 559,178.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/08/202331/08/20285.62626
Tasa Fija 10,486,558.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/09/202312/09/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/09/202315/09/202711.725
Tasa Fija 1,576,627.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/09/202323/04/202411.345
Tasa Fija 50,110,298.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202331/07/202411.5875
Tasa Fija 22,961,363.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202325/04/202411.5875
Tasa Fija 20,206,000.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/09/202326/04/202411.5875
Tasa Fija 19,700,850.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/09/202329/09/202711.7375
Tasa Fija 9,051,798.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/10/202329/04/202411.5875
Tasa Fija 5,170,640.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/10/202329/09/202810.74 Tasa

Fija 29,733,755.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/10/202302/10/202810.83 Tasa Fija 8,143,858.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/10/202327/08/202711.5875 Tasa Fija 38,352,051.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/10/202301/04/202411.5937 Tasa Fija 1,767,471.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202302/04/202411.5875 Tasa Fija 25,257,500.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202305/10/202611.7075 Tasa Fija 13,036,347.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202305/04/202411.5875 Tasa Fija 9,092,700.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202308/04/202411.5875 Tasa Fija 10,102,999.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202308/04/202411.5875 Tasa Fija 20,206,000.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202309/04/202411.5875 Tasa Fija 15,154,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202304/04/202413.4075 Tasa Fija 122,191.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202309/04/202411.5875 Tasa Fija 10,102,999.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202304/04/202413.4052 Tasa Fija 3,581,934.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202305/04/202413.4052 Tasa Fija 1,101,974.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/10/202310/04/202411.5875 Tasa Fija 7,779,782.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/10/202312/04/202411.5875 Tasa Fija 4,041,200.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/10/202305/04/202413.4187 Tasa Fija 220,825.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202312/04/202413.4225 Tasa Fija 3,368,124.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202301/04/202413.4342 Tasa Fija 333,383.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202312/04/202413.4342 Tasa Fija 440,088.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202319/10/202811.7475 Tasa Fija 73,644,424.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202319/10/202811.7475 Tasa Fija 6,941,823.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/10/202311/04/202413.4411 Tasa Fija 4,083,180.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202317/02/202711.5775 Tasa Fija 35,952,648.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/10/202319/04/202413.428 Tasa Fija 1,059,680.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/10/202308/04/202413.428 Tasa Fija 1,113,403.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/10/202311/04/202413.428 Tasa Fija 148,935.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202319/04/202413.4457 Tasa Fija 1,066,568.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202315/04/202413.4457 Tasa Fija 419,150.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202315/04/202413.4458 Tasa Fija 354,575.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202318/04/202413.4458 Tasa Fija 12,025,847.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/10/202319/04/202411.5775 Tasa Fija 14,780,729.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202315/04/202413.4369 Tasa Fija 422,842.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202326/04/202413.4338 Tasa Fija 749,370.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202322/04/202413.4338 Tasa Fija 320,243.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202325/04/202413.3055 Tasa Fija 444,174.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202330/04/202411.5875 Tasa Fija 5,051,500.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202331/10/202811.7575 Tasa Fija 27,349,537.76

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/11/202325/04/202413.4227 Tasa Fija 1,309,400.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202324/04/202413.374 Tasa Fija 1,202,248.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202302/05/202411.585 Tasa Fija 11,099,116.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/202303/05/202411.585 Tasa Fija 15,135,158.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202303/05/202413.3762 Tasa Fija 1,650,800.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/202306/05/202411.5875 Tasa Fija 101,030,000.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202306/05/202411.585 Tasa Fija 15,125,504.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202306/05/202413.379 Tasa Fija 577,529.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202319/04/202413.379 Tasa Fija 1,084,276.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202302/05/202413.379 Tasa Fija 6,063,373.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202307/05/202411.585 Tasa Fija 15,120,677.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202302/05/202413.367 Tasa Fija 5,951,916.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/11/202308/05/202411.5859 Tasa Fija 5,038,619.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/11/202307/05/202413.3558 Tasa Fija 178,829.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202309/05/202411.5825 Tasa Fija 15,101,346.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202308/05/202413.3148 Tasa Fija 997,787.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202310/05/202411.5825 Tasa Fija 15,101,346.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202310/05/202413.3282 Tasa Fija 1,650,284.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202313/05/202411.5748 Tasa Fija 4,698,528.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202310/05/202411.5825 Tasa Fija 2,221,669.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202313/05/202411.5748 Tasa Fija 9,054,980.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202314/05/202411.57 Tasa Fija 4,023,140.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202314/05/202413.3066 Tasa Fija 267.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202315/05/202411.575 Tasa Fija 2,513,664.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202309/05/202413.3158 Tasa Fija 3,386,891.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202309/05/202413.3158 Tasa Fija 759,370.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202309/05/202413.3158 Tasa Fija 1,645,767.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202307/05/202411.585 Tasa Fija 5,040,225.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202309/05/202411.5825 Tasa Fija 5,033,782.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202310/05/202411.5825 Tasa Fija 5,033,782.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202308/05/202411.5859 Tasa Fija 5,038,619.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202314/05/202411.57 Tasa Fija 5,028,925.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202315/05/202411.575 Tasa Fija 5,027,329.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202316/05/202411.5775 Tasa Fija 5,020,903.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202317/05/202411.5775 Tasa Fija 5,020,903.82

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202319/10/202811.7275 Tasa Fija 92,226,425.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/11/202317/05/202413.3039 Tasa Fija 59,917.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202313/05/202411.5748 Tasa Fija 5,030,544.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/11/202317/05/202413.3039 Tasa Fija 48,396.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202313/05/202413.304 Tasa Fija 824,678.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202317/05/202413.304 Tasa Fija 2,049,615.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202317/05/202413.304 Tasa Fija 7,472.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202302/05/202413.304 Tasa Fija 2,225,266.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202322/05/202411.5799 Tasa Fija 2,809,006.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202322/05/202411.5799 Tasa Fija 3,711,901.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202322/05/202411.5799 Tasa Fija 3,511,258.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202322/05/202411.5799 Tasa Fija 3,511,258.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/11/202320/05/202413.304 Tasa Fija 44,763.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/11/202313/05/202413.304 Tasa Fija 424,744.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/11/202306/08/202411.585 Tasa Fija 28,010,192.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/11/202324/05/202411.3475 Tasa Fija 12,519,700.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202314/05/202413.3032 Tasa Fija 6,158.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202324/05/202413.304 Tasa Fija 1,197,661.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202309/05/202413.304 Tasa Fija 107,944.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202331/07/202411.5875 Tasa Fija 3,860,538.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202331/07/202411.5875 Tasa Fija 1,744,583.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202317/05/202413.3041 Tasa Fija 6,093.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202314/05/202413.3041 Tasa Fija 65,674.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202324/05/202413.3041 Tasa Fija 313,776.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202323/05/202413.3041 Tasa Fija 2,306,854.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202328/05/202413.3033 Tasa Fija 18,002.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/12/202328/05/202413.304 Tasa Fija 4,547.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/202330/11/20276.35626 Tasa Fija 13,088,901.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/12/202327/05/202413.3051 Tasa Fija 1,234,956.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202304/04/202412.755 Tasa Fija 323,076.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202320/05/202413.3038 Tasa Fija 10,390.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202304/04/202412.755 Tasa Fija 551,902.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202304/04/202412.755 Tasa Fija 85,730.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202303/06/202413.355 Tasa Fija 60,613.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202327/05/202411.3475 Tasa Fija 2,003,152.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202304/06/202411.585 Tasa Fija 10,090,105.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202329/05/202411.5875 Tasa Fija 2,020,600.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202305/04/202412.755 Tasa Fija 170,414.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202304/04/202412.755 Tasa Fija 84,442.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202304/04/202412.755 Tasa Fija 50,707.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202330/05/202413.355 Tasa Fija 5,827,198.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202323/05/202413.355 Tasa Fija 1,033,230.14

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202305/06/202411.5775 Tasa Fija 2,723,444.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202303/04/202412.755 Tasa Fija 154,661.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202301/04/202412.755 Tasa Fija 1,627,400.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202301/04/202412.755 Tasa Fija 1,100,891.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202304/04/202412.755 Tasa Fija 25,929.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202331/05/202413.355 Tasa Fija 1,784,300.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202303/06/202413.355 Tasa Fija 10,689.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/12/202303/06/202411.585 Tasa Fija 2,018,021.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/12/202304/04/202412.7575 Tasa Fija 186,718.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/12/202304/04/202412.7575 Tasa Fija 20,391.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/12/202304/04/202412.7575 Tasa Fija 9,140.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/12/202303/06/202413.3575 Tasa Fija 191,731.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/12/202307/06/202411.585 Tasa Fija 2,721,721.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/12/202304/04/202412.7575 Tasa Fija 41,282.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/12/202307/06/202411.585 Tasa Fija 11,088,496.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202310/06/202411.5825 Tasa Fija 2,718,242.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202301/04/202412.7585 Tasa Fija 158,110.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585 Tasa Fija 5,074.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202307/06/202413.3585 Tasa Fija 1,044,388.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202306/05/202413.3585 Tasa Fija 230,697.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202306/05/202413.3585 Tasa Fija 79,763.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585 Tasa Fija 1,201,699.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585 Tasa Fija 40,578.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585 Tasa Fija 102,771.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585 Tasa Fija 6,537.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202306/05/202413.3585 Tasa Fija 66,197.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202305/06/202411.5775 Tasa Fija 3,026,049.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202304/04/202412.7585 Tasa Fija 12,299.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202311/04/202411.5825 Tasa Fija 2,013,512.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202307/06/202411.585 Tasa Fija 3,024,135.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202301/04/20246.7465 Tasa Fija 248,960.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202305/04/202412.755 Tasa Fija 253,448.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202304/04/202412.755 Tasa Fija 13,147.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202304/04/202412.755 Tasa Fija 28,689.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202304/04/202412.755 Tasa Fija 13,600.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202310/06/202413.355 Tasa Fija 1,261,272.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202306/05/202413.355 Tasa Fija 203,657.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202311/06/202411.5825 Tasa Fija 2,718,242.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202305/04/202412.755 Tasa Fija 571,299.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202301/04/202412.755 Tasa Fija 186,223.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202306/05/202413.355 Tasa Fija 15,611.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202310/06/202411.5825 Tasa Fija 3,020,269.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/04/202411.5724 Tasa Fija 1,006,429.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/04/202411.5724 Tasa Fija 1,006,429.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202308/04/202412.754 Tasa Fija 735,274.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/04/202412.754 Tasa Fija 82,284.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202306/05/202413.354 Tasa Fija 46,198.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/04/202412.754 Tasa Fija 117,060.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202304/04/202412.754 Tasa Fija 139,383.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202316/05/202413.354 Tasa Fija 823,728.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202306/05/202413.354 Tasa Fija 136,614.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202308/04/202412.754 Tasa Fija 427,740.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202316/05/202413.354 Tasa Fija 1,032,689.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,027,113.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,027,113.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,027,113.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,027,113.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202312/06/202411.5724
Tasa Fija 5,032,145.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202305/04/202412.7475 Tasa Fija 50,809.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202305/04/202412.7475 Tasa Fija 927.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202308/04/202412.7475 Tasa Fija 3,467,534.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/202314/06/202411.57 Tasa
Fija 3,520,247.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/202314/06/202411.57 Tasa
Fija 5,028,925.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202305/04/202412.7475 Tasa Fija 114,564.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202308/04/202412.7475 Tasa Fija 70,503.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202312/04/202412.7475 Tasa Fija 2,074,360.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202304/04/202412.7475 Tasa Fija 44,893.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202304/04/202412.7475 Tasa Fija 14,604.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202310/05/202413.3475 Tasa Fija 430,126.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/12/202323/05/202413.3475 Tasa Fija 1,454,502.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/202312/06/202411.5724

Tasa Fija 3,019,287.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202308/04/202412.7475 Tasa Fija 141,348.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202304/04/202412.7475 Tasa Fija 584,251.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202306/05/202413.3475 Tasa Fija 632,223.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202314/06/202411.57 Tasa Fija 3,017,355.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202303/06/202413.3475 Tasa Fija 585,050.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202306/05/202413.3475 Tasa Fija 13,484.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202316/07/202411.5775 Tasa Fija 50,209,038.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202312/04/202412.7425 Tasa Fija 390,782.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202308/04/202412.7425 Tasa Fija 147,782.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202304/04/202412.7425 Tasa Fija 1,208,170.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202308/04/202412.7425 Tasa Fija 29,731.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202317/07/202411.5775 Tasa Fija 41,171,411.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202317/06/202411.5775 Tasa Fija 3,012,542.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202304/04/202412.7425 Tasa Fija 16,145.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202303/06/202413.3425 Tasa Fija 248,123.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202306/05/202413.3425 Tasa Fija 93,238.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202318/06/202411.5775 Tasa Fija 12,552,259.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485 Tasa Fija 50,112.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485 Tasa Fija 211,078.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202306/05/202413.3485 Tasa Fija 666,955.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202318/06/202411.5775 Tasa Fija 3,012,542.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202309/04/202412.7485 Tasa Fija 203,001.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202306/05/202413.3485 Tasa Fija 73,322.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202317/04/202412.7485 Tasa Fija 91,610.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485 Tasa Fija 17,357.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485 Tasa Fija 842,168.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202304/04/202412.7485 Tasa Fija 40,367.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/06/202411.5775 Tasa Fija 12,552,259.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/04/202411.5775 Tasa Fija 1,004,180.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/04/202411.5775 Tasa Fija 1,004,180.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/06/202411.5775 Tasa Fija 2,008,361.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202301/04/202412.7515 Tasa Fija 169,526.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202317/04/202412.7515 Tasa Fija 491,725.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202308/04/202412.7515 Tasa Fija 8,861.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202304/04/202412.7515 Tasa Fija 106,033.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202314/06/202413.3515 Tasa Fija 1,097,396.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202330/04/202413.3515 Tasa Fija 109,361.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202306/05/202413.3515 Tasa Fija 431,364.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202306/05/202413.3515 Tasa Fija 27,360.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202319/04/202411.5775 Tasa Fija 1,004,180.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202315/04/202412.7515 Tasa Fija 4,112,525.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202313/06/202413.3515 Tasa Fija 2,472,448.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/12/202320/06/202411.5775 Tasa Fija 15,057,887.50

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/12/202324/04/202411.345 Tasa Fija 1,002,205.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202315/04/202412.7516 Tasa Fija 4,926,561.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202315/04/202412.7516 Tasa Fija 564,521.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202305/04/202412.7516 Tasa Fija 5,520.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202301/04/202412.7516 Tasa Fija 295,571.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202315/04/202412.7516 Tasa Fija 143,494.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202304/04/202412.7516 Tasa Fija 64,347.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202304/04/202412.7516 Tasa Fija 109,025.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202304/04/202412.7516 Tasa Fija 4,972.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202304/04/202412.7516 Tasa Fija 22,001.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202317/06/202413.3516 Tasa Fija 330,586.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202315/04/202412.7516 Tasa Fija 120,218.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202321/06/202411.58 Tasa Fija 12,544,229.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202315/04/20246.58726 Tasa Fija 603,141.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202315/04/202412.7412 Tasa Fija 418,694.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202308/04/202412.7412 Tasa Fija 141,998.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202320/06/202413.3412 Tasa Fija 631,701.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202325/04/202411.5875 Tasa Fija 20,206,000.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202315/04/202412.7412 Tasa Fija 144,026.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202304/04/202412.7412 Tasa Fija 241,008.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202304/04/202412.7412 Tasa Fija 14,354.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202306/05/202413.3412 Tasa Fija 36,490.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202327/12/20289.73 Tasa Fija 289,676,651.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202319/04/202412.7462 Tasa Fija 1,785,868.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202319/04/202412.7462 Tasa Fija 306,129.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202326/04/202411.5875 Tasa Fija 10,103,000.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 746,328.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 40,145.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 1,584,855.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202306/05/202413.3462 Tasa Fija 1,217,337.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202306/05/202413.3462 Tasa Fija 479,353.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202315/04/202412.7462 Tasa Fija 144,044.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 324,974.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 1,800,436.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 315,517.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 29,450.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202304/04/202412.7462 Tasa Fija 1,714.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202326/04/202411.347 Tasa Fija 1,001,891.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202326/04/202411.347 Tasa Fija 1,001,891.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202326/04/202411.347 Tasa Fija 2,003,782.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202319/04/202412.725 Tasa Fija 100,700.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202315/04/202412.725 Tasa Fija 7,028.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202321/06/202413.325 Tasa Fija 884,156.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202326/06/202411.347 Tasa Fija 24,045,388.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202304/04/202412.725 Tasa Fija 11,205.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202306/05/202413.325 Tasa Fija 131,160.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202306/05/202413.325 Tasa Fija 11,481.95

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202426/04/202412.7525 Tasa Fija 752,048.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202422/04/202412.7525 Tasa Fija 5,484,198.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202404/04/202412.7525 Tasa Fija 667,788.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202422/04/202412.7525 Tasa Fija 1,108,337.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202404/04/202412.7525 Tasa Fija 441,588.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202422/04/20246.55772 Tasa Fija 304,509.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202415/04/202412.7522 Tasa Fija 8,846.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202404/04/202412.7522 Tasa Fija 135,144.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202404/04/202412.7522 Tasa Fija 15,717.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202406/05/202413.4822 Tasa Fija 880,175.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202406/05/202413.4822 Tasa Fija 410,049.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202404/04/202412.7522 Tasa Fija 200,098.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202401/07/202413.4822 Tasa Fija 9,570.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202406/05/202413.4822 Tasa Fija 26,379.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202406/05/202413.4822 Tasa Fija 3,295.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202406/05/202413.4822 Tasa Fija 9,134.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202406/05/202413.4822 Tasa Fija 6,467.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202401/07/202413.4825 Tasa Fija 82,229.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202406/05/202413.4825 Tasa Fija 1,550,190.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202404/04/202412.7525 Tasa Fija 2,547,028.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202424/06/202413.4825 Tasa Fija 860,405.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202406/05/202413.4825 Tasa Fija 66,911.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202406/05/202413.4825 Tasa Fija 20,074.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202404/04/202411.585
Tasa Fija 454,054.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202426/04/202412.7525 Tasa Fija 353,955.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202406/05/202413.4825 Tasa Fija 1,044,246.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202403/05/202411.585
Tasa Fija 1,009,010.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202403/07/202411.585
Tasa Fija 10,090,105.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202420/06/202413.4825 Tasa Fija 3,371,809.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202403/05/202411.585
Tasa Fija 13,117,137.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/01/202422/04/20246.57808 Tasa Fija 145,783.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/01/202429/04/202412.7525 Tasa Fija 6,334,969.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 154,142.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/01/202401/04/202412.7525 Tasa Fija 20,122.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 476,535.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/01/202426/06/202411.347
Tasa Fija 8,015,129.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202408/04/202412.7525 Tasa Fija 25,174.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202429/04/202412.7525 Tasa Fija 1,113,731.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202401/07/202413.4825 Tasa Fija 1,254,447.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/01/202405/07/202411.5775
Tasa Fija 10,086,831.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/01/202408/04/202411.5859
Tasa Fija 201,544.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/01/202408/04/202411.5859
Tasa Fija 251,930.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202407/05/202412.7525 Tasa Fija 360,071.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202401/04/202412.7525 Tasa Fija 4,025.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202404/04/202412.7525 Tasa Fija 179,384.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202401/07/202411.5937
Tasa Fija 8,079,867.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202404/04/202412.7525 Tasa Fija 40,474.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202404/06/202413.4825 Tasa Fija 40,584.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202401/04/202412.7525 Tasa Fija 644,959.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 64,895.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202408/07/202413.4825 Tasa Fija 3,886.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202429/04/20246.57317 Tasa Fija 57,242.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/01/202403/07/202411.585
Tasa Fija 8,072,084.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202412/04/202412.7525 Tasa Fija 56,308.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202403/05/202412.7525 Tasa Fija 43,002.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202401/04/202412.7525 Tasa Fija 65,342.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202403/07/202413.4825 Tasa Fija 216,018.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 281,659.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 199,982.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202408/07/202413.4825 Tasa Fija 77,976.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202417/04/202412.7525 Tasa Fija 13,466.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202401/04/202412.7525 Tasa Fija 552,637.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202401/07/202413.4825 Tasa Fija 52,002.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202404/06/202413.4825 Tasa Fija 20,180.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202411/04/202411.5825
Tasa Fija 402,702.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202429/04/20246.58474 Tasa Fija 70,922.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202405/07/202411.5775
Tasa Fija 8,069,465.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202403/05/202412.7525 Tasa Fija 479,913.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 615,367.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202404/04/202412.7525 Tasa Fija 462,581.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202427/06/202413.4825 Tasa Fija 5,556,005.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202403/05/202412.7525 Tasa Fija 1,118,829.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202417/04/202412.7525 Tasa Fija 8,861.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202404/04/202412.7525 Tasa Fija 181,716.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202405/07/202413.4825 Tasa Fija 3,682,434.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202404/06/202413.4825 Tasa Fija 17,137.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202404/06/202413.4825 Tasa Fija 22,549.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 311,022.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 5,758.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 311,093.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202406/05/202412.7525 Tasa Fija 12,931.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202404/06/202413.4825 Tasa Fija 4,409.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202404/06/202413.4825 Tasa Fija 19,564.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202404/06/202413.4825 Tasa Fija 18,879.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202404/06/202413.4825 Tasa Fija 5,095.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202403/07/202411.585
Tasa Fija 7,163,974.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202403/07/202411.585
Tasa Fija 7,163,974.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202403/07/202411.585
Tasa Fija 7,163,974.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202403/07/202411.585
Tasa Fija 7,163,974.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/01/202408/07/202411.5859
Tasa Fija 8,061,791.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202406/05/202412.7475 Tasa Fija 1,402,934.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202406/05/202412.7475 Tasa Fija 101,036.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202404/04/202412.7475 Tasa Fija 507,514.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202408/04/202412.7475 Tasa Fija 80,971.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202405/07/202413.4775 Tasa Fija 2,709,012.48

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202406/05/202412.7475 Tasa Fija 154,227.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202404/06/202413.4775 Tasa Fija 13,531.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202406/05/202412.7475 Tasa Fija 2,027,277.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202406/05/202412.7475 Tasa Fija 51,313.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202404/06/202413.4775 Tasa Fija 3,946.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202410/07/202411.5825
Tasa Fija 8,054,051.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202408/04/202412.7502 Tasa Fija 71,705.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202408/07/202413.4802 Tasa Fija 250,497.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202404/04/202412.7502 Tasa Fija 206,625.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202415/04/202411.575
Tasa Fija 402,186.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202406/05/202412.7502 Tasa Fija 79,423.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202406/05/202412.7502 Tasa Fija 21,158.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202406/05/202412.7502 Tasa Fija 6,417.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202409/07/202413.4802 Tasa Fija 1,265,894.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202412/07/202411.5724
Tasa Fija 2,012,858.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202412/07/202413.4788 Tasa Fija 8,525,375.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202402/05/202412.7488 Tasa Fija 190,996.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202406/05/202412.7488 Tasa Fija 28,971.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202406/05/202412.7488 Tasa Fija 751,657.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202406/05/202412.7488 Tasa Fija 982,199.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202404/06/202413.4788 Tasa Fija 25,937.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202410/05/202415.5006 Tasa Fija 1,414,304.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202408/04/202412.7506 Tasa Fija 563,886.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202408/04/202412.7506 Tasa Fija 340,702.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202406/05/202412.7506 Tasa Fija 2,809,771.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202406/05/202412.7506 Tasa Fija 754,949.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202404/04/202412.7506 Tasa Fija 64,502.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202412/07/202413.4806 Tasa Fija 817,103.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202427/06/202413.4806 Tasa Fija 415,924.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202410/05/202415.5006 Tasa Fija 18,835.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202412/07/202413.4806 Tasa Fija 1,887,925.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202415/07/202413.4806 Tasa Fija 2,849.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202418/04/202411.5775
Tasa Fija 451,881.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202406/05/202412.751 Tasa Fija 233,721.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202404/04/202412.751 Tasa Fija 43,038.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202412/07/202413.001 Tasa Fija 1,035,903.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202429/04/20246.51611 Tasa Fija 1,398,026.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202413/05/202412.751 Tasa Fija 630,751.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202413/05/202412.751 Tasa Fija 1,312,228.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202406/05/202412.751 Tasa Fija 2,003,948.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202406/05/202412.751 Tasa Fija 15,395.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202415/04/202412.751 Tasa Fija 7,773.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202404/07/202413.001 Tasa Fija 3,377,146.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202414/05/202412.7517 Tasa Fija 76,803.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202415/04/202412.7517 Tasa Fija 652,450.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202415/04/202412.7517 Tasa Fija 7,470.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202406/05/202412.7517 Tasa Fija 280,803.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202404/04/202412.7517 Tasa Fija 155,384.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202415/04/202412.7517 Tasa Fija 42,032.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202402/05/202412.7517 Tasa Fija 80,463.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202406/05/202412.7517 Tasa Fija 38,713.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202404/06/202413.4817 Tasa Fija 31,268.48

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202404/06/202413.4817 Tasa Fija 9,588.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202403/05/202415.5017 Tasa Fija 39,209.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202415/04/202412.7517 Tasa Fija 131,502.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202418/07/202413.4817 Tasa Fija 1,026,213.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/01/202404/06/202413.4817 Tasa Fija 126,969.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202413/05/20246.55933 Tasa Fija 988,117.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202416/05/202412.7485 Tasa Fija 176,669.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202406/05/202412.7485 Tasa Fija 170,581.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202406/05/202412.7485 Tasa Fija 44,753.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202404/06/202413.4785 Tasa Fija 44,274.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202406/05/202412.7485 Tasa Fija 137,578.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/01/202422/04/202411.5799 Tasa Fija 451,447.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202412/04/202415.4985 Tasa Fija 15,610.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202415/04/202412.7485 Tasa Fija 62,948.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202406/05/202412.7485 Tasa Fija 477,010.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/01/202417/01/202511.5875 Tasa Fija 4,829,234.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202413/05/202412.7502 Tasa Fija 124,750.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202419/07/202413.4802 Tasa Fija 1,282,536.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202411/04/202412.7502 Tasa Fija 2,354.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202422/07/202413.4802 Tasa Fija 1,891.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202415/07/202411.575 Tasa Fija 6,032,795.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202417/07/202411.5775 Tasa Fija 6,025,084.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202421/05/202412.7515 Tasa Fija 1,149,675.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202413/05/202412.7515 Tasa Fija 14,689.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202406/05/202412.7515 Tasa Fija 54,073.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202406/05/202412.7515 Tasa Fija 116,126.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202422/07/202413.4815 Tasa Fija 8,498,897.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202421/05/202412.7515 Tasa Fija 36,938.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202406/05/202412.7515 Tasa Fija 18,037.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202422/05/202412.7515 Tasa Fija 155,480.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202404/04/202412.7515 Tasa Fija 31,615.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202404/06/202413.4815 Tasa Fija 16,358.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202404/04/202412.7515 Tasa Fija 5,950,022.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202419/07/202411.5775 Tasa Fija 6,025,084.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202404/04/202412.7495 Tasa Fija 191,830.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202422/07/202413.4795 Tasa Fija 2,975.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202418/07/202413.4795 Tasa Fija 8,750,328.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202401/04/202415.4995 Tasa Fija 4,874.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202406/05/202412.7495 Tasa Fija 283,694.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202404/06/202413.4795 Tasa Fija 9,589.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202417/05/202415.4995 Tasa Fija 409,068.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202420/05/202412.7495 Tasa Fija 1,371,574.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202425/04/202411.345 Tasa Fija 450,992.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202422/04/202412.7495 Tasa Fija 43,900.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202420/05/202412.7495 Tasa Fija 252,524.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202422/04/202412.7495 Tasa Fija 26,335.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/01/202422/07/202411.5799 Tasa Fija 6,019,299.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/01/202422/04/202412.7485 Tasa Fija 23,365.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/01/202406/05/202412.7485 Tasa Fija 59,499.60

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/01/202420/05/202412.7485 Tasa Fija 363,694.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/01/202406/05/202412.7485 Tasa Fija 3,806.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/01/202422/04/202412.7485 Tasa Fija 174,468.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/01/202406/05/202412.7485 Tasa Fija 224,093.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/01/202406/05/202412.7485 Tasa Fija 149,884.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/01/202406/05/202412.7485 Tasa Fija 207,029.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/01/202419/04/20246.51959 Tasa Fija 10,436.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202424/07/202411.345
Tasa Fija 6,013,235.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202420/05/20246.5574 Tasa Fija 36,159.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202401/04/202412.749 Tasa Fija 193,594.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202406/05/202412.749 Tasa Fija 9,917.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202406/05/202412.749 Tasa Fija 72,544.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202420/05/202412.749 Tasa Fija 79,599.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202406/05/202412.749 Tasa Fija 225,742.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202403/05/202412.749 Tasa Fija 2,222,922.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202401/04/202412.749 Tasa Fija 349,743.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202415/04/202412.749 Tasa Fija 6,798.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202406/05/202412.749 Tasa Fija 37,514.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202406/05/202412.749 Tasa Fija 196,392.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202404/04/202412.749 Tasa Fija 1,711,973.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202406/05/202412.749 Tasa Fija 83,965.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202422/04/202412.749 Tasa Fija 969.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202429/04/202411.5875
Tasa Fija 50,515,000.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202420/05/20246.55269 Tasa Fija 62,034.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202426/07/202413.48 Tasa Fija 1,043,071.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202406/05/202412.75 Tasa Fija 66,815.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202406/05/202412.75 Tasa Fija 109,961.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202410/04/202412.75 Tasa Fija 98,562.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202429/07/202413.48 Tasa Fija 38,438.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202404/06/202413.48 Tasa Fija 3,949.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/02/202430/04/202411.5875
Tasa Fija 404,120.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202424/05/202412.7512 Tasa Fija 768,876.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202404/04/202412.7512 Tasa Fija 411,513.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202419/04/202412.7512 Tasa Fija 387,178.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202410/05/202412.7512 Tasa Fija 279,827.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/02/202430/04/202411.5937
Tasa Fija 50,499,173.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202413/05/202412.7512 Tasa Fija 79,922.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202406/05/202412.7512 Tasa Fija 26,978.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202406/05/202412.7512 Tasa Fija 318,630.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202406/05/202412.7512 Tasa Fija 270,833.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202404/06/202413.4812 Tasa Fija 556,874.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202428/05/202412.7512 Tasa Fija 113,768.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202406/05/202412.7512 Tasa Fija 1,301.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202406/05/202412.7512 Tasa Fija 157,612.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202406/05/202412.7512 Tasa Fija 6,472.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202418/07/202413.4812 Tasa Fija 276,028.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202404/06/202413.4812 Tasa Fija 22,068.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202404/06/202413.4812 Tasa Fija 7,944.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202419/04/20246.51533 Tasa Fija 27,121.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202425/07/202413.4793 Tasa Fija 6,960,204.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202404/06/202413.4793 Tasa Fija 62,399.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202404/04/202412.7493 Tasa Fija 1,305,337.39

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202401/04/202412.6493 Tasa Fija 62,454.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202427/05/202412.7493 Tasa Fija 2,661,840.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202404/04/202412.7493 Tasa Fija 340,337.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202427/05/202412.7493 Tasa Fija 279,176.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202406/05/202412.7493 Tasa Fija 7,282.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202429/04/202412.7493 Tasa Fija 2,252.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202429/07/202411.5875 Tasa Fija 6,061,800.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202404/04/202412.6484 Tasa Fija 186,926.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202401/04/202412.6484 Tasa Fija 86,744.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202401/04/202412.6484 Tasa Fija 2,235,733.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202401/04/202412.6484 Tasa Fija 3,875.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202427/05/202412.7484 Tasa Fija 1,067,863.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202427/05/202412.7484 Tasa Fija 968,410.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202404/06/202412.7484 Tasa Fija 63,983.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202429/04/202412.7484 Tasa Fija 65,370.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/02/202406/05/202411.585 Tasa Fija 453,765.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202404/06/202412.7484 Tasa Fija 25,836.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202429/04/202412.7484 Tasa Fija 28,018.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/02/202402/08/202411.585 Tasa Fija 6,054,063.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202404/06/202412.7484 Tasa Fija 1,645,463.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202406/05/202412.7484 Tasa Fija 2,778.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/02/202404/06/202412.7484 Tasa Fija 52,766.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202401/04/20246.51613 Tasa Fija 1,832,379.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202431/05/202412.748 Tasa Fija 295,198.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202406/05/202412.748 Tasa Fija 22,806.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202429/05/202412.748 Tasa Fija 714,674.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202405/07/202413.478 Tasa Fija 74,671.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202404/04/202412.648 Tasa Fija 20,817.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202406/05/202412.748 Tasa Fija 23,466.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202406/05/202412.748 Tasa Fija 264,213.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202406/05/202412.748 Tasa Fija 798,914.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/02/202402/08/202411.585 Tasa Fija 6,054,063.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202401/04/20246.52258 Tasa Fija 8,701.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202405/08/202411.5775 Tasa Fija 6,052,098.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202404/04/202412.649 Tasa Fija 244,010.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202404/06/202412.749 Tasa Fija 967,274.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202404/06/202412.749 Tasa Fija 720,679.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202404/06/202412.749 Tasa Fija 462,198.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202404/06/202412.749 Tasa Fija 47,609.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202404/06/202412.749 Tasa Fija 524.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202422/07/202413.479 Tasa Fija 71,681.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202415/07/202413.479 Tasa Fija 1,165,347.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202406/08/202411.5875 Tasa Fija 5,051,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202404/06/202412.749 Tasa Fija 50,786.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202405/07/202413.479 Tasa Fija 258,448.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202405/07/202413.479 Tasa Fija 104,421.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202431/05/202412.749 Tasa Fija 412,504.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202415/05/202412.749 Tasa Fija 178,729.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202408/05/202411.5859 Tasa Fija 20,154,478.67

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202408/05/202411.5859 Tasa Fija 50,386,196.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202424/06/202411.345 Tasa Fija 8,017,607.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/01/202428/06/202411.59 Tasa Fija 8,084,954.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202407/08/202411.5875 Tasa Fija 5,051,500.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202407/08/202411.585 Tasa Fija 6,048,270.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202424/05/202412.7482 Tasa Fija 1,152,079.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202407/06/202412.7482 Tasa Fija 741,644.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202410/04/202412.7482 Tasa Fija 17,338.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202420/05/202412.7482 Tasa Fija 35,475.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202429/04/202412.7482 Tasa Fija 290,536.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202403/05/20246.51426 Tasa Fija 436,389.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202424/05/20246.59344 Tasa Fija 204,396.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202427/05/20246.59344 Tasa Fija 69,000.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202409/05/202411.5825 Tasa Fija 503,378.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202405/04/202412.6482 Tasa Fija 102,645.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202426/04/202412.7482 Tasa Fija 1,180,038.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202427/05/202412.7482 Tasa Fija 12,123.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202404/06/202412.7482 Tasa Fija 133,700.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202404/06/202412.7482 Tasa Fija 151,377.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202408/04/202412.6482 Tasa Fija 76,103.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202403/06/202412.7482 Tasa Fija 884,398.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202403/05/202412.7482 Tasa Fija 218,694.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202405/07/202413.4782 Tasa Fija 61,303.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202420/01/202511.5875 Tasa Fija 4,625,295.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202421/01/202511.5875 Tasa Fija 3,021,351.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202404/04/202412.6482 Tasa Fija 527,869.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202418/07/202413.4782 Tasa Fija 244,699.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202401/08/202413.4782 Tasa Fija 8,307,969.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/02/202409/08/202411.5825 Tasa Fija 6,040,538.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202408/04/202412.6495 Tasa Fija 247,435.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202407/06/202412.7495 Tasa Fija 32,472.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202403/06/202412.7495 Tasa Fija 180,661.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202403/06/202412.7495 Tasa Fija 129,504.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202406/05/202412.7495 Tasa Fija 29,507.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202421/06/202413.4795 Tasa Fija 2,116.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202408/04/20246.50135 Tasa Fija 103,500.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/02/202425/07/202411.5875 Tasa Fija 5,051,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202401/04/202412.6495 Tasa Fija 8,674.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202403/06/202412.7495 Tasa Fija 391,987.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202404/06/202412.7495 Tasa Fija 218,651.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202429/04/202412.7495 Tasa Fija 19,696.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202405/07/202413.4795 Tasa Fija 326,099.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202424/05/202412.7495 Tasa Fija 617,405.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202404/06/202412.7495 Tasa Fija 24,247.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202404/06/202412.7495 Tasa Fija 10,375.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202404/06/202412.7495 Tasa Fija 4,504.05

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202402/08/202413.4795 Tasa Fija 535,592.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202405/07/202413.4795 Tasa Fija 161,327.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202426/04/20246.50135 Tasa Fija 1,100,764.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/02/202426/07/202411.5875 Tasa Fija 5,051,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202431/05/202412.7507 Tasa Fija 29,803.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202401/04/202412.6507 Tasa Fija 29,264.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202431/05/202412.7507 Tasa Fija 192,177.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202407/06/202412.7507 Tasa Fija 3,051,002.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202405/07/202413.4807 Tasa Fija 75,884.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202427/05/202412.7507 Tasa Fija 10,176.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/02/202413/05/202411.5748 Tasa Fija 452,749.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202412/08/202411.5875 Tasa Fija 5,051,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202408/04/202412.6466 Tasa Fija 748,279.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202429/04/202412.2466 Tasa Fija 71,478.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202404/06/202412.7466 Tasa Fija 71,401.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202405/08/202413.4766 Tasa Fija 5,122.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202408/04/202412.6466 Tasa Fija 1,349,460.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202404/06/202412.7466 Tasa Fija 100,818.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202406/05/202412.7466 Tasa Fija 28,421.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202415/07/202413.4766 Tasa Fija 623,001.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202431/05/202412.7466 Tasa Fija 293,171.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202406/05/202412.7466 Tasa Fija 37,652.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202404/06/202412.7466 Tasa Fija 5,457.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202417/05/202412.7466 Tasa Fija 124,292.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202414/05/202411.57 Tasa Fija 20,115,700.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202414/05/202411.57 Tasa Fija 60,347,100.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202413/08/202411.5875 Tasa Fija 5,051,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202401/04/202412.6483 Tasa Fija 38,812.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202407/06/202412.7483 Tasa Fija 1,270,568.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202404/06/202412.7483 Tasa Fija 254,574.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202415/04/202412.6483 Tasa Fija 395,353.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202422/04/202412.7483 Tasa Fija 1,826.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202405/07/202413.4783 Tasa Fija 64,143.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202401/04/202412.6483 Tasa Fija 118,574.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202431/05/202412.7483 Tasa Fija 384,405.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202425/07/202413.4783 Tasa Fija 1,865,814.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202412/06/202412.7483 Tasa Fija 83,940.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202404/06/202412.7483 Tasa Fija 72,036.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202413/06/202411.5875 Tasa Fija 2,020,600.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202414/08/202411.5875 Tasa Fija 5,051,500.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202414/06/202411.5875 Tasa Fija 2,020,600.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202410/04/202412.6454 Tasa Fija 122,327.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202414/06/202412.7454 Tasa Fija 1,058,219.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202404/06/202412.7454 Tasa Fija 7,722.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202404/06/202412.7454 Tasa Fija 52,517.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202425/07/202413.4754 Tasa Fija 410,136.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202405/07/202413.4754 Tasa Fija 1,753.91

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202424/05/202412.7454 Tasa Fija 83,685.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202411/04/202412.6454 Tasa Fija 340,838.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202424/05/202412.7454 Tasa Fija 317,131.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202410/06/202412.7454 Tasa Fija 428,842.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202418/04/202412.7454 Tasa Fija 150,928.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202404/06/202412.7454 Tasa Fija 9,811.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202404/06/202412.7454 Tasa Fija 493,702.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202404/06/202412.7454 Tasa Fija 19,315.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202413/05/202412.7454 Tasa Fija 1,501.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202405/07/202413.4754 Tasa Fija 462,714.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202410/04/202412.6454 Tasa Fija 125,271.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202415/04/202412.6454 Tasa Fija 483,186.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202410/06/202412.7454 Tasa Fija 2,449,395.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202410/06/202412.7454 Tasa Fija 181,650.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202413/05/202412.7454 Tasa Fija 48,343.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202412/08/202413.4754 Tasa Fija 577.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/02/202414/06/202412.745 Tasa Fija 1,129,843.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/02/202413/05/202412.745 Tasa Fija 72,701.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202418/06/202411.5875
Tasa Fija 2,020,600.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/02/202415/04/202412.645 Tasa Fija 629,138.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/02/202423/05/202412.745 Tasa Fija 88,299.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/02/202415/04/202412.645 Tasa Fija 3,334,295.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/02/202411/06/202412.745 Tasa Fija 36,551.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/02/202422/04/202412.745 Tasa Fija 940,528.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202402/08/202411.5875
Tasa Fija 5,051,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202410/04/202412.645 Tasa Fija 66,345.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202405/04/202412.645 Tasa Fija 37,769.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202413/06/202412.745 Tasa Fija 158,661.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202403/06/202412.745 Tasa Fija 65,551.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202406/05/202411.495 Tasa Fija 1,582,693.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202405/07/202413.475 Tasa Fija 70,892.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202419/06/202411.5875
Tasa Fija 2,020,600.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202412/08/202413.475 Tasa Fija 3,889.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202420/05/202411.5775
Tasa Fija 50,192,958.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202419/04/202412.645 Tasa Fija 94,314.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202415/04/202412.645 Tasa Fija 629,025.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202407/06/202412.745 Tasa Fija 613,810.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202408/05/202412.745 Tasa Fija 36,427.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202404/06/202412.745 Tasa Fija 14,385.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202404/06/202411.495 Tasa Fija 28,007.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202405/07/202413.475 Tasa Fija 24,149.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202431/07/202411.5875
Tasa Fija 2,366,484.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202431/07/202411.5875
Tasa Fija 4,483,864.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202402/08/202411.585
Tasa Fija 8,984,074.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202402/08/202411.585
Tasa Fija 8,984,074.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202413/02/202611.675
Tasa Fija 2,890,850.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202419/08/202411.5875

Tasa Fija 5,051,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202415/04/20246.51402 Tasa Fija 2,096,866.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202410/06/20246.63116 Tasa Fija 11,038.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202407/06/202412.7425 Tasa Fija 240,172.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202425/04/202412.7425 Tasa Fija 23,122.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202404/06/202412.7425 Tasa Fija 23,717.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202429/04/202412.7425 Tasa Fija 18,588.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202431/05/202412.7425 Tasa Fija 130,314.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202420/06/202411.5875
Tasa Fija 2,020,600.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202401/04/202412.6425 Tasa Fija 39,401.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202404/06/202412.7425 Tasa Fija 223,657.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202421/06/202411.5875
Tasa Fija 1,010,300.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202420/08/202411.5875
Tasa Fija 5,051,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202412/04/202412.6462 Tasa Fija 1,575.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202414/06/202412.7462 Tasa Fija 640,098.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202419/08/202413.4762 Tasa Fija 5,526.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202406/05/202412.7462 Tasa Fija 17,872.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202404/06/202411.4962 Tasa Fija 76,648.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202406/05/202412.7462 Tasa Fija 4,924.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202406/05/202412.7462 Tasa Fija 3,647.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202412/08/202413.4762 Tasa Fija 21,650.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202415/08/202413.4762 Tasa Fija 8,535,979.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202405/07/202413.4762 Tasa Fija 1,887,662.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202426/04/20246.52574 Tasa Fija 443,265.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202415/04/20246.52574 Tasa Fija 80,712.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202410/04/202412.6462 Tasa Fija 75,110.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202419/06/202412.7462 Tasa Fija 67,400.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202404/06/202411.4962 Tasa Fija 8,459.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202408/08/202413.4762 Tasa Fija 278,756.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202422/05/202411.5799
Tasa Fija 50,160,831.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202405/07/202412.4762 Tasa Fija 1,727,124.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202421/06/202411.58 Tasa
Fija 1,003,538.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202407/06/202412.7425 Tasa Fija 25,467.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202410/06/202412.7425 Tasa Fija 90,100.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202404/06/202412.7425 Tasa Fija 218,735.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202404/06/202411.4925 Tasa Fija 955,959.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202404/06/202412.7425 Tasa Fija 9,815.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202405/07/202413.4725 Tasa Fija 182,886.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202418/04/202412.6425 Tasa Fija 423,618.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202404/04/202412.6425 Tasa Fija 637.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202429/04/202412.2425 Tasa Fija 13,899,136.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202417/06/202412.7425 Tasa Fija 212,049.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202404/06/202411.4925 Tasa Fija 119,083.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202404/06/202412.7425 Tasa Fija 123,029.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202419/08/202413.4725 Tasa Fija 3,492.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202408/08/202413.4725 Tasa Fija 2,237,375.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202421/08/202411.5875
Tasa Fija 5,051,500.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202423/05/202411.345
Tasa Fija 350,772.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202422/04/202412.6425 Tasa Fija 760,244.98

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202422/04/202412.6425 Tasa Fija 709,705.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202422/04/202412.6425 Tasa Fija 114,358.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202417/05/202412.7425 Tasa Fija 372,682.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202417/06/202412.7425 Tasa Fija 1,375,936.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202406/06/202412.7425 Tasa Fija 475,955.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202417/06/202412.7425 Tasa Fija 284,162.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202406/05/202411.4925 Tasa Fija 539,574.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202420/05/202412.7425 Tasa Fija 47,425.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202409/08/202411.5825 Tasa Fija 11,985,144.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202421/08/202411.5875 Tasa Fija 8,587,550.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202422/04/20246.52383 Tasa Fija 24,125.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202419/04/202412.6425 Tasa Fija 1,157,082.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202420/06/202412.7425 Tasa Fija 486,262.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202420/05/202412.7425 Tasa Fija 10,225.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202404/06/202412.7425 Tasa Fija 264,454.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202420/05/202412.7425 Tasa Fija 2,889.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202406/05/202412.7425 Tasa Fija 18,041.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202404/06/202411.4925 Tasa Fija 56,263.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202406/05/202412.7425 Tasa Fija 2,601.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202420/05/202412.7425 Tasa Fija 169,284.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202404/06/202412.7425 Tasa Fija 25,039.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202422/04/202412.6425 Tasa Fija 26,760.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202420/05/202412.7425 Tasa Fija 40,030.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202404/06/202411.4925 Tasa Fija 2,429,126.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202412/08/202413.4725 Tasa Fija 294,196.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/02/202423/08/202411.345 Tasa Fija 4,008,823.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/02/202419/11/20246.18383 Tasa Fija 25,404,915.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/02/202423/02/20299.9 Tasa Fija 99,574,096.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/02/202423/08/202411.5875 Tasa Fija 15,154,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202417/06/20246.67351 Tasa Fija 22,878.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202403/04/202412.6391 Tasa Fija 17,854.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202414/06/202412.7391 Tasa Fija 88,291.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202404/06/202412.7391 Tasa Fija 35,529.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202406/05/202412.7391 Tasa Fija 28,381.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202413/05/202412.7391 Tasa Fija 7,561.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202405/07/202413.4691 Tasa Fija 78,188.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202425/04/202412.6391 Tasa Fija 36,676.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202401/04/202412.6391 Tasa Fija 48,556.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202422/04/202412.6391 Tasa Fija 16,290.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202424/05/202412.7391 Tasa Fija 418,012.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202404/06/202411.4891 Tasa Fija 18,054.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202429/04/202412.7391 Tasa Fija 1,997.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202422/08/202411.5875 Tasa Fija 11,618,450.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202404/06/202412.7391 Tasa Fija 519.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202412/08/202413.4691 Tasa Fija 641,551.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202421/02/202511.5875 Tasa Fija 4,990,952.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202421/02/202511.5875 Tasa Fija 5,126,300.59

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202425/04/202412.64 Tasa Fija 15,430.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202404/04/202412.64 Tasa Fija 298,015.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202422/04/202412.64 Tasa Fija 5,940.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202417/05/202412.74 Tasa Fija 32,253.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202420/05/202412.74 Tasa Fija 21,348.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202404/06/202411.49 Tasa Fija 19,959.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202404/06/202412.74 Tasa Fija 425,775.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202406/05/202412.74 Tasa Fija 2,343.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202405/07/202413.47 Tasa Fija 197,322.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202408/05/202412.74 Tasa Fija 3,194.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/02/202428/05/202411.59 Tasa Fija 20,212,483.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202404/04/202412.6375 Tasa Fija 87,004.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202428/05/202412.7375 Tasa Fija 6,840.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202406/05/202412.7375 Tasa Fija 32,218.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202426/08/202413.4675 Tasa Fija 26,810.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202426/08/202413.4675 Tasa Fija 1,001,851.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202422/08/202413.4675 Tasa Fija 2,207,474.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202404/04/202411.4875 Tasa Fija 136,874.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202404/06/202411.4875 Tasa Fija 19,766.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202422/08/202413.4675 Tasa Fija 5,877,685.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202426/04/202412.6375 Tasa Fija 814,119.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202425/04/202412.6375 Tasa Fija 40,574.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202424/05/202412.7375 Tasa Fija 549,205.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202426/06/202412.7375 Tasa Fija 48,354.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202410/06/202412.7375 Tasa Fija 6,249.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202426/08/202413.4675 Tasa Fija 4,351.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202425/04/202412.6437 Tasa Fija 21,994.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202408/04/202412.6437 Tasa Fija 8,626.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202425/04/202412.6437 Tasa Fija 661,229.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202404/04/202412.6437 Tasa Fija 163,194.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202404/04/202411.4937 Tasa Fija 104,295.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202417/06/202412.7437 Tasa Fija 21,867.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202427/06/202412.7437 Tasa Fija 718,782.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202404/06/202412.7437 Tasa Fija 278,530.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202404/06/202411.4937 Tasa Fija 80,502.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202404/06/202412.7437 Tasa Fija 470,500.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202422/08/202413.4737 Tasa Fija 2,731,569.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202405/07/202413.4737 Tasa Fija 639,184.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202405/07/202412.4737 Tasa Fija 2,541.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202405/07/202413.4737 Tasa Fija 172,981.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202423/04/202412.6437 Tasa Fija 2,461,461.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202415/04/202412.6437 Tasa Fija 225,165.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202426/06/202412.7437 Tasa Fija 235,523.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202424/06/202412.7437 Tasa Fija 225,519.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202427/05/202412.7437 Tasa Fija 1,948.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202405/07/202413.4737 Tasa Fija 46,969.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/03/202430/05/202411.5937 Tasa Fija 403,993.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202429/04/202412.6437 Tasa Fija 369,870.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202429/04/202412.6437 Tasa Fija 233,174.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202422/04/202412.6437 Tasa Fija 1,078,953.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202429/04/202412.6437 Tasa Fija 43,143.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202424/06/202412.7437 Tasa Fija 2,015,122.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202404/06/202412.7437 Tasa Fija 7,265.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202427/05/202412.7437 Tasa Fija 32,731.31

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/03/202423/01/202511.5937 Tasa Fija 4,631,230.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202423/04/202412.635 Tasa Fija 1,442,829.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202429/04/202412.635 Tasa Fija 903,155.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202420/05/202412.735 Tasa Fija 156,280.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202404/06/202412.735 Tasa Fija 877,362.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202424/06/202412.735 Tasa Fija 217,418.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202427/05/202412.735 Tasa Fija 287,587.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202426/08/202413.465 Tasa Fija 8,205.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202429/04/20246.53352 Tasa Fija 642,602.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202417/06/20246.67493 Tasa Fija 160,647.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202402/07/202411.585 Tasa Fija 1,009,010.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202403/06/202412.735 Tasa Fija 37,607.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202427/06/202412.735 Tasa Fija 2,726,985.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202427/05/202412.735 Tasa Fija 1,876.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202418/07/202413.465 Tasa Fija 3,638,025.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 264,382.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202402/07/202411.585 Tasa Fija 1,009,010.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202402/07/202411.585 Tasa Fija 1,009,010.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202404/06/202412.735 Tasa Fija 205,695.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202429/04/20246.53112 Tasa Fija 438,453.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202430/08/202411.5775 Tasa Fija 5,043,415.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202412/04/202412.6275 Tasa Fija 52,976.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202422/04/202412.6275 Tasa Fija 77,536.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202404/04/202412.6275 Tasa Fija 214,499.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202409/05/202412.7275 Tasa Fija 22,330.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202406/05/202412.7275 Tasa Fija 43,441.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202404/06/202411.4775 Tasa Fija 1,290,249.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202404/06/202412.7275 Tasa Fija 25,428.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202427/05/202412.7275 Tasa Fija 32,803.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202405/07/202413.4575 Tasa Fija 1,477,306.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202405/07/202413.4575 Tasa Fija 116,699.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202404/06/202412.7275 Tasa Fija 102,170.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202405/07/202413.4575 Tasa Fija 15,845.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202403/06/202411.5775 Tasa Fija 302,604.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202404/04/202412.6275 Tasa Fija 102,662.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202406/05/202411.4775 Tasa Fija 1,262,052.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202404/06/202412.7275 Tasa Fija 1,268,977.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202404/06/202412.7275 Tasa Fija 150,613.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202403/05/202412.6275 Tasa Fija 55,151.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202414/06/202412.7275 Tasa Fija 131,507.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202410/05/202412.7275 Tasa Fija 79,793.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202403/05/202412.6275 Tasa Fija 3,994.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202402/09/202411.585 Tasa Fija 5,041,834.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202427/05/20246.52376 Tasa Fija 97,828.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202405/04/202412.635 Tasa Fija 58,998.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202425/04/202412.635 Tasa Fija 24,389.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202419/04/202412.635 Tasa Fija 139,314.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202424/05/202412.735 Tasa Fija 29,557.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202427/05/202412.735 Tasa Fija 17,747.25

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202426/08/202413.465 Tasa Fija 1,227,369.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202425/04/202412.635 Tasa Fija 124,996.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202418/06/202412.735 Tasa Fija 154,358.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202404/06/202412.735 Tasa Fija 111,580.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202404/06/202412.735 Tasa Fija 298,125.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202427/05/202412.735 Tasa Fija 1,538.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 251,817.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 1,185,214.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 645.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 1,004.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202404/07/202411.585 Tasa Fija 20,167,338.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202404/07/202411.585 Tasa Fija 20,167,338.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202403/09/202411.585 Tasa Fija 5,040,225.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202406/05/202412.635 Tasa Fija 400,954.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202402/07/202412.735 Tasa Fija 265,870.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202404/06/202411.485 Tasa Fija 59,986.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202404/06/202412.735 Tasa Fija 9,683.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202402/09/202413.465 Tasa Fija 36,820.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202403/05/202412.635 Tasa Fija 14,108.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202406/05/202412.635 Tasa Fija 2,654,318.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202421/06/202412.735 Tasa Fija 1,567.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202403/07/202412.735 Tasa Fija 86,572.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202412.735 Tasa Fija 36,428.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202411.485 Tasa Fija 20,592.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202412.735 Tasa Fija 4,688.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202412.735 Tasa Fija 8,295.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202403/10/202411.585 Tasa Fija 120,965,416.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202412.735 Tasa Fija 15,697.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202402/09/202413.465 Tasa Fija 31,804.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202425/04/202412.6359 Tasa Fija 154,692.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202410/04/202412.6359 Tasa Fija 107,011.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202419/04/202412.6359 Tasa Fija 70,708.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202402/05/202412.6359 Tasa Fija 272,604.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202406/05/202412.6359 Tasa Fija 445,118.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202428/06/202412.7359 Tasa Fija 1,383,945.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202405/06/202412.7359 Tasa Fija 615,139.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202417/06/202412.7359 Tasa Fija 33,644.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202404/06/202412.7359 Tasa Fija 6,442.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202416/08/202413.4659 Tasa Fija 296,196.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202406/06/202411.5859 Tasa Fija 403,089.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202406/05/202412.6359 Tasa Fija 414,135.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202404/04/202411.4859 Tasa Fija 1,017,012.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202406/05/202412.6359 Tasa Fija 136,695.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202410/05/202412.7359 Tasa Fija 41,164.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202401/07/202412.7359 Tasa Fija 2,020,921.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202403/06/202412.7359 Tasa Fija 229,654.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202405/07/202412.7359 Tasa Fija 3,907.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202403/06/202412.7359 Tasa Fija 2,869.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202415/08/202413.4659 Tasa Fija 515,587.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202405/07/202412.7359 Tasa Fija 287,213.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202410/05/202412.6325 Tasa Fija 80,329.48

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202406/05/202412.6325 Tasa Fija 2,422,264.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202404/07/202412.7325 Tasa Fija 209,918.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202424/06/202412.7325 Tasa Fija 150,798.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202405/07/202412.7325 Tasa Fija 48,759.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202401/07/202412.7325 Tasa Fija 209,712.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202404/06/202411.4825 Tasa Fija 111,696.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202403/06/202412.7325 Tasa Fija 15,580.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202402/09/202413.4625 Tasa Fija 146,355.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202411/03/20295.42 Tasa Fija 99,689,188.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202424/05/20246.52122 Tasa Fija 131,282.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202406/05/20246.52122 Tasa Fija 380,073.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202429/04/202412.6325 Tasa Fija 1,518,929.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202404/06/202412.7325 Tasa Fija 420,673.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202404/06/202411.4825 Tasa Fija 3,153,851.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202404/06/202412.7325 Tasa Fija 276,256.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202403/06/202412.7325 Tasa Fija 12,001.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202425/04/202412.6325 Tasa Fija 37,526.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202409/07/202412.7325 Tasa Fija 2,014,854.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202404/06/202412.7325 Tasa Fija 24,323.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202405/07/202411.4825 Tasa Fija 10,769.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202404/06/202412.7325 Tasa Fija 66,317.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202402/09/202413.4625 Tasa Fija 6,581.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202406/03/20256.16771 Tasa Fija 18,718,451.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/03/202410/06/202411.5724 Tasa Fija 402,571.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202429/04/20246.52084 Tasa Fija 60,225.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202419/04/202412.6224 Tasa Fija 7,290.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202415/04/202412.6224 Tasa Fija 76,113.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202402/07/202412.7224 Tasa Fija 50,198.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202405/07/202412.7224 Tasa Fija 39,360.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202402/09/202413.4524 Tasa Fija 1,520,262.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202406/05/202412.6224 Tasa Fija 1,325,634.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202405/08/202413.4524 Tasa Fija 181,729.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202403/05/202412.6248 Tasa Fija 457,414.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202410/05/202412.6248 Tasa Fija 269,645.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 62,170.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202404/04/202412.6248 Tasa Fija 199,837.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202404/07/202412.7248 Tasa Fija 152,614.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 27,637.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202431/05/202412.7248 Tasa Fija 1,035,870.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202403/06/202412.7248 Tasa Fija 39,657.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 74,250.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 77,628.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 43,360.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 23,773.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202410/09/202411.57 Tasa Fija 35,202,475.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202411/04/202412.62 Tasa Fija 2,651.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202425/04/202412.62 Tasa Fija 169,848.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202408/04/202412.62 Tasa Fija 21,998.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202421/06/202412.72 Tasa Fija 380,926.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202410/07/202412.72 Tasa Fija 861,557.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202404/06/202412.72 Tasa Fija 38,131.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/07/202412.72 Tasa Fija 251,676.90

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202403/09/202413.45 Tasa Fija 230,400.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/09/202413.45 Tasa Fija 1,637,651.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202423/04/202412.62 Tasa Fija 662,427.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202406/05/202412.62 Tasa Fija 6,953.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202403/06/202412.72 Tasa Fija 43,895.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/07/202412.72 Tasa Fija 339,232.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/07/202412.72 Tasa Fija 318,471.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202403/06/202412.72 Tasa Fija 900.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202407/03/20256.13544
Tasa Fija 21,929,568.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202426/04/202412.62 Tasa Fija 75,468.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202429/04/202412.62 Tasa Fija 37,163.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/07/202412.72 Tasa Fija 15,355.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/08/202413.45 Tasa Fija 38,708.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202405/12/20246.12516
Tasa Fija 7,896,016.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202410/05/202412.625 Tasa Fija 9,215.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202404/07/202412.725 Tasa Fija 24,562.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 3,294,409.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 37,027.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 375,950.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202403/06/202412.725 Tasa Fija 4,810.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/09/202413.455 Tasa Fija 1,991,221.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/08/202413.455 Tasa Fija 19,410.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202422/04/202412.625 Tasa Fija 24,893,099.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202402/05/202412.625 Tasa Fija 370,976.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202404/04/202412.625 Tasa Fija 92,066.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202424/05/202412.725 Tasa Fija 334,984.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202412/07/202412.725 Tasa Fija 78,890,026.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202404/06/202412.725 Tasa Fija 698,176.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202409/09/202413.455 Tasa Fija 151,049.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202429/08/202413.455 Tasa Fija 657,551.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202413/05/202412.625 Tasa Fija 514,943.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 50,098.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 20,810.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 19,655.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202409/09/202413.455 Tasa Fija 109,472.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202429/08/202413.455 Tasa Fija 323,291.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/08/202413.455 Tasa Fija 149,901.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202410/06/202412.725 Tasa Fija 20,032.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 377,113.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202410/06/202412.725 Tasa Fija 48,179.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202403/06/202412.725 Tasa Fija 2,892.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/08/202413.455 Tasa Fija 239,417.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202410/05/202412.6275 Tasa Fija 10,294.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202407/05/202412.6275 Tasa Fija 940,259.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202413/05/202412.6275 Tasa Fija 838,065.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202415/04/202412.6275 Tasa Fija 1,141.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202410/07/202412.7275 Tasa Fija 317,622.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202408/07/202412.7275 Tasa Fija 2,760,542.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 84,241.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202427/05/202412.7275 Tasa Fija 342.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202408/07/202412.7275 Tasa Fija 175,100.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 57,503.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202410/06/202412.7275 Tasa Fija 139,720.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202409/09/202413.4575 Tasa Fija 4,881.98

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202406/05/202412.6275 Tasa Fija 194,738.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202415/04/202412.6275 Tasa Fija 91,659.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202422/04/202412.6275 Tasa Fija 126,229.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202404/04/202412.6275 Tasa Fija 856.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202410/06/202412.7275 Tasa Fija 209,510.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 77,117.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 184,269.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 123,553.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202410/05/202412.6275 Tasa Fija 1,066,114.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202422/04/202412.6275 Tasa Fija 982,377.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202408/04/202412.6275 Tasa Fija 69,527.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202411/06/202412.7275 Tasa Fija 5,470,367.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202413/05/20246.53251 Tasa Fija 418,243.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202417/06/20246.53251 Tasa Fija 13,536.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202408/07/20246.67514 Tasa Fija 83,632.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202407/05/202412.6275 Tasa Fija 29,727.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202406/05/202412.6275 Tasa Fija 92,337.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202406/05/202412.6275 Tasa Fija 12,942.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202421/06/202412.7275 Tasa Fija 226,516.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202410/06/202412.7275 Tasa Fija 62,151.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 25,298.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202404/06/202412.7275 Tasa Fija 50,517.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 437,288.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202403/06/202412.7275 Tasa Fija 3,423.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202412/09/202413.4575 Tasa Fija 3,468,700.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 46,049.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202427/05/202412.7275 Tasa Fija 14,497.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/03/202418/06/202411.5775 Tasa Fija 401,543.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202401/04/20246.52864 Tasa Fija 10,142.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202413/06/202412.73 Tasa Fija 3,407.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202419/04/202412.63 Tasa Fija 445,801.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202406/05/202412.63 Tasa Fija 5,994.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202406/05/202412.63 Tasa Fija 59,001.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202406/05/202412.63 Tasa Fija 3,111.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202406/05/202412.63 Tasa Fija 3,779.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202407/06/202412.73 Tasa Fija 566,601.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202404/06/202412.73 Tasa Fija 35,767.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202405/07/202412.73 Tasa Fija 115,816.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202404/06/202412.73 Tasa Fija 2,318.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202412/04/202412.63 Tasa Fija 475,013.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202413/05/202412.63 Tasa Fija 29,302.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202412/07/202412.73 Tasa Fija 1,374,756.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202417/07/202412.73 Tasa Fija 88,746.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202404/06/202412.73 Tasa Fija 419,038.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202413/09/202413.46 Tasa Fija 21,854.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202429/04/202412.63 Tasa Fija 2,183,551.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202401/07/202412.73 Tasa Fija 21,346.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202405/07/202412.73 Tasa Fija 89,316.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202405/07/202412.73 Tasa Fija 314,471.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202405/07/202412.73 Tasa Fija 325,655.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202411/03/202611.63 Tasa Fija 10,035,536.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202419/03/202710.69 Tasa Fija 14,045,729.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202419/07/202411.58 Tasa

Fija 10,035,383.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202417/09/202411.58 Tasa Fija 9,031,845.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202416/12/20246.013 Tasa Fija 15,265,495.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202420/06/202411.5799 Tasa Fija 451,447.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202410/05/202412.6299 Tasa Fija 19,516.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202406/05/202412.6299 Tasa Fija 1,046,884.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202406/05/202412.6299 Tasa Fija 521,603.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202411/06/202412.7299 Tasa Fija 3,532.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202427/05/202412.7299 Tasa Fija 191,805.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 360,358.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 76,494.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202410/06/202412.7299 Tasa Fija 7,998.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202420/05/202412.6299 Tasa Fija 805,834.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202416/05/202412.6299 Tasa Fija 786,009.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202420/05/202412.6299 Tasa Fija 963,025.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202406/05/202412.6299 Tasa Fija 59,537.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202415/07/202412.7299 Tasa Fija 2,104,560.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202413/06/202412.7299 Tasa Fija 1,227,073.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 68,198.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202417/06/202412.7299 Tasa Fija 238,707.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202415/07/202412.7299 Tasa Fija 779,573.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 14,925.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 2,582.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202417/06/202412.7299 Tasa Fija 62,594.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202413/09/202413.4599 Tasa Fija 209,371.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/09/202413.4599 Tasa Fija 5,106,909.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/08/202413.4599 Tasa Fija 196,744.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202402/05/202412.13 Tasa Fija 19,968,789.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202418/09/202411.5799 Tasa Fija 14,045,032.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202413/09/202411.5799 Tasa Fija 6,019,299.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202409/09/202411.5799 Tasa Fija 5,016,083.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202418/09/202411.5799 Tasa Fija 2,006,433.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202418/09/202411.5799 Tasa Fija 1,805,789.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202429/08/202411.5799 Tasa Fija 3,419,511.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202429/08/202411.5799 Tasa Fija 3,419,511.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202415/04/20246.52941 Tasa Fija 8,602.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202408/04/20246.52941 Tasa Fija 57,854.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202420/05/20246.51996 Tasa Fija 412,891.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202413/05/20246.51996 Tasa Fija 80,344.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202408/07/20246.64578 Tasa Fija 212,280.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202425/04/202412.395 Tasa Fija 64,411.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202406/05/202412.395 Tasa Fija 144,257.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202422/04/202412.395 Tasa Fija 5,943.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202425/06/202412.495 Tasa Fija 150,864.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Fija 122,590.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Fija 44,693.89

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Fija 195,445.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Fija 19,576.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202426/04/202412.395 Tasa Fija 17,677.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202406/05/202412.395 Tasa Fija 165,064.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202422/04/202412.395 Tasa Fija 2,726.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202406/05/202412.395 Tasa Fija 1,640,398.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202413/05/202412.395 Tasa Fija 44,821.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202412/07/202412.495 Tasa Fija 1,903,884.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202404/06/202412.495 Tasa Fija 38,478.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202404/06/202412.495 Tasa Fija 30,101.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202403/06/202412.495 Tasa Fija 60,213.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202425/04/202412.395 Tasa Fija 59,245.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202401/04/202412.395 Tasa Fija 535,547.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202401/07/202412.495 Tasa Fija 34,813.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Fija 146,812.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Fija 849,183.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202404/06/202412.495 Tasa Fija 47,578.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Fija 2,487.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/08/202413.225 Tasa Fija 27,906.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/08/202413.225 Tasa Fija 22,864.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/08/202413.225 Tasa Fija 2,232.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/03/202419/09/202411.345 Tasa Fija 2,004,411.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202415/04/20246.52871 Tasa Fija 6,413.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/04/202412.397 Tasa Fija 246,328.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202413/05/202412.397 Tasa Fija 11,442.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202425/06/202412.497 Tasa Fija 2,184,340.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202427/05/202412.497 Tasa Fija 28,044.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202408/07/202412.497 Tasa Fija 335,224.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/07/202412.497 Tasa Fija 134,618.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/08/202413.227 Tasa Fija 7,228.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202407/06/20246.51248 Tasa Fija 79,346.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/04/202412.397 Tasa Fija 299,842.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202427/05/202412.497 Tasa Fija 898.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/04/202412.397 Tasa Fija 155,649.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202406/05/202412.397 Tasa Fija 10,170.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202404/06/202412.497 Tasa Fija 43,100.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/07/202412.497 Tasa Fija 587,935.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/07/202412.497 Tasa Fija 2,021,003.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202404/06/202412.497 Tasa Fija 3,077.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202420/09/202411.347 Tasa Fija 2,003,782.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202417/05/202412.397 Tasa Fija 204,478.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202416/04/202412.397 Tasa Fija 743,875.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202412/07/202412.497 Tasa Fija 431,375.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202427/05/202412.497 Tasa Fija 74,408.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/07/202412.497 Tasa Fija 96,434.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202420/09/202413.227 Tasa Fija 1,141,964.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202413/09/202413.227 Tasa Fija 315,010.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/08/202413.227 Tasa Fija 469,039.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/08/202413.227 Tasa Fija 23,727.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202420/12/20245.94248 Tasa Fija 13,868,252.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202427/02/202511.347 Tasa Fija 4,211,195.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202425/06/202411.3475

Tasa Fija 400,630.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202408/04/202412.3975 Tasa Fija 311,103.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202406/05/202412.3975 Tasa Fija 136,185.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202406/05/202412.3975 Tasa Fija 141,931.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202417/07/202412.4975 Tasa Fija 47,632.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202424/06/202412.4975 Tasa Fija 128,992.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/07/202412.4975 Tasa Fija 394,748.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/07/202412.4975 Tasa Fija 2,812,982.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202410/06/202412.4975 Tasa Fija 61,689.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Fija 19,939.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Fija 6,896.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202425/06/202411.3475 Tasa Fija 1,001,576.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202413/05/202412.3975 Tasa Fija 2,289,343.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202420/05/202412.3975 Tasa Fija 11,536.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202414/06/202412.4975 Tasa Fija 545,680.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202422/07/202412.4975 Tasa Fija 2,159,850.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/07/202412.4975 Tasa Fija 13,051.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202424/06/202412.4975 Tasa Fija 143,106.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202423/09/202413.2275 Tasa Fija 4,867.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Fija 21,356.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Fija 22,229.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Fija 9,908.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202401/04/202411.3475 Tasa Fija 50,078,802.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202423/09/202411.3475 Tasa Fija 500,788.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202423/09/202411.3475 Tasa Fija 500,788.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202423/09/202411.3475 Tasa Fija 500,788.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa Fija 9,372,171.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa Fija 3,098,158.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/201931/05/202411.5875 Tasa Fija 366,068.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/07/201928/06/202411.5875 Tasa Fija 39,903,856.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5875 Tasa Fija 1,112,212.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5875 Tasa Fija 936,095.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5875 Tasa Fija 204,305.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5875 Tasa Fija 3,607,126.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/201928/06/202411.5875 Tasa Fija 3,749,791.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/201928/06/202411.5875 Tasa Fija 4,247,045.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201928/06/202411.5875 Tasa Fija 2,124,409.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/201917/10/202411.5775 Tasa Fija 1,547,671.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201928/06/202411.5875

Tasa Fija 22,186,980.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/11/201926/11/202411.347
Tasa Fija 2,003,782.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/201928/06/202411.5875
Tasa Fija 12,678,274.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/201928/06/202411.5875
Tasa Fija 12,678,274.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201928/06/202411.5875
Tasa Fija 5,042,269.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201917/10/202411.5775
Tasa Fija 1,069,076.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201928/06/202411.5875
Tasa Fija 3,486,525.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202016/01/202511.5775
Tasa Fija 11,901,401.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202017/10/202411.5775
Tasa Fija 967,427.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202026/11/202411.347
Tasa Fija 2,277,983.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202006/09/202411.585
Tasa Fija 144,453.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202010/01/20255.74565
Tasa Fija 3,233,585.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202028/06/202411.5875
Tasa Fija 7,119,563.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202026/03/20256.76 Tasa
Fija 1,381,144.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202004/04/202511.585
Tasa Fija 3,277,192.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.5775
Tasa Fija 3,500,523.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.5775
Tasa Fija 3,090,378.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202025/10/202411.3475
Tasa Fija 1,295,789.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa
Fija 909,837.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa
Fija 2,642,200.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa
Fija 2,136,128.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202007/05/202511.585
Tasa Fija 1,764,079.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202026/11/202411.347
Tasa Fija 553,772.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202027/03/20255.66 Tasa
Fija 2,855,301.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.7497
Tasa Fija 217,197.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.7497
Tasa Fija 310,263.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202031/05/202411.7497
Tasa Fija 264,975.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202006/09/202411.585
Tasa Fija 71,625.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202020/06/202511.5799

Tasa Fija 2,508,041.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202026/06/202511.347
Tasa Fija 5,009,455.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.3475
Tasa Fija 11,818,597.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.5875
Tasa Fija 13,133,899.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.3475
Tasa Fija 12,018,912.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.3475
Tasa Fija 12,018,912.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa
Fija 91,766.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa
Fija 710,370.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202006/09/202411.585
Tasa Fija 118,015.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202020/08/20255.77 Tasa
Fija 11,353,314.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202025/08/202511.345
Tasa Fija 4,891,719.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 920,841.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 1,184,948.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202019/09/202511.58 Tasa
Fija 3,010,615.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 481,654.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202019/09/202511.58 Tasa
Fija 3,010,615.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202006/12/202411.585
Tasa Fija 7,058,568.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202006/09/202411.585
Tasa Fija 113,280.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202025/09/202411.345
Tasa Fija 431,991.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/10/202030/10/202511.5875
Tasa Fija 52,920,476.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202004/11/202511.585
Tasa Fija 42,921,381.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202025/09/202411.345
Tasa Fija 1,048,941.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202019/12/202511.58 Tasa
Fija 54,191,069.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/01/202126/01/202411.604
Tasa Fija 3,206.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202130/01/202611.585
Tasa Fija 7,735,747.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202125/09/202411.345
Tasa Fija 784,417.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202106/09/202411.585
Tasa Fija 174,443.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.5859
Tasa Fija 131,025,254.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.5859

Tasa Fija 50,083,979.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202110/03/202511.5825 Tasa Fija 10,982,944.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202131/03/202611.5875 Tasa Fija 4,420,062.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202101/04/202611.5775 Tasa Fija 58,839,849.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa Fija 1,148,489.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa Fija 9,408,630.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202115/04/202511.575 Tasa Fija 612,705.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202105/07/20245.33 Tasa Fija 1,170,296.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202123/04/202611.345 Tasa Fija 7,357,862.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/04/202128/04/202611.59 Tasa Fija 1,177,102.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202115/04/202511.575 Tasa Fija 1,497,725.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202120/05/202611.5775 Tasa Fija 130,501,691.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202130/04/20245.87 Tasa Fija 87,176,498.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202130/04/20266.28 Tasa Fija 6,165,176.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202128/02/202511.9036 Tasa Fija 1,010,917.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202130/04/20266.28 Tasa Fija 5,806,040.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa Fija 98,219,822.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa Fija 107,824,146.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/05/202126/05/20266.14 Tasa Fija 121,457,497.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202115/05/202511.575 Tasa Fija 586,521.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202110/06/202511.5825 Tasa Fija 2,278,000.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/07/202109/07/20267.04 Tasa Fija 2,285,338.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202129/06/202611.5875 Tasa Fija 68,910,732.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.5875 Tasa Fija 256,892,011.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.5875 Tasa Fija 86,592,813.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202129/07/202611.5875 Tasa Fija 8,789,610.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/08/202123/04/202611.345 Tasa Fija 1,064,843.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202114/09/20266.57 Tasa Fija 6,994,675.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202115/07/202611.575

Tasa Fija 222,308,275.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202109/09/202611.5825 Tasa Fija 140,018,555.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202114/09/20267.17 Tasa Fija 3,693,542.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 30,197,066.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 30,197,066.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/11/202129/07/202611.5875 Tasa Fija 9,252,221.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa Fija 913,532.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa Fija 1,408,416.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa Fija 10,203,678.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa Fija 27,419,325.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202225/09/202411.345 Tasa Fija 1,258,794.08

TOTAL 13,066,086,775.39 1,809,633,648.45 3,658,647,484.79 1,821,518,563.40 3,605,958,339.94 99,574,096.19 76,115,556.64 43,881,605.23 53,388,576.46 116,814,067.83 269,111,158.65 99,689,188.63
Total bancarios 13,066,086,775.39 1,809,633,648.45 3,658,647,484.79 1,821,518,563.40 3,605,958,339.94 99,574,096.19 8,391,119,716.79 43,881,605.23 53,388,576.46 116,814,067.83 269,111,158.65 99,689,188.63
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Bursátiles y colocaciones privadas [sinopsis]
Bursátiles listadas en bolsa (quirografarios)
CEBUR94_SCOTIAB_23No18/08/202302/03/202611.49 7,125,499,300.00
CEBUR94_SCOTIAB_24No26/02/202425/02/202711.25 5,189,390,200.00
CEBUR94_SCOTIAB_24-2No26/02/202417/02/20319.74 1,008,708,700.00
CEBUR94_SCOTIAB_24-2No23/02/202417/02/20319.74 3,801,901,100.00
PRLVI_BSCTIA_24152No12/10/202309/04/202411.72994 5,595,091.00
PRLVI_BSCTIA_24152No12/10/202309/04/202411.72994 126,050,291.00
PRLVI_BSCTIA_24172No23/02/202423/04/202411.18001 50,925,001.00
PRLVI_BSCTIA_24172No26/10/202323/04/202411.78005 173,302,908.00
PRLVI_BSCTIA_24181No03/08/202329/04/202411.51005 54,316,269.00
PRLVI_BSCTIA_24182No08/12/202330/04/202411.60002 611,679,046.00
PRLVI_BSCTIA_24192No09/11/202307/05/202411.72994 528,000.00
PRLVI_BSCTIA_24192No09/11/202307/05/202411.72994 299,219,014.00
PRLVI_BSCTIA_24201No19/05/202313/05/202411.61997 77,997,992.00
PRLVI_BSCTIA_24212No23/11/202321/05/202411.60998 3,171,150.00
PRLVI_BSCTIA_24212No23/11/202321/05/202411.60998 167,431,112.00

PRLVI_BSCTIA_24214No23/02/202423/05/202411.29001 51,554,190.00
PRLVI_BSCTIA_24221No31/08/202327/05/202411.57995 54,331,231.00
PRLVI_BSCTIA_24222No30/11/202328/05/202411.61 54,516,365.00
PRLVI_BSCTIA_24232No07/12/202304/06/202411.56 7,392,001.00
PRLVI_BSCTIA_24232No07/12/202304/06/202411.56 106,473,928.00
PRLVI_BSCTIA_24245No18/12/202314/06/202411.56004 105,668,348.00
PRLVI_BSCTIA_24252No21/12/202318/06/202411.58995 21,669,040.00
PRLVI_BSCTIA_24252No21/12/202318/06/202411.58995 175,042,663.00
PRLVI_BSCTIA_24255No23/02/202421/06/202411.34002 51,873,336.00
PRLVI_BSCTIA_24271No06/07/202301/07/202411.46997 46,653,082.00
PRLVI_BSCTIA_24272No04/01/202402/07/202411.52001 1,558,337.00
PRLVI_BSCTIA_24272No04/01/202402/07/202411.52001 103,355,711.00
PRLVI_BSCTIA_24281No12/10/202308/07/202411.75001 54,312,508.00
PRLVI_BSCTIA_24291No20/07/202315/07/202411.36005 29,637,768.00
PRLVI_BSCTIA_24291No16/01/202415/07/202411.55001 528,658,302.00
PRLVI_BSCTIA_24292No18/01/202416/07/202411.43001 72,555,677.00
PRLVI_BSCTIA_24301No26/10/202322/07/202411.82002 54,406,253.00
PRLVI_BSCTIA_24302No25/01/202423/07/202411.45997 11,994,582.00
PRLVI_BSCTIA_24302No25/01/202423/07/202411.45997 116,474,644.00
PRLVI_BSCTIA_24311No03/08/202329/07/202411.44996 55,730,850.00
PRLVI_BSCTIA_24311No30/01/202429/07/202411.42995 83,796,077.00
PRLVI_BSCTIA_24322No08/02/202406/08/202411.52001 29,907,979.00
PRLVI_BSCTIA_24322No08/02/202406/08/202411.52001 163,354,891.00
PRLVI_BSCTIA_24324No13/03/202408/08/202411.34999 313,875,014.00
PRLVI_BSCTIA_24331No13/02/202412/08/202411.46004 137,744,131.00
PRLVI_BSCTIA_24332No15/02/202413/08/202411.45997 3,537,600.00
PRLVI_BSCTIA_24332No15/02/202413/08/202411.45997 49,315,723.00
PRLVI_BSCTIA_24343No23/02/202421/08/202411.49004 62,433,965.00
PRLVI_BSCTIA_24351No31/08/202326/08/202411.54997 55,775,985.00
PRLVI_BSCTIA_24351No30/11/202326/08/202411.56 266,522,972.00
PRLVI_BSCTIA_24352No29/02/202427/08/202411.4 5,807,500.00
PRLVI_BSCTIA_24352No29/02/202427/08/202411.4 64,297,738.00
PRLVI_BSCTIA_24372No14/03/202410/09/202411.35996 143,994,691.00
PRLVI_BSCTIA_24382No21/03/202417/09/202411.31999 22,038,835.00
PRLVI_BSCTIA_24414No12/10/202310/10/202411.8 55,839,164.00
PRLVI_BSCTIA_24434No26/10/202324/10/202411.85001 55,955,424.00
PRLVI_BSCTIA_24472No23/02/202419/11/202411.46003 54,222,480.00
PRLVI_BSCTIA_24475No27/02/202422/11/202411.39996 57,380,230.00
PRLVI_BSCTIA_24515No21/12/202320/12/202411.44997 90,981,604.00
PRLVI_BSCTIA_24522No26/12/202324/12/202411.45006 468,935,725.00
PRLVI_BSCTIA_25075No23/02/202421/02/202511.35006 222,755,007.00
TOTAL 5,682,547,425.00 - 7,125,499,300.00 5,189,390,200.00 - 4,810,609,800.00
- - - - - -
Bursátiles listadas en bolsa (con garantía)

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Colocaciones privadas (quirografarios)
CEDESF_BSCTIA_23012No14/04/202315/04/202411.17 3,000,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23013No19/04/202318/04/202411.12 3,000,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23015No31/05/202329/05/202411.23 500,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23016No31/05/202315/05/202411.4775 2,000,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23017No30/08/202309/05/202411.47 1,500,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23018No31/08/202309/05/202411.47 500,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23019No24/11/202311/11/202411.4775 2,000,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23020No29/11/202331/10/202411.48 2,000,000,000.00

CEDESF_BSCTIA_23021No30/11/202331/10/202411.48 600,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23022No30/11/202331/10/202411.48 1,500,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23025No14/12/202315/11/202411.4859 1,000,000,000.00
CEDESF_BSCTIA_23026No15/12/202302/12/202411.4825 2,000,000,000.00
Obligaciones SubordinadasQ_SCOTIAS_14No18/12/201405/12/20247.4 2,093,000,000.00 -
Obligaciones SubordinadasQ_SCOTIAS_18No28/06/201809/06/203312.3 3,360,000,000.00
Obligaciones SubordinadasQ_SCOTIAS_18-2No11/09/2018PERPETUO11.32 3,455,000,000.00
TOTAL 21,693,000,000.00 - - - - 6,815,000,000.00 - - - - - -
Colocaciones privadas (con garantía)

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total bursátiles listados en bolsa y colocaciones privadas 27,375,547,425.00 - 7,125,499,300.00 5,189,390,200.00 - 11,625,609,800.00 - - - - - -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo [sinopsis]
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total otros pasivos circulantes y no circulantes con costo - - - - - - - - - - -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Proveedores [sinopsis]
Proveedores

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total proveedores - - - - - - - - - - - -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo [sinopsis]
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo - - - - - - - - - - - -
Total de créditos40,441,634,200.391,809,633,648.4510,784,146,784.797,010,908,763.40
3,605,958,339.9411,725,183,896.198,391,119,716.7943,881,605.2353,388,576.46
116,814,067.83269,111,158.6599,689,188.63

Comentarios:
El tipo de cambio tomado al cierre de marzo es de 16.5625

“ver archivo completo en pdf”

Instrumentos
Financieros Derivados

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA
A)DISCUSIÓN SOBRE LAS POLÍTICAS DE USO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
La Dirección General del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (GFSBI), al cual pertenece Scotiabank Inverlat (SBI) y un comité designado por el Consejo de Administración revisan por lo menos con periodicidad semestral y cada vez que las condiciones del mercado lo ameritan, los objetivos, metas y procedimientos de operación y control, así como los niveles de tolerancia de riesgo.
Para tales efectos, la Dirección General se apoya en las áreas u órganos apropiados (Consejo de Administración, Comité de Riesgos) para llevar a cabo las actividades específicas en los requerimientos de administración que marca la Circular 4/2012 emitida por Banco de México.
Las diferentes áreas responsables de la operación y supervisión del mercado definen los objetivos, metas y procedimientos particulares, de operación y control, así como las tolerancias máximas de riesgo aceptables por área, mismos que deberán ser congruentes con los lineamientos generales establecidos por la Dirección General.
Los productos derivados son importantes herramientas de gestión de riesgo tanto para el Banco como para sus clientes.
El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo con las políticas establecidas.
Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:
1)Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo-rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo

con su perfil de riesgo.
2)Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.
3)Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
4)Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.
Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:
1)Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.
2)Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.
3)Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.
La Institución cuenta con Políticas y manuales, que se enlistan a continuación, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y administración de derivados; entre estas políticas se destaca la de Gestión del Riesgos de Nuevas Iniciativas que involucra la participación de diversas áreas de la Institución, a fin de garantizar que no se incurran en riesgos operativos, legales o reputacionales.
1)Manual de Operación de Derivados.
2)Política de Administracion de Riesgo de Mercado y Estructural.
3)Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).
4)Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas
5)Política de Riesgo de Contraparte
6)Política de Sobregiros
Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al riesgo de tasas de interés y al riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados.
SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 “Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura”, en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las operaciones de cobertura.
Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles movimientos de las tasas de interés y de tipo de cambio. Las condiciones de mercado bajo las cuales se realizan coberturas son las siguientes:
Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de MercadoDerivado
1.Flujos de Efectivo Pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija PasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
2.Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir 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 flotanteActivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
4.Valor RazonableCartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o ExtranjeraActivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
5.Flujos de EfectivoCertificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
6.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
7.Flujos de EfectivoReportosPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de MercadoDerivado
8.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjeraActiva Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXNCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional
9.Flujo de EfectivoBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesosCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

En lo que respecta a los productos de negociación aprobados Casa se encuentran:
SubyacenteFuturosOpcionesSwaps
MRMRMRMEMRME
Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.
Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.
Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas
Operaciones de Opción sobre futuros de índice.
Moneda nacional, Divisas y UDIS;
Oro y Plata
Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.
1).Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (CurrencySwaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (ForwardStarting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.
2).(MR) Mercados reconocidos
3).(ME) Mercados extrabursátiles
Las operaciones de derivados de cobertura se incluirán dentro del cálculo de

medidas de sensibilidad (i.e. Valor Económico y Sensibilidad del Margen). En adición, se monitorearán bajo los límites establecidos para ALM previamente aprobados por el Comité de Riesgos.
El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.
Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algortihmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.
Con esta metodología se generan 300 escenarios a partir de las observaciones históricas y los principales supuestos del modelo son:
•El modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo
•El modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.
•El modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados).
•El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.
Debido a que la medida de VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución realiza diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.
Adicionalmente se realizan pruebas de backtest donde se compara el P&L (teórico y real) diario vs VaR de 1 día. Este análisis es realizado mensualmente y es presentado al Comité de Riesgos del Consejo de Administración al menos trimestralmente.
Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles. Scotiabank Inverlat administra su exposición al riesgo de liquidez conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado.
Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:
•Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.
•Eliminar la necesidad de obtener fondos a tasas por arriba de las de mercado o a través de ventas forzadas de activos.
•Satisfacer los límites y requerimientos de liquidez exigidas por las autoridades.
•Establecer e implementar políticas de liquidez prudentes.
•Desarrollar e implementar técnicas y procedimientos efectivos para monitorear, medir y controlar los requerimientos de liquidez.
Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:
•Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo.
•Diversificar fuentes de fondeo.
•Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes activos líquidos para hacer frente a eventos inesperados.
•Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de marzo 2024 y en promedio para el primer trimestre de 2024 es de:

Scotiabank–

Brechas de liquidez acumuladas
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)43,17868,788
Liquidity Buffer134,322127,518

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

INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

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

INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
Cross Currency Interest Rate Swap(All Interest Rate)MXN,CAD,USD,
EUR,JPY,GBP SwapInterest Rate CurveVALMER
FX RateVALMER
Interest Rate Swap(All Interest Rate)MXN,CAD,USD,
EUR,JPY,GBP SwapInterest Rate CurveVALMER
Interest Rate Cap/Floor(All Interest Rate)MXN,USD Cap/Floor Black'sInterest Rate CurveVALMER
SurfaceBloomberg/Reuters
OTC Binary Interest rate Option(All Interest Rate)MXN,USD Cap/Floor Black's
Interest Rate CurveVALMER
SurfaceBloomberg/Reuters
IRS FuturesTIIE FondeoMXNPricePriceVALMER
Listed Interest Rate Swap (CME)TIIE FondeoMXN SwapInterest Rate CurveVALMER
OTC European Index Call Spread OptionOTC European Index Call Spread Option
MXN,CAD,USD,
EUR,JPY Call Spread OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
OTC European Basket OptionEquity Index, Common StockMXN,CAD,USD,
EUR,JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-FactorCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
OTC European Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETF and Bond Index whith Target Volatility (Vol Under 15%)MXN,CAD,USD,
EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
OTC Index Binary Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETFMXN,CAD,USD,

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader's mark
Correlation
Dividend

ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,
EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader's mark
Correlation
Dividend
Bond Futures(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER
Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVALMER
Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER
Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVALMER
FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,
MXN,PEN,AUD,EUR,
JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVALMER
OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER
FX Rate
Surface
Precious Metals European OptionGold/Silver BullionGold/Silver Black 76CurveVALMER
Price
SurfaceBloomberg/Reuters
Precious Metals ForwardGold/Silver BullionGold/Silver Forward OTC ModelCurveVALMER
Price
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,
BRL,CLP,COP,PEN,
AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO
ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,
EUR,JPY PricePriceVALMER

POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO
Se informa a esa H. Comisión que en el Manual de Políticas de Crédito Cartera Comercial, en su "Manual de Productos y Programas Especiales de Crédito Cartera Comercial, Apartado III Mercado Financiero, 1.1 Operaciones del Banco en el Mercado Financiero" se norman las operaciones del Banco en el Mercado Financiero estableciendo:
TIPOS DE OPERACIÓN QUE SON OFRECIDOS EN FUNCIÓN AL TIPO DE ACREDITADO
a) Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:
•Necesidades de tesorería del Banco
•Relación de corresponsalía
•Límites recíprocos
b) Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:
•Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.
c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:
•Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.
PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO
1) Tesorería: Call Money
2) Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores
3) Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles
4) Cambios: FOREX
5) Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)
6) Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos
7) Metales
SUJETOS DE CRÉDITO
Podrán ser sujetos de crédito en productos de este mercado, los siguientes:
•Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
•Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.
•Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)
•Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público
REGLAS PARTICULARES
Metodología utilizada para el consumo de Líneas:
•La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure".
•La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar.
•Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.
•La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.
IDONEIDAD DEL CLIENTE
La celebración de operaciones de productos de Mercado Financiero implica la necesidad de que el Banco cuente con elementos razonables que le garanticen, que:
•El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar
•Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.
Para tales efectos, en toda Solicitud de línea para este tipo de productos, se deben aplicar las reglas de la Política de Idoneidad del Grupo Scotiabank, que establece los procesos a seguir para la clasificación del riesgo de idoneidad, basado en la complejidad de las operaciones y en el conocimiento/ experiencia que

el cliente tenga al respecto. Asimismo, en cada revisión anual se debe evaluar si la clasificación de riesgo de idoneidad del cliente es la misma o ha cambiado desde la última revisión.

POLÍTICAS DE VAR

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

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

B)DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN

MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:

CÁLCULO DE SENSIBILIDADES

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

Los cálculos de sensibilidad se realizan diariamente en forma automática, con procedimientos desarrollados por la Dirección de TFRM.

PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)

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

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

BONOS DE TASA FLOTANTE

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

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

BONOS CUPÓN CERO

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

RIESGO DE CRÉDITO

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

SENSIBILIDAD DEL PASIVO

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

DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS
SWAPS DE TASA DE INTERÉS
Para efectos de determinar la sensibilidad a cambios en la curva de rendimiento de los Swaps de TIIE, se efectúa un cambio de 1 punto base en cada uno de los puntos relevantes de la curva de rendimientos, además de un cambio de 1 y cien puntos base de forma paralela, valuando el portafolio con las diferentes curvas y calculando cual es el cambio en el valor del portafolio con cada uno de esos cambios.
En el caso de Swaps sobre otro tipo de tasas de interés, lo cual puede incluir CETES y/o Libor, los cálculos se realizan directamente haciendo un shock de 1 y 100 puntos base sobre la curva cupón cero. Todas las transacciones realizadas sobre subyacentes distintos de TIIE están autorizados sólo en una base back to back
FUTUROS DE TIIE
Se considera la duración para estimar su sensibilidad.
FUTUROS DE BONO M
Para el cálculo de sensibilidad de estos derivados a la tasa de interés, se utilizan los conceptos de duración y convexidad.
FUTUROS DE CETE
El tratamiento de futuros de Cete es análogo al tratamiento de futuros de TIIE.
EFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:
Se realizan pruebas y análisis, al inicio de cada operación de cobertura y de manera continua, con base en la comparación de los cambios pasados en el valor razonable o en los flujos de efectivo del instrumento de cobertura con los cambios que hayan experimentado en el pasado el valor razonable o los flujos de efectivo de la posición primaria.
Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios mensuales históricos, es decir una ventana de observación de cinco años con base en un análisis de regresión.
Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos).
Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:
Grado de relación entre los cambios observados: $R2 \geq 80\%$.
Pendiente de la regresión entre [-1.25 y -0.80].
Significancia de la regresión: $F > 5$.
Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2024 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas. Durante el primer trimestre de 2024 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por inefectividad.
La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.
COBERTURA DE FLUJOS DE EFECTIVO:
La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se

reconocen dentro de "Otro Resultado Integral" (ORI) y cualquier ganancia o pérdida remanente debe tratarse como inefectividad de cobertura y reconocerse de inmediato en la utilidad o pérdida neta.
El componente que forma parte de "Otro Resultado Integral" asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre: la ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.
COBERTURA DE VALOR RAZONABLE:
La ganancia o pérdida que resulte de valuar el instrumento de cobertura a su valor razonable es reconocida de forma inmediata en los resultados del período en que ocurre.
La ganancia o pérdida que resulte de valuar la posición cubierta atribuible al riesgo cubierto debe ajustar el valor en libros de dicha posición y se reconoce inmediatamente en los resultados del período en que ocurre.
En adición, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base en los sistemas especializados internos.
C)INFORMACIÓN DE RIESGOS POR EL USO DE DERIVADOS
Scotiabank Inverlat asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que el Banco pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles, para lo cual el Banco aplica controles a las brechas de liquidez, monitorea indicadores clave de liquidez, mantiene fuentes diversificadas de fondeo, establece límites y mantiene un porcentaje mínimo de activos líquidos.
Las exposiciones al riesgo de liquidez son cubiertos desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.
Al cierre de marzo de 2024 y promedio del primer trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:
Scotiabank–
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Liquidity Buffer134,322127,518

Se realizó un análisis de sensibilidad para las operaciones con instrumentos financieros derivados mismo que refleja requerimientos adicionales que pudieran suscitarse por eventualidades en el mercado, lo anterior podría verse reflejado en una pérdida potencial o en salidas de efectivo adicionales para Scotiabank Inverlat.
Para estos efectos el cálculo de la exposición potencial para derivados considera lo siguiente:
Considerando 3 escenarios (probable, posible y de estrés), Scotiabank Inverlat podría tener salidas de efectivo adicionales por posible baja en su calificación crediticia, dado que el colateral entregado sería mayor. Esto en conexión con instrumentos financieros derivados OTC que tengan asociados contratos marco.
La salida/pérdida potencial para los 3 escenarios dada la baja de 3 escalafones en la calificación crediticia del GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat, está dada por:
Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:
ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market
En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.
Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:
Scotiabank
(millones de pesos)NormalEscenario
PosibleEscenario
ProbableEscenario
Estrés
Gap 30d Gap Acum43,17839,24239,19239,144
Cambios en el Gap respecto al escenario normal(3,936)(3,986)(4,034)

D)ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD Y CAMBIOS EN EL VALOR RAZONABLE.
Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.
El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.
DELTA
La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.
Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.
Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes.
Exposición Delta: Se define como el monto nocional equivalente del subyacente (en cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.

GAMMA
El riesgo gamma es complementario al riesgo delta, y es otra medida de sensibilidad del valor de una opción con respecto al valor de un subyacente. Gamma mide la tasa de cambio de la delta ante un cambio en el nivel del subyacente, y análogo al cálculo de delta, puede ser interpretada de manera analítica, como la segunda derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto el subyacente.
Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos de medición de riesgos no se realizan de manera analítica, sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo gamma, denominadas gamma1 y gamma5.-
Gamma1 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que gamma5 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio ante un cambio de 5% en el valor del subyacente. Ambas mediciones cuentan con límites de riesgos.
VEGA
Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente.
Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.
Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.
RHO
Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portafolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).
RHO es entonces definida como el cambio en el valor de un portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.
THETA
Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio ante el paso del tiempo. Analíticamente, Theta puede ser expresado como la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al tiempo.
Theta es calculada mediante el procedimiento de valuación completa (tal como es el caso de las otras griegas) en lugar de analíticamente, sólo con fines informativos y de atribución de P&L.
DIVIDEND RISK
La valoración de opciones sobre índices o acciones supone una tasa de dividendos compuesta continua conocida. Los dividendos, sin embargo, son una estimación y por tanto una variable desconocida, representando un factor de riesgos para la valuación y el consiguiente P&L de las operaciones con opciones.

II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA
Cifras expresadas en pesos
A)ANÁLISIS DE SENSIBILIDADES DEL PORTAFOLIO DE OPERACIONES DERIVADAS DE TASA.
Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a marzo 27, 2024:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	471,137.00	(129,463.00)	259,339.00	(82,166.00)	(102,568.00)	(28,900.00)	387,379.00
CCS	(12.00)	(55.00)	(140.00)	75.00	176.00	28.00	72.00
Caps&Floors	(230.00)	3,826.00	60.00	21.00	--		3,677.00
Binary Caps&Floors							-
TIIE Futures							-

Mbonds Futures-------
Total DERIVATIVES470,895.00(125,692.00)259,259.00(82,070.00)(102,392.00)
(28,872.00)391,128.00

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD
SUPUESTOS DE CÁLCULO.
Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, Bonos M, Cap&Floor el método para calcular la sensibilidades es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.
Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.
Los impactos en los estados de resultados son:
a)Bajo el escenario probable una pérdida de (176.24) Millones de pesos.
b)Con escenario poco probable un P&L de (352.49) Millones de pesos.
c)Y finalmente con el escenario muy poco probable (861.66) Millones de pesos.
Los escenarios de stress están basados en el movimiento al alza que pudieran tener las tasas de interés, en el escenario probalble de 50 pb, en el escenario poco probalble de 100 pb y en el escenario muy poco probable 200pb. Los escenarios se muestran a continuación.
Tipo SensibilidadInstrumentoSensibilidadMTMProbable
Shock
(+/-)P&LStress 1
Shock
(+/-)P&LStress 2
Shock
(+/-)P&L
- 1pb a la tasaFuturos de TIIE y Bono M--50.00-100.00-200.00-
- 1pb a la tasaIRS & CCS & Delta Caps0.39(90.56)50.00(19.56)100.00(39.11)200.00
(78.23)
Volatilidad al 1%Caps &Floors(0.02)(0.46)0.10(0.00)0.40(0.01)1.00(0.02)
a FX %Forwards87.161,566.830.10(156.68)0.20(313.37)0.50(783.42)
a FX %Opciones Divisa--0.10-0.20-0.50-
Total (176.24) (352.49) (861.67)

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 27 de marzo de 2024 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).
OpcionesDeltaVegaGamma
Options AAPL.OQ---
Options AMZN.OQ---
Options BNPUI5.INDX251,607.006,261.0067,064.00
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options GOOG.OQ---
Options IDBTV1.INDX---
Options META.OQ---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---

Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total251,607.006,261.0067,064.00

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 AAPL.OQ---
Options AMZN.OQ---
Options BNPUI5.INDX(25,160.70)(75,482.10)(125,803.50)
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options GOOG.OQ---
Options IDBTV1.INDX---
Options META.OQ---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total(25,160.70)(75,482.10)(125,803.50)

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:
Escenarios al alza0.050.150.2
Options AAPL.OQ---
Options AMZN.OQ---
Options BNPUI5.INDX12,580.3537,741.0550,321.40
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options GOOG.OQ---
Options IDBTV1.INDX---
Options META.OQ---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total12,580.3537,741.0550,321.40

Y están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5%, 15% y 20% de escenarios al alza.
Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:
EscenarioMonto
Probable(25,160.70)
Poco Probable(75,482.10)
Muy poco Probable(125,803.50)

DESCRIBIR Y NUMERAR LAS LLAMADAS DE MARGEN QUE SE HAYAN PRESENTADO DURANTE EL TRIMESTRE
Respecto a las llamadas de margen, al 27 de marzo de 2024 se tienen los siguientes saldos:
ContraparteColateral Recibido MXNColateral Enviado MXNColateral Recibido USD
Colateral Enviado USD
CLIENTE 1--1,285,000(2,035,000)
CLIENTE 2167,000,000(186,000,000)--
CLIENTE 3---(5,125,000)
CLIENTE 4--20,620,000(265,000)
CLIENTE 53,000,000(16,600,000)--
CLIENTE 6148,300,418(163,100,000)25,325,000(20,575,000)
CLIENTE 7--18,220,000(13,340,000)
CLIENTE 8--57,580,000(25,640,000)
CLIENTE 9--205,300,000(142,100,000)
CLIENTE 10--1,550,000-
SUBTOTAL318,300,418(365,700,000)329,880,000(209,080,000)

ContraparteColateral Recibido MXNColateral Enviado MXNColateral Recibido USD
Colateral Enviado USD
CLIENTE 11--15,200,000(3,360,000)
CLIENTE 12--33,120,000(14,330,000)
CLIENTE 13--530,000-
CLIENTE 145,600,000(61,300,000)--
CLIENTE 15202,200,000(246,600,000)--
CLIENTE 16300,000---
CLIENTE 17566,100,000(252,400,000)94,840,000(72,300,000)
CLIENTE 181,049,349,143(249,207,953)--
CLIENTE 192,200,000---
CLIENTE 20--6,280,000(490,000)
CLIENTE 21--1,050,000-
CLIENTE 22--3,670,000-
CLIENTE 23--12,970,000(11,160,000)
CLIENTE 242,144,049,560(1,175,207,953)497,540,000(310,720,000)
TOTAL4,288,099,121(2,350,415,906)995,080,000(621,440,000)

REVELACIÓN DE CUALQUIER INCUMPLIMIENTO QUE SE HAYA PRESENTADO A LOS CONTRATOS RESPECTIVOS
ProductoFechaClienteDivisaMontoMotivo del incumplimiento
Interest Rate Swap02/01/2024Cliente 1USD23,943No envió los fondos
Opcion fx09/01/2023Cliente 2MXN82,007No confirmaron la operación
Opcion eq11/01/2024Cliente 3MXN10,026,500No envió los fondos
Interest Rate Swap15/01/2024Cliente 4MXN811Problemas SPEI
Interest Rate Swap29/01/2024Cliente 5MXN(844,184)Retención Pago
Interest Rate Swap29/01/2024Cliente 6MXN(1,254,771)Retención Pago
Interest Rate Swap30/01/2024Cliente 7USD93,000No confirmaron la operación

FORWARD01/02/2024Cliente 8USD500,000Problemas con Banca
FORWARD13/02/2024Cliente 9MXN57,654,300Problemas envío de pago
Interest Rate Swap19/02/2024Cliente 10MXN168,986No envió los fondos
Interest Rate Swap28/02/2024Cliente 11MXN(784,229)Retención Pago
Interest Rate Swap29/02/2024Cliente 12MXN(1,243,268)Retención Pago
Opcion fx04/03/2024Cliente 13MXN19,400Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 14USD47,550Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 15USD17,451Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 16USD17,451Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 17USD9,881Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 18USD9,678Problemas sistemas
Interest Rate Swap04/03/2024Cliente 19USD3,283Problemas sistemas
FORWARD15/03/2024Cliente 20MXN9,528Solo hizo pago parcial
Opcion fx15/03/2024Cliente 21MXN281,775No envió los fondos
FORWARD19/03/2024Cliente 22MXN138,470Problemas Instrucciones
FORWARD19/03/2024Cliente 23MXN139,192Problemas Instrucciones
FORWARD19/03/2024Cliente 24MXN169,182Problemas Instrucciones
FORWARD22/03/2024Cliente 25MXN163,929Problemas Instrucciones
FORWARD25/03/2024Cliente 26MXN139,726Problemas Instrucciones
FORWARD25/03/2024Cliente 27MXN140,570Problemas Instrucciones
FORWARD25/03/2024Cliente 28MXN133,100Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 29USD(7,976)Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 30USD(8,139)Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 31USD(8,181)Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 32USD(8,278)Problemas Instrucciones
FORWARD21/03/2024Cliente 33USD(9,944)Problemas Instrucciones
FORWARD26/03/2024Cliente 34USD(7,990)Problemas Instrucciones
Opcion fx26/03/2024Cliente 35USD200,000Discrepancia en la liquidación
FORWARD27/03/2024Cliente 36MXN(7,681)Problemas Instrucciones
FORWARD27/03/2024Cliente 37MXN1,789,800No envió los fondos
Interest Rate Swap27/03/2024Cliente 38USD36Discrepancia en la liquidación
DESCRIBIR Y NUMERAR LOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS QUE HAYAN VENCIDO DURANTE EL TRIMESTRE
Cifras expresadas en pesos

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
Cifras expresadas en pesos

"ver archivo completo en pdf"