



Anexo 3
Scotiabank
Inverlat

	T1 2022
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	20.0%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	2.1%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	4.7%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.7%
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	3.7%
Índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)	96.4%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	19.86%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	16.49%
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	42.0%

* Sujeto a aprobación del Banco Central.

	31 mar 2022
Ingresos por intereses	12,030
Gastos por intereses	(6,045)
Margen Financiero	5,985
Comisiones	1,002
Resultado por Intermediación	379
OI OE	135
Ingresos no Financieros	1,516
Total Ingresos	7,501
Gastos de Administración y Promoción	(4,474)
PTPP	3,027
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	1,430
Resultado de la Operación	4,457
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	-
Resultado antes de Impuestos a la Utilidad	4,457
Impuestos a la Utilidad	(1,008)
Resultado Neto	3,449

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

En el primer trimestre de 2022, la utilidad neta consolidada de Grupo Financiero Scotiabank Inverlat S.A. de C.V. (Grupo Financiero Scotiabank), se ubicó en \$3,449 millones, la cual se debe principalmente a ingresos por margen financiero, ingresos no financieros y menores requerimientos de reservas en cartera comercial; compensados por gastos de administración y promoción e impuestos a la utilidad.

Ingresos no Financieros

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022
Actividades Fiduciarias	65
Apertura de Cuenta	4
Cartas de Crédito sin Refinanciamiento	57
Cheques Certificados	1
Manejo de Cuenta	83
Operaciones de Crédito	391
Otras Comisiones y Tarifas	330
Servicios de Banca Electrónica	44
Transferencia de Fondos	27
Total de Comisiones y Tarifas (netas)	1,002

Scotiabank -Otros Ingresos/Egresos de la Operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	(14)
Aportaciones al IPAB	(502)
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	83
Estimación por Pérdida de Valor de Bienes Adjudicados	(4)
Ingresos por Arrendamiento	72
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a Funcionarios y Empleados	29
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	851
Quebrantos	(405)
Recuperaciones	3
Resultado en Venta de Bienes Adjudicados	22
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación	135

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022
Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	1,430

En el primer trimestre de 2022, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$1,430 millones, integrada principalmente por menores requerimientos en la cartera comercial.

Gastos de Administración y Promoción

Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022
Gastos de Personal	(2,402)
Gastos de Operación	(2,072)
Total de Gastos de Administración y Promoción	(4,474)

Impuestos a la Utilidad

Scotiabank-Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022
Impuesto a la Utilidad Causado	(622)
Impuesto a la Utilidad Diferido	(386)
Total de Impuestos a la Utilidad	(1,008)

En el primer trimestre de 2022, se registró un impuesto neto a cargo por \$1,004 millones lo que representa una tasa efectiva del periodo de 22.6%.

Balance General

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	183,564
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	426,349
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	16,180
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,599)
Otros Activos	42,974
Total Activo	653,468
Depósitos	429,019
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	41,936
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,096
Otros Pasivos	102,826
Capital	70,591
Total Pasivo y Capital	653,468

Al 31 de marzo de 2022, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$653,468 millones, se integran principalmente por la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1 y 2 de comercial y vivienda, inversiones en instrumentos financieros por cobrar y vender, negociables, efectivo y equivalentes de efectivo e instrumentos financieros derivados con fines de negociación.

El total del pasivo ascendió a \$582,877 millones al 31 de marzo de 2022, integrado principalmente por depósitos de clientes y títulos de crédito emitidos, préstamos bancarios y de otros organismos, otros pasivos (acreedores por reportos, instrumentos financieros derivados con fines de negociación, acreedores por liquidación de operaciones y pasivos por beneficios a los empleados) y obligaciones subordinadas en circulación.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	34,150
Créditos a la Vivienda	169,766
Total Préstamos de Menudeo	203,916
Actividad Empresarial o Comercial	185,275
Entidades Financieras	17,720
Entidades Gubernamentales	19,438
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	222,433
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	426,349

El total de préstamos comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de marzo de 2022, se ubicaron en \$222,433 millones, integrados por créditos de actividad empresarial o comerciales, seguido de entidades gubernamentales y financieras.

El total de préstamos de menudeo al 31 de marzo de 2022, se ubicaron en \$203,916 millones, integrados por créditos de vivienda, seguido de tarjeta de crédito y otros préstamos personales.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	16,180
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,599)
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta	581
Índice de morosidad	3.7%

Al 31 de marzo de 2022 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 se ubicó en \$16,180 millones y la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$15,599 millones. El índice de morosidad fue de 3.7%.

Depósitos

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022
Total Depósitos Vista y Ahorro	216,843
Público en General	187,317
Mercado de Dinero	2,302
Total Depósitos a Plazo	189,619
Títulos de Crédito Emitidos	21,676
Cuenta global de captación sin movimientos	881
Total de Depósitos	429,019

Al 31 de marzo de 2022, el total de depósitos se ubica en \$429,019 millones, integrados principalmente por depósitos de vista y ahorro y público en general.

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

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I-BANSAN-22165	11,959,235,527	6.40%	28	11,911

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

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Instrumentos financieros negociables	49,875	1,078	23	-	50,976
Sin restricción:	4,301	100	23	-	4,424
Restringidos:	45,574	978	-	-	46,552
<i>En operaciones de reporto</i>	39,357	978	-	-	40,335
<i>Préstamos de valores</i>	131	-	-	-	131
<i>Otros</i>	6,086	-	-	-	6,086
Instrumentos financieros para cobrar o vender	38,458	17,064	-	1,250	56,772
Sin restricción:	38,276	17,064	-	1,250	56,590
Restringidos:	182	-	-	-	182
<i>En operaciones de reporto</i>	-	-	-	-	-
<i>Otros</i>	182	-	-	-	182
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	5,167	-	-	-	5,167
Sin restricción	5,167	-	-	-	5,167
Total	93,500	18,142	23	1,250	112,915

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados
(millones de pesos al 31 de marzo de 2022; valor razonable)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total pasivo
	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva		
Negociación	3,011	2,800	-	-	1,079	741	465	593	19,550	19,743	-	-	24,105	23,877
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	5,968	3,956	-	-	5,968	3,956

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

	Contratos adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de instrumentos Derivados	
	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva
Con fines de negociación												
Posición USD	3,299	3,485	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	5	6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	-	-	369	369	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	96	96	-	-	-	-
Acciones												
MXN	-	-	-	-	685	456	558	328	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	-	3,355	3,355	-	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	25,965	25,557	305,697	309,448	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	318	317	1,312	1,658	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	23	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
Con fines de cobertura												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	43,031	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	453	5	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	4	-	-	-

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

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	147,712	36,907	184,619
Créditos a entidades financieras	17,702	18	17,720
Créditos a entidades gubernamentales	19,308	-	19,308
Créditos al consumo	33,600	-	33,600
Créditos a la vivienda	167,512	21	167,533
Total	385,834	36,946	422,780

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

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	344	312	656
Créditos a entidades gubernamentales	130	-	130
Créditos al consumo	550	-	550
Créditos a la vivienda	2,233	-	2,233
Total	3,257	312	3,569

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

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	6,287	1,466	7,753
Créditos a entidades financieras	47	-	47
Créditos al consumo	1,035	-	1,035
Créditos a la vivienda	7,304	41	7,345
Total	14,673	1,507	16,180

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

Saldo al 31 de diciembre de 2021	16,943
Liquidaciones	(85)
Castigos y quitas	(539)
Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	(91)
Fluctuación de tipo de cambio	(48)
Saldo al 31 de marzo de 2022	16,180

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

Saldo al 31 de diciembre de 2021	16,702
Más: Creación de reservas	2
Calificación	(1,335)
Menos: Liberaciones	-
Cancelaciones	-
Adjudicaciones y otros	8
Castigos y quitas	539
Comercial	36
Hipotecario	40
Consumo	463
Efecto inicial metodología	(821)
Desliz cambiario	44
Saldo al 31 de marzo de 2022	15,599

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

	31 mar 2022
Cartera Vigente	
Metropolitano	56.1%
Noroeste – Centro	12.1%
Norte	15.7%
Bajío	9.7%
Sur	6.4%
Cartera Vencida	
Metropolitano	40.5%
Noroeste – Centro	18.0%
Norte	8.1%
Bajío	17.0%
Sur	16.3%

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

No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
1	15,465	25.61%
2	8,688	14.39%
3	6,673	11.05%
4	6,627	10.97%
Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos		30,826

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia
Al 31 de marzo de 2022
(millones de pesos)

	Importe Cartera Crediticia	Cartera Comercial	Reservas Preventivas Necesarias			Total Reservas Preventivas
			No Revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes	Cartera de Vivienda	
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	390,508	990	99	584	272	1,945
Riesgo A2	31,958	289	26	179	12	506
Riesgo B1	8,925	105	44	58	12	219
Riesgo B2	6,590	11	50	37	57	155
Riesgo B3	6,953	104	14	41	54	213
Riesgo C1	4,524	129	23	75	54	281
Riesgo C2	3,212	15	25	140	209	389
Riesgo D	5,572	266	43	344	992	1,645
Riesgo E	11,563	5,824	797	316	1,388	8,325
Total	469,805	7,733	1,121	1,774	3,050	13,678
Exceso						1,921
Reservas Constituidas						15,599

NOTAS:

- Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas, son las correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 31 de marzo de 2022.
- La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, pudiendo calificarse por metodologías internas autorizadas por la Comisión.

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$ -
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	27
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos	27
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	<u>1,867</u>
Total	\$ 1,921

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 2022 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses” son:

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes especiales
(millones de pesos)

	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 220707	3,961,831	540	07-jul-22
B4 220804	21,792	3	04-ago-22
B4 270701	11,209,686	1,528	01-jul-27
BC 220804	3,115	-	04-ago-22
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	15,196,430	2,071	

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

	Tasa Promedio		
	Pesos	Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	2.66%	0.08%	-
Depósitos a plazo	5.32%	0.00%	-

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

Vencimiento	Préstamos			Financiamiento Fondos de Fomento	Otros Organismos	Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo			
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	1,264	7,399	3,444	-	12,107
Largo	-	-	16,000	6,487	-	22,487
Total	-	1,264	23,399	9,931	-	34,594
Tasa Promedio	0.00%	5.45%	7.61%	6.29%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	23	280	4	307
Largo	4,977	-	-	69	1,989	7,035
Total	4,977	-	23	349	1,993	7,342
Tasa Promedio	0.31%	0.00%	2.01%	0.92%	1.03%	
Total Préstamos Interbancarios	4,977	1,264	23,422	10,280	1,993	41,936

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 2022.

Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	31 mar 2022
Depósitos a la Vista	53.4%
Metropolitano	21.8%
Noroeste – Centro	11.4%
Norte	8.3%
Bajío	6.1%
Sur	5.8%
Depósitos Ventanilla	46.0%
Metropolitano	18.7%
Noroeste - Centro	6.9%
Norte	9.2%
Bajío	5.6%
Sur	5.6%
Total de Captación del Público	99.0%
Fondeo Profesional	0.6%

Scotiabank-Impuestos y PTU Diferidos
(millones de pesos al 31 de marzo de 2022)

Perdida de arrastre fiscal	8
Provisión por perdidas de crédito	4,410
Compensación diferida	(1,150)
Ingresos diferidos	566
Instalaciones y equipos / depreciación	286
Beneficios a los empleados	543
Provisiones	1,360
Otros	(408)
Efecto Neto en Diferido	5,615

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

Scotiabank-Resultados por Intermediación
(millones de pesos)

Scotiabank-Resultados por Intermediación (millones de pesos)	31 mar 2022
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(306)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(9)
Resultado por valuación de divisas	(274)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	554
Resultado por compraventa de divisas	415
Costos de transacción	(1)
Total	379

Emisión de Certificados Bursátiles

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

Clave de Pizarra	Quinta*	Primera***	Segunda***	Primera***	Segunda***	Tercera
	SCOTIAB 13-2	SCOTIAB 19	SCOTIAB 19D	SCOTIAB 19 (reapertura) ¹	SCOTIAB 19D (reapertura) ¹	SCOTIAB 19-2
Monto de la Emisión	\$1,150 millones	\$3,653 millones	\$123 millones dólares	\$2,352 millones	\$112 millones dólares	\$6,000 millones
Fecha de Emisión y Colocación	28 junio 2013	27 mayo 2019	28 mayo 2019	29 julio 2019	29 julio 2019	6 diciembre 2019
Plazo de Vigencia de la Emisión	3,640 días, 20 periodos 182 días, aprox. 10 años	1,263 días, aprox. 3.5 años	1,260 días, aprox. 3.5 años	1,200 días, aprox. 3.3 años	1,198 días, aprox. 3.3 años	1,207 días, aprox. 3.3 años
Garantía	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria
Tasa de interés	7.30% Fijo	TIIE 28 + 0.18%	LIBOR 3 MESES + 0.57%	TIIE 28 + 0.18%	LIBOR 3 MESES + 0.57%	TIIE 28 + 0.15%
Pago de Intereses	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días	Cada 90 días	Cada 28 días	Cada 90 días	Cada 28 días
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento en dólares	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento en dólares	Un sólo pago al vencimiento

* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

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

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

Emisión de Obligaciones Subordinadas

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

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
BONO SCOTIAB 13-19	658,200	22-nov-19	22-nov-22	1,096	MSFDVTHY INDEX	65,820,000
BONO SCOTIAB 05-20	1,930,500	19-feb-20	17-feb-23	1,094	MSFDVTIG IDEX	193,050,000
BONO SCOTIAB 06-20	6,471,910	27-mar-20	27-mar-23	1,095	MSFDVTIG IDEX	647,191,000
BONO SCOTIAB 07-20	7,895,100	14-may-20	12-may-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	789,510,000
BONO SCOTIAB 08-20	415,850	11-jun-20	09-jun-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	41,585,000
BONO SCOTIAB 01-21	238,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	23,884,500
BONO SCOTIAB 02-21	212,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLF)	21,284,500
BONO SCOTIAB 03-21	1,845,220	08-mar-21	30-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	184,522,000
BONO SCOTIAB 04-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
BONO SCOTIAB 05-21	4,926,500	29-abr-21	26-abr-24	1,093	Index (IDBTVER)	492,650,000
BONO SCOTIAB 06-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1,093	Index (IDBTVER)	57,230,000
BONO SCOTIAB 07-21	1,526,000	11-ago-21	04-ago-22	358	MSFDVTHY Index	152,600,000
BONO SCOTIAB 08-21	809,300	12-ago-21	10-ago-23	728	Index (IDBTVER)	80,930,000
BONO SCOTIAB 09-21	3,950,200	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	395,020,000
BONO SCOTIAB 10-21	3,848,100	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	384,810,000
BONO SCOTIAB 11-21	1,105,530	07-dic-21	01-jun-23	541	MSCI ETF (EZU)	110,553,000
BONO SCOTIAB 01-22	543,200	28-feb-22	25-feb-25	1093	MSFDVTHY Index	54,320,000
BONO SCOTIAB 02-22	545,100	28-feb-22	27-feb-24	1093	Invesco QQQ Series 1	54,510,000
BONO SCOTIAB 03-22	369,750	08-mar-22	05-sep-23	541	iShares MSCI China ETF	36,975,000
Total Bonos Bancarios al 31 de marzo de 2022						3,796,645,000

Capitalización

Scotiabank

Integración del Capital

Revelación de la integración del Capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios.

(millones de pesos al 31 de marzo de 2022)

Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	11,575
2	Resultado de ejercicios anteriores	48,061
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	10,954
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	70,590
	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)	1,527
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)	230
22	Monto que excede el umbral del 15%	No aplica
23	del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
24	del cual: Derechos de servicios hipotecarios	No aplica
25	del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales	No aplica
26	Ajustes regulatorios nacionales	8,502
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	2
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones	-
J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	7,837
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	663
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones	-
28	Ajustes regulatorios totales al capital común	10,029
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	60,561

Capital adicional de nivel 1: instrumentos

30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,481
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,481
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	3,481
Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios		
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
40 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
41	Ajustes regulatorios nacionales	-
42	Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones	No aplica
43	Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1	-
44	Capital adicional de nivel 1 (AT1)	3,481
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	64,042
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas		
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	4,330
47	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2	-
48	Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel2)	No aplica
49	de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
50 conservador	Reservas	1,855
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	6,185
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios		
52 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53 conservador	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
55 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2	-
58	Capital de nivel 2 (T2)	6,185
59	Capital total (TC = T1 + T2)	70,227
60	Activos ponderados por riesgo totales	425,818
Razones de capital y suplementos		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	14.22%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.04%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.49%
64	Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	17.32%
65	del cual: Suplemento de conservación de capital	2.50%
66	del cual: Suplemento contracíclico bancario específico	0.00%
67	del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)	0.60%
68	Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	7.22%
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)		
69	Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
70	Razón mínima nacional de T1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
71	Razón mínima nacional de TC (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica

Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)		
72	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
73	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
74	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica
75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2		
76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	1,855
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,252
78	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite)	-
79	Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas	-
Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)		
80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
81	Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	No aplica
82	Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual	-
83	Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-
84	Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual	-
85	Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-

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

Referencia	Descripción
1	Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
2	Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.
3	Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo, resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remediones por beneficios definidos a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.
4	No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté representado por títulos representativos o acciones.
5	No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.
6	Suma de los conceptos 1 a 5.
7	No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.
8	Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
9	Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.
12 conservador	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como aquéllas constituidas con cargo a cuentas contables que no formen parte de las partidas de resultados o del capital contable y no sólo la diferencia positiva entre las Pérdidas Esperadas Totales menos las Reservas Admisibles Totales, en el caso de que las Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital.
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
14	No aplica.

15	Inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos que corresponden a los recursos a los que la Institución no tiene acceso irrestricto e ilimitado. Estas inversiones se considerarán netas de los pasivos del plan y de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo que correspondan que no hayan sido aplicados en algún otro ajuste regulatorio.
16 conservador	El monto de la inversión en cualquier acción propia que la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de los fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido.
17 conservador	Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del Grupo Financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.
18 conservador	Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo. Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.
19 conservador	Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo. Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.
20 conservador	Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos. Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.
21	El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.
22	No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.
23	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
24	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
25	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.
26	Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.
A	A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.
B	B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
C	C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
D	D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
E	E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en fondos de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

	correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.
51	Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.
52 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
54 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
55 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
56	Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
57	Suma de los renglones 52 a 56.
58	Renglón 51, menos renglón 57.
59	Renglón 45, más renglón 58.
60	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.
61	Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
62	Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
63	Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
64	Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61,65, 66 y 67.
65	Reportar 2.5%
66	Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
67	La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
68	Renglón 61 menos 7%.
69	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
70	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
71	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
72	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
73	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
74	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
75	El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.
76	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
77	1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
78	Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
79	0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
80	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
81	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
82	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
83	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.
84	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
85	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

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

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Efectivo y equivalentes de Efectivo	38,881
BG2	Cuentas de Margen	840
BG3	Inversiones en Instrumentos Financieros	112,915
BG4	Deudores por reporto	3,187

BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos Financieros Derivados	30,073
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(938)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	426,930
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	20,679
BG11	Bienes adjudicados (neto)	168
BG12	Propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,054
BG13	Inversiones permanentes	3,542
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	16
BG15	Activo por impuestos a la utilidad diferidos	5,619
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (neto)	5,442
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,566
	Activos Intangibles (neto)	4,531
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	429,211
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	41,936
	Valores asignados por liquidar	-
BG19	Acreedores por reporto	40,339
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	1,798
BG22	Instrumentos Financieros Derivados	27,833
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	6
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	24,882
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	9,096
BG27	Pasivo por impuesto a la utilidad	1,052
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,542
	Pasivos por arrendamiento	1,623
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	5,597
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	11,575
BG30	Capital ganado	59,015
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	3,501,297
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	429,401
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	58,662
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	12,972
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	1,674
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	-
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	1,065
BG41	Otras cuentas de registro	1,503,848

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 2022)

Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
	ACTIVO			
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	1,527	BG 15 Activo por impuestos a la utilidad diferidos \$1,527
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	1,855	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$1,855
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	2	BG 13 Inversiones Permanentes \$2
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	7,837	BG 16 Activos Intangibles \$4,531 más Gastos de Instalación \$3,306
21	Participación de los trabajadores en la utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	633	BG 13 Inversiones Permanentes \$663
	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	3,481	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,481
30	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental	33	-	
31	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S	46	4,330	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$4,330
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	11,575	BG 29 Capital Social \$10,458 más Prima en Venta de Acciones \$1,117
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	48,061	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$48,061
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	737	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$737
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	10,218	BG 30 Reservas de Capital \$7,060 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles

				para la Venta (\$160) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$131) más Resultado Neto \$3,449
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
	CUENTAS DE ORDEN			
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
	CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL	Identificador		
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	Estado de Resultados
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

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

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

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

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

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	36,397	2,912
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,892	151
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's	1,334	107
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC	56	4
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	2,912	233
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	2,409	193
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	83	7
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	10	1
Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-

Grupo I-B (ponderados al 2%)	27	2
Grupo I-B (ponderados al 4%)	-	-
Grupo II (ponderados al 0%)	-	-
Grupo II (ponderados al 10%)	-	-
Grupo II (ponderados al 20%)	-	-
Grupo II (ponderados al 50%)	-	-
Grupo II (ponderados al 100%)	-	-
Grupo II (ponderados al 120%)	-	-
Grupo II (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 2.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 10%)	557	45
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	4,083	327
Grupo III (ponderados al 23%)	-	-
Grupo III (ponderados al 25%)	2	-
Grupo III (ponderados al 50%)	351	28
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	-	-
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	3,553	284
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	335	27
Grupo V (ponderados al 50%)	50	4
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	2,029	162
Grupo VI (ponderados al 20%)	1,147	92
Grupo VI (ponderados al 25%)	809	65
Grupo VI (ponderados al 30%)	3,089	247
Grupo VI (ponderados al 40%)	3,263	261
Grupo VI (ponderados al 50%)	38,213	3,057
Grupo VI (ponderados al 70%)	39	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	18,934	1,515
Grupo VI (ponderados al 85%)	5,534	443
Grupo VI (ponderados al 100%)	74,063	5,925
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	146	12
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	13,033	1,043
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	342	27
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	7,073	566
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	61	5
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	148,641	11,891
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	1	0
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,550	124
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	5,674	454
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,122	250

Grupo IX (ponderados al 100%)	14,961	1,197
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5, 6 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	2,828	226
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	22	2

Método empleado	Activos ponderados sujetos a riesgo operacional Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Estándar Alternativo	27,193	2,175
Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses		
	30,927	

Categoría Capitalización

Al 31 de marzo de 2022, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 11.10%, por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

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

Referencia	Características	Opciones
1	Emisor	Scotiabank Inverlat, S.A. , Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2	Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg	N.A.
3	Marco legal	Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
Tratamiento regulatorio		
4	Nivel de capital con transitoriedad	N.A.
5	Nivel de capital sin transitoriedad	Fundamental
6	Nivel del instrumento	Institución de crédito sin consolidar subsidiarias
7	Tipo de Instrumento	Acción series "F" y "B"
8	Monto reconocido en el capital regulatorio	11,575,052,037
9	Valor nominal del instrumento	Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A	Moneda del instrumento	Pesos mexicanos
10	Clasificación contable	Capital
11	Fecha de emisión	13-ene-01
12	Plazo del instrumento	Perpetuidad
13	Fecha de vencimiento	Sin vencimiento
14	Cláusula de pago anticipado	No
15	Primera fecha de pago anticipado	N.A.
15A	Eventos regulatorios o fiscales	No
15B	Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado	N.A.
16	Fechas subsecuentes de pago anticipado	N.A.
Rendimientos / dividendos		
17	Tipo de rendimiento / dividendo	Fijo o Variable
18	Tasa de Interés /Dividendo	La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19	Cláusula de cancelación anticipada	Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20	Discrecionalidad en el pago	Parcialmente discrecional.

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

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

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

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

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

Suplemento de capital contracíclico de la Institución

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

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 sobre los objetivos, lineamientos y políticas de administración de riesgos del Banco, asimismo aprueba periódicamente, los objetivos, lineamientos y políticas para la Administración Integral de Riesgos, así como la estructura de límites para los distintos tipos de riesgo.

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en la Dirección Corporativa de Riesgos, la cual a su vez está organizada en 8 áreas encaminadas a monitorear y mitigar los riesgos a los que está expuesto el Banco; lo anterior para garantizar una gestión adecuada de riesgos tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

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

Riesgo de mercado

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

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre del 31 de marzo de 2022 fue de \$12.29 y su promedio durante el primer trimestre de 2022 fue de \$11.35 mismo que corresponde a un 0.016% del capital neto (\$69,148 a febrero 2022). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del primer trimestre de 2022 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre marzo 2022	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	785,444	818,255
Mercado de Dinero	52,080	51,146
Tipo de cambio		
Cash	228	193
Derivados	22,478	17,341
Capitales		
Derivados	22,776	23,345

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre marzo 2022	(Promedio)
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	12.72	11.89
Tipo de cambio	3.86	1.69
Capitales	-	-
VaR Global	12.29	11.35

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 2022 muestra una pérdida máxima de \$4.410. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, Mexico 1994 por el denominado "Error de diciembre" y Mexico 1997 por el efecto de la "crisis del Rublo" y la crisis financiera asiática.

Asimismo, mensualmente se realizan pruebas de "backtesting" para comparar las pérdidas y ganancias teóricas y reales con el valor en riesgo observado y, en consecuencia, en su caso calibrar los modelos utilizados. El nivel de eficiencia del modelo se basa en el enfoque establecido por el BIS. Respecto de las pruebas de backtesting, durante el primer trimestre de 2022, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

¹Dependiendo 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 2022 así como el promedio del primer trimestre de 2022 se muestran a continuación:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)²	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	49,016	65,663
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	83,803	110,172

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

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez de frente a la contingencia sanitaria por COVID-19, con un CCL promedio durante el primer trimestre de 2022 de 149.53%, manteniéndose por arriba del 100%; así como una amplia reserva de activos líquidos. Se destaca que, a partir del 1 de marzo 2022 se implementaron las nuevas disposiciones de liquidez, las cuales contemplan cambios en el cálculo del CCL, Así mismo, se emiten las reglas definitivas para el cálculo del Coeficiente Estable Neto, el cual, al cierre de marzo 2022 se posicionó en 124%.

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

² Cifras previas al cierre de marzo 2022.

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 2022 y en promedio para el primer trimestre de 2022 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Valor Económico (+100 pbs)	(601)	(403)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(415)	(499)

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	56,771	61,002
Derivados de Cobertura	52,729	55,019

^{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 2022 y el promedio del primer trimestre del 2022 fueron \$2,791 y \$2,894, respectivamente.

Riesgo de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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 de 2022 corresponde a \$135; 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.

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

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

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

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

Condiciones del diferimiento.

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

Elegibilidad de clientes.

- Cliente en la etapa "Vigentes Contables" con base en los oficios P285/2020 y P325/2020 de la CNBV.
- Cobertura nacional.

Aplica para todos los productos de Consumo y Pequeñas Empresas

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

Durante 2020, el Banco constituyó reservas adicionales por \$3,750 para cubrir riesgos incrementales derivados de la emergencia sanitaria por COVID-19, es decir, riesgos no previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia.

Los riesgos incrementales antes mencionados tienen como base la afectación del cuadro macroeconómico y financiero del país, lo que impactó la calidad crediticia y capacidad de pago de los acreditados de los distintos portafolios del Banco.

Las reservas adicionales fueron constituidas sin asignación directa para algún portafolio, es decir, se establecieron como reservas genéricas y su aplicación es acorde con las necesidades particulares de cada portafolio. El consumo y la liberación de dichas reservas comenzó durante el primer trimestre de 2021 y continúa al cierre del primer trimestre de 2022; el monto total remanente de reservas adicionales por COVID-19 al cierre de marzo 2022 asciende a \$1,855.

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

Información metodológica

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito ¹ (Cifras al 31 de marzo 2022)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.3%	3.2%
Consumo	4.3%	10.1%
Cartera Comercial	0.7%	4.3%
Total	0.8%	4.3%

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

Parámetros de Riesgo ¹ (Cifras en millones de pesos al 31 de marzo 2022)	EI ²	PI	SP
Hipotecas	169,767	1.65%	18.50%
Consumo	52,178	5.36%	72.04%
Cartera Comercial	261,018	2.00%	44.17%

1/ EI (Exposición al Incumplimiento) calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en incumplimiento.

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

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de marzo de 2022.

Políticas para asegurar las garantías reales y establecer reservas de crédito

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

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

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

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

Riesgo de crédito en instrumentos financieros

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

Al cierre de marzo 2022 y en promedio durante el primer trimestre de 2022, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.11% y 0.06% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo Operacional

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

Metodología general

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

Políticas para la gestión de riesgo operacional

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

Evaluación de riesgo operacional

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

Manual para la recolección y clasificación de datos de riesgo operacional

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

Niveles de tolerancia de riesgo Operacional

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

Indicadores clave de riesgo (KRI)

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

Riesgo Legal

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

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

Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de enero – marzo 2022, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$493.8, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de marzo 2022 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$294.1, donde \$14.7 corresponden a riesgo operacional y \$279.4 a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)
Periodo Reportado: diciembre 2021 - marzo 2022

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez³

(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES		
1 Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	110,177.61
SALIDAS DE EFECTIVO		
2 Financiamiento minorista no garantizado	165,030.13	12,249.16
3 Financiamiento estable	94,895.56	5,235.70
4 Financiamiento menos estable	70,134.57	7,013.46
5 Financiamiento mayorista no garantizado	218,277.04	80,412.04
6 Depósitos operacionales	88,964.87	21,507.38
7 Depósitos no operacionales	125,795.78	55,388.28
8 Deuda no garantizada	3,516.39	3,516.39
9 Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	412.49
10 Requerimientos adicionales:	286,558.59	23,420.38
11 Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	5,953.19	4,949.49
12 Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-
13 Líneas de crédito y liquidez	280,605.39	18,470.89
14 Otras obligaciones de financiamiento contractuales	420.96	420.96
15 Otras obligaciones de financiamiento contingentes	518.43	518.43
16 TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	117,433.46

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

ENTRADAS DE EFECTIVO			
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	10,641.72	212.23
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	40,943.47	30,244.19
19	Otras entradas de efectivo	12,836.33	12,836.33
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	64,421.52	43,292.75
			Importe ajustado
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	110,177.61
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	74,140.72
23	COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ	No aplica	148.81⁴

- (a) *Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando.*
90 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 2022, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):⁵

- o Principales Salidas de Efectivo:
Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$47,033 y depósitos a plazo tradicionales por \$36,778, 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 \$1,701 y \$2,791 respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$16,497.
- o Principales Entradas de Efectivo:
Entradas por flujo de carteras de \$13,932 y por operaciones de call money de \$16,640 y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$12,160.
- o Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$83,803 en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$62,195 en títulos de deuda de nivel 1, \$11,930 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 \$8,140 y \$1,537 en títulos de nivel 2.

Adicionalmente, cabe resaltar que estos cambios también fueron afectados por los cambios publicados el 1 de marzo dentro de las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, las cuales representaron cambios en la forma de calcular el CCL.

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

Cierre de diciembre 2021: 144% – cierre de marzo 2022: 132% (decremento: 1,200pb) El coeficiente de cobertura de liquidez decrementó 1,200pb respecto de diciembre 2021, esto debido principalmente a:

- o El fondeo tradicional del banco creció en \$1,345, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$17,611.
- o En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$2,775 y los depósitos en bancos decrementaron en MXN 3,619 MM.
- o Finalmente, los activos líquidos tuvieron un decremento de \$12,601.

- (d) *La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables⁶;*

Evolución de Activos Líquidos T1-2022	Enero	Febrero	Marzo
Efectivo	6%	7%	10%
Reservas en el Banco Central	22%	16%	14%
Nivel 1	71%	76%	74%
Nivel 2 ^a	1%	1%	2%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

4 Cifras previas sujetas a confrontas de Banco de México.

5 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.

6 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	47%	46%	46%
Depósitos a plazo			
Del público en general	37%	37%	40%
Mercado de dinero	1%	1%	1%
Títulos de crédito emitidos	6%	6%	5%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	3%	4%	3%
De largo plazo	6%	6%	5%
Total	100%	100%	100%

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

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

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

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

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

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

(Cifras en millones de pesos)

Exposición Potencial Futura (Marzo 2022)	
Con contrato de compensación	3,403
Sin contrato de compensación	5,330
Posibles llamadas de margen (Marzo 2022)	
Colateral en Tránsito	24
Downgrade (Marzo 2022)	
Baja calificación 3 niveles	2,791

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

Scotiabank-Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	785,443.50
Tipo de cambio	22,478.32
Capitales	22,775.89
Total	830,697.71

(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 marzo 2022, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -3.26% al cierre de marzo del 2022 y en promedio durante marzo 2022 fue de -3.16%

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.

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

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

⁷ Sujeto a excepciones para algunos nombres.

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

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

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

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

Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con los siguientes exposiciones a finales de marzo 2022.

Descripción	Promedio T1 2022	Marzo 2022
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	8,779	578
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	34,665	39,696
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	42	40
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	37	34
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	42	40
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	37	34

(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 descalse 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 2022 y el promedio del primer trimestre de 2022 son:

Scotiabank	Posición	Posición
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	49,016	65,663
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	83,803	110,172

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ⁸	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	49,016	65,663
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	83,803	110,172

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;

⁸ Cifras previas al cierre de marzo 2022.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- Medición, supervisión y pronóstico de compromisos que involucren flujos de efectivo para las principales monedas manejadas por el Banco (MXP+UDIs y USD).

- Procurar una distribución uniforme de los flujos de efectivo, minimizando las brechas de liquidez entre activos y pasivos, considerando el impacto potencial de renovaciones, prepagos, retiros de depósitos, otorgamiento de crédito y el incumplimiento en pago de créditos.
- Mantener fuentes diversificadas de fondeo.
- Establecer programas de corresponsalías y préstamos interbancarios para ayudar a mantener el acceso a mercado.
- Instrumentar y mantener disponibles programas para la emisión de pasivos, y descuento de cartera con fondos especializados.
- Mantener la capacidad operativa en los sistemas de liquidación establecidos por Banco de México, considerando para esto los requerimientos de garantía y límites establecidos para tal efecto.
- Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el primer trimestre de 2022, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del primer trimestre 2022, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN) Periodo Reportado: marzo 20229

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto¹⁰

(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:	74,071	0	0	0	74,071	74,071	0	0	0	74,071
2 Capital fundamental y capital básico no fundamental.	74,071	0	0	0	74,071	74,071	0	0	0	74,071
3 Otros instrumentos de capital.	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
4 Depósitos minoristas:	0	208,809	1,431	46	193,915	0	208,809	1,431	46	193,915
5 Depósitos estables.	0	92,452	598	25	88,424	0	92,452	598	25	88,424
6 Depósitos menos estables.	0	116,357	833	21	105,491	0	116,357	833	21	105,491
7 Financiamiento mayorista:	0	245,866	24,366	33,978	142,477	0	245,866	24,366	33,978	142,477
8 Depósitos operacionales.	0	4,394	0	0	2,197	0	4,394	0	0	2,197
9 Otro financiamiento mayorista.	0	241,472	24,366	33,978	140,280	0	241,472	24,366	33,978	140,280
10 Pasivos interdependientes	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
11 Otros pasivos:	0	1,509	0	4,330	4,330	0	1,509	0	4,330	4,330
12 Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
13 Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	0	1,509	0	4,330	4,330	0	1,509	0	4,330	4,330
14 Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	74,071	456,184	25,798	38,354	414,794	74,071	456,184	25,798	38,354	414,794
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	5,310.49	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	5,310.49
16 Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
17 Préstamos al corriente y valores:	0	109,839	33,021	278,635	305,452	0	109,839	33,021	278,635	305,452
18 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0	2,937	0	0	294	0	2,937	0	0	294
19 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0	8,544	1,622	8,984	11,077	0	8,544	1,622	8,984	11,077
20 Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0	83,449	28,464	112,346	151,451	0	83,449	28,464	112,346	151,451
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	0	0	0	0	0	0	0	0	0
22 Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:	0	2,749	2,935	157,304	136,551	0	2,749	2,935	157,304	136,551
23 Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
24 Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0	12,160	0	0	6,080	0	12,160	0	0	6,080
25 Activos interdependientes.	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
26 Otros Activos:	0	68,400	0	0	33,800	0	68,400	0	0	33,800
27 Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	0	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0	0	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0
28 Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	No Aplica	1,578	0	0	1,341	No Aplica	1,578	0	0	1,341
29 Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0	0	0	509	No Aplica	0	0	0	509
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	0	0	3,049	No Aplica	0	0	0	3,049
31 Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.	0	66,823	0	0	28,901	0	66,823	0	0	28,901
32 Operaciones fuera de balance.	No Aplica	271,489	0	0	13,574	No Aplica	271,489	0	0	13,574
33 Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	358,137	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	358,137
34 Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	115.82	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	115.82

⁹ Se presenta únicamente cifras previas del mes de marzo 2022, toda vez que, las nuevas disposiciones en materia de liquidez entraron en vigor el 1 de marzo del 2022, en la cual se contemplan las reglas definitivas para el cálculo de este indicador.

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

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

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

o Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$159,268 y depósitos a plazo tradicionales por \$127,832, Capital (fundamental y complementario) por \$78,402, fondeo Interbancario por \$32,859 y Fondeo profesional por \$16,434.

o Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$320,514 y por operaciones mercado de dinero de \$11,958, compromisos crediticios por \$13,574 y deducciones de capital por \$10,029.

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

Derivado de que las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple entraron en vigor el 1 de marzo del 2022, y éstas son las que establecen las reglas definitivas para el cálculo de este indicador, solo se tiene una observación dentro del trimestre, la cual fue el cierre de marzo del 2022.

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

Derivado de que las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple entraron en vigor el 1 de marzo del 2022, y éstas son las que establecen las reglas definitivas para el cálculo de este indicador, solo se tiene una observación dentro del trimestre, la cual fue el cierre de marzo del 2022.

(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 2022 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$22.55 millones de pesos, con una plusvalía de \$0.39 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1KIMBERA	160,000	4.48	4.18	0.30
Scotiabank	Pública	1BACHOCOB	5,000	0.39	0.33	0.06
Scotiabank	Pública	1EFRES*	1,250	0.26	0.30	(0.04)
Scotiabank	Pública	1ISHV*	900	1.98	1.99	(0.01)
Scotiabank	Pública	41BSMXB	182,911	3.86	3.88	(0.02)
Scotiabank	Pública	1FEMSAUBD	28,000	4.63	4.59	0.04
Scotiabank	Pública	1KOFUBL	32,000	3.50	3.42	0.08
Scotiabank	Pública	1IIB01N	1,700	3.45	3.47	(0.02)
Total			411,761	22.55	22.16	0.39

Al cierre del primer trimestre del año 2022, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$0.18 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1GCARSOA1	1	-	-	-
Scotiabank	Pública	1KIMBERA	376,262	0.11	(0.25)	(0.14)
Scotiabank	Pública	1IEWG*	16,911	0.25	(0.12)	0.13
Scotiabank	Pública	1BACHOCOB	102,317	0.08	(0.09)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1PE&OLES*	35,519	0.04	(0.23)	(0.19)
Scotiabank	Pública	1ATX*	4,400	0.33	-	0.33
Scotiabank	Pública	1EFRES*	5,914	-	(0.11)	(0.11)
Scotiabank	Pública	1CHDRAUIB	10,980	-	-	-
Scotiabank	Pública	1IMCHI*	2,810	0.07	(0.06)	0.01
Scotiabank	Pública	1AFB*	600	0.05	(0.03)	0.02
Scotiabank	Pública	1NEMAKA	607,728	0.07	(0.11)	(0.04)
Scotiabank	Pública	41BSMXB	155,262	-	(0.14)	(0.14)
Scotiabank	Pública	1FEMSAUBD	27,362	0.03	(0.02)	0.01
Scotiabank	Pública	1KOFUBL	4,446	-	-	-
Scotiabank	Pública	1IIB01N	1,046	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1ALFAA	2,034	-	-	-
Scotiabank	Pública	1AMXL	494,432	0.04	(0.12)	(0.08)
Scotiabank	Pública	1CEMEXCPO	512,277	0.07	(0.03)	0.04
Total			2,360,301	1.14	(1.32)	(0.18)

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

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

Al 31 de marzo, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$6.65 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$4.89 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.76 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización

Por Riesgo General de Mercado	POSICIONES			Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición		
	21.99	-	21.99	22.23%	4.89
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	21.99	-	21.99	8.00%	1.76
Índices accionarios	-	-	-	4.00%	-
Requerimiento por riesgos	-	-	-	4.00%	-
			Total Requerimiento de capital		6.65

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	mar-22
Exposiciones dentro del balance		
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	622,247
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,029)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	612,217
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)	5,839
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	3,789

6	Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo	
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	(1,741)
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)	7,887
	Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores	
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	3,187
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(1,513)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	-
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	1,674
	Otras exposiciones fuera de balance	
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	276,825
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(177,660)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	99,164
	Capital y exposiciones totales	
20	Capital de Nivel 1	64,042
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	720,944
	Coefficiente de apalancamiento	
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	8.88%

Cifras en millones de pesos

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Mar-22
1	Activos totales	655,507
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	(665)
3	Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento	
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	(22,186)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(1,513)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	99,164
7	Otros ajustes	(9,364)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	720,944

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Mar-22
1	Activos totales	655,507
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(30,073)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(3,187)
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	622,247

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

CONCEPTO/PERIODO	Mar-22
Capital Básico ^{1/}	64,042
Activos Ajustados ^{2/}	720,944
Razón de Apalancamiento ^{3/}	8.88%

Cifras previas a la réplica de Banxico

Elementos de la Razón de Apalancamiento al 31 de marzo de 2022.

El indicador de la razón de apalancamiento se ubicó en 8.88%, debido principalmente a los buenos resultados que han incrementado el capital del grupo.

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: <ul style="list-style-type: none"> a) Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución. b) La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia. c) El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda. d) El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente. e) El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos. <p>En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.</p>
5	Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones. <p>En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.</p>
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7	Monto de márgenes de variación en efectivo <i>entregados</i> en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
10	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11	Suma de las líneas 4 a 10
12	Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente) de operaciones de reporto y préstamo de valores. El importe no deberá considerar ninguna compensación conforme a los Criterios Contables.
13	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: <ul style="list-style-type: none"> a) Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.

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

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

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

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

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

Agencias Calificadoras

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

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

Dividendos

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

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

Fecha de pago

23 de abril de 2013

Importe

\$ 165 millones

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de marzo del 2022, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$60,764 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$44,771 millones de pesos.

Adicionalmente:

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

Inversiones relevantes en capital

Al 31 de marzo de 2022, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



Instrumentos Financieros Derivados

Scotiabank

I. Información Cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados. Durante el primer trimestre de 2022, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

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

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

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

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

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

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

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

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ¹¹	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	49,016	65,663
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	83,803	110,172

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

Inventario de modelos de derivados

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

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

¹¹ Cifras previas al cierre de marzo 2022.

Tipo de cambio	IRS	El intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIEE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).
	CCIRS	Intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.
	Europea	En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black–Scholes–Merton.
	Americana	El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)
Opciones	Binaria	Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción. A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.
	Barrera	Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento S_T , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t < T}$, son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente S_T alcance un umbral preestablecido H llamado barrera de la opción.
Forward	Forward	Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.
	OTC	

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

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

Políticas Líneas de Crédito

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

- Tipos de Operación que son ofrecidos en función al tipo de acreditado
 - a) Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:
 - Necesidades de tesorería del Banco
 - Relación de correspondencia
 - Límites recíprocos

- b) Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:
 - Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.
- c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:
 - Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

- Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

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

- Sujetos de Crédito

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

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

- Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

- Idoneidad del Cliente

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

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

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

Políticas de VaR

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

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

b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

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

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

Bonos de Tasa Flotante

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

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

Bonos Cupón Cero

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

Riesgo de Crédito

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

Sensibilidad del Pasivo

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

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

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

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

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con los requerimientos del B5 para concluir cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2022 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son cobertura eficiente.

Durante el primer trimestre de 2022 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

En adición a lo arriba descrito, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base 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 2022 y promedio del primer trimestre 2022 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ¹²	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	83,803	110,172

¹² Cifras previas al cierre de marzo 2022.

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

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

En donde:

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

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario de Estrés
Gap 30d Gap Acum	49,016	46,225	46,225	46,225
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(2,791)	(2,791)	(2,791)

d. Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

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

Vega

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

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

Rho

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

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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

II. Información Cuantitativa

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a marzo 31, 2022:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	1,443.00	(2,731.00)	22,543.00	(5,785.00)	(25,478.00)	646.00	(9,362.00)
CCS	1.00	12.00	(2.00)	(22.00)	10.00	(1.00)	(2.00)
Caps&Floors	(44.00)	135.00	6.00	9.00	-	-	106.00
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total DERIVATIVES	1,400.00	(2,584.00)	22,547.00	(5,798.00)	(25,468.00)	645.00	(9,258.00)

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (10.02) Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (20.04) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (49.63) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock(+/-)	P&L	Stress 1 Shock(+/-)	P&L	Stress 2 Shock(+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	(0.01)	(109.84)	50.00	(0.46)	100.00	(0.93)	200.00	(1.85)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	(0.01)	(0.23)	0.10	(0.00)	0.40	(0.00)	1.00	(0.01)
a FX %	Forwards	4.80	95.54	0.10	(9.56)	0.20	(19.11)	0.50	(47.77)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	0.00	0.20	-	0.50	0.00
Total					(10.02)		(20.04)		(49.63)

b. Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 31 marzo de 2022 (la sensibilidad de las opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

	Delta	Vega	Gamma
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXEZU.USM	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXIL5.INDX	-	-	-
Options MEXIXM.INDX	-	-	-
Options MEXMCH.USM	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options MEXQQQ.USM	-	-	-
Options MEXSR5.INDX	-	-	-
Options MEXXLE.USM	-	-	-
TOTAL	-	-	-

Análisis de Stress

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

	Escenarios a la Baja		
	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXEZU.USM	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXIL5.INDX	-	-	-
Options MEXIXM.INDX	-	-	-
Options MEXMCH.USM	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options MEXQQQ.USM	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	-	-	-
Options MXSxAE.INDX	-	-	-
TOTAL	-	-	-

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

	Escenarios a la Alza		
	0.05	0.15	0.2
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXEZU.USM	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXIL5.INDX	-	-	-
Options MEXIXM.INDX	-	-	-
Options MEXMCH.USM	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options MEXQQQ.USM	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	-	-	-
Options MXSxAE.INDX	-	-	-
TOTAL	-	-	-

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del Escenario	Monto
Probable	(0.00)
Poco Probable	(0.00)
Muy poco Probable	(0.00)

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

Respecto a las llamadas de margen, al 31 de marzo de 2022 se tienen los siguientes saldos:
Cifras expresadas en pesos

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	MXN	86,100,000.00	(39,500,000)
CLIENTE 2	MXN	31,000,000	(31,000,000)
CLIENTE 3	MXN	9,300,000.00	(26,600,000)
CLIENTE 4	MXN	85,900,000	(109,100,000)
CLIENTE 5	MXN	154,400,000	(58,200,000)
CLIENTE 6	MXN	807,200,583	(428,300,000)
CLIENTE 7	USD	6,700,000	(20,290,000)
CLIENTE 8	USD	83,880,000	(6,070,000)
CLIENTE 9	USD	209,170,000	(65,300,000)
CLIENTE 10	USD	-	(980,000)
CLIENTE 11	USD	3,430,000	(5,960,000)
CLIENTE 12	USD	300,000	-
CLIENTE 13	USD	26,960,000	(28,440,000)
CLIENTE 14	USD	260,000	-
CLIENTE 15	USD	9,760,000	(22,640,000)
CLIENTE 16	MXN	312,600,000	(266,500,000)
CLIENTE 17	MXN	146,300,000	(181,200,000)
CLIENTE 18	MXN	23,400,000	(13,400,000)
CLIENTE 19	MXN	-	(29,700,000)
CLIENTE 20	MXN	342,400,000	(684,100,000)
CLIENTE 21	USD	16,010,000	-
CLIENTE 22	MXN	89,000,000	-
CLIENTE 23	MXN	52,872,686	(8,061,341,000)
CLIENTE 24	MXN	25,000,000	(12,400,000)
CLIENTE 25	MXN	-	(127,700,000)
CLIENTE 26	USD	5,130,000	(7,580,000)
CLIENTE 27	USD	-	(4,715,000)
CLIENTE 28	USD	2,780,000	(9,800,000)
TOTAL		2,529,853,269.30	(10,240,816,000)

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

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CuriD	PaySide Notional	PaySide CuriD	RcvSide Notional	RcvSide CuriD	Option Notional
SDU075	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	860,000,000	MXN	860,000,000	MXN	
SEC523	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SEC543	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SEQ070	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	3,500,000	USD	3,500,000	USD	
SEQ081	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	3,500,000	USD	3,500,000	USD	
SDW459	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW483	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	310,000,000	MXN	310,000,000	MXN	
SDU254	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDW602	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SEV453	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	197,500,000	MXN	197,500,000	MXN	
SEV519	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	197,500,000	MXN	197,500,000	MXN	
SEV754	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDT729	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	750,000,000	MXN	750,000,000	MXN	
SEQ646	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	37,000,000	MXN	37,000,000	MXN	
SEQ659	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	37,000,000	MXN	37,000,000	MXN	
SEV987	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SFE685	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
SFE693	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
SDT765	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDU731	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SDU754	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SEE792	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	1,500,000,000	MXN	1,500,000,000	MXN	
SFF241	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
SFF251	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
P16913	Cap	ene-22	Sell	A	MXN					9,000,000
SDX003	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	8,000,000	MXN	8,000,000	MXN	
SDX012	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	8,000,000	MXN	8,000,000	MXN	
SEE913	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	875,000,000	MXN	875,000,000	MXN	
SED698	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	6,000,000	USD	6,000,000	USD	
SED728	SC Swap	ene-22	Buy	A	USD	6,000,000	USD	6,000,000	USD	
SEF581	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDV022	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SED859	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SED867	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFR882	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SFR883	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SFR890	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SFR891	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDV644	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SEF808	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	3,800,000,000	MXN	3,800,000,000	MXN	
SEF813	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	3,800,000,000	MXN	3,800,000,000	MXN	
SFS979	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	197,500,000	MXN	197,500,000	MXN	
SFS983	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	197,500,000	MXN	197,500,000	MXN	
SDV400	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	365,000,000	MXN	365,000,000	MXN	
SDW930	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW951	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SEG163	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	1,290,000,000	MXN	1,290,000,000	MXN	
C74256	CC Swap	ene-22	Buy	A	USD	300,000,000	USD	6,306,000,000	MXN	
C74257	CC Swap	ene-22	Buy	A	USD	6,306,000,000	MXN	300,000,000	USD	
SDV599	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT952	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SDT964	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SDU603	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDV756	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	260,000,000	MXN	260,000,000	MXN	
SDV883	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV891	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDS670	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDV823	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDW009	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDW047	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	140,000,000	MXN	140,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SFC497	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SFC575	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU685	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SEF691	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEF709	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEY379	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
P17048	Cap	ene-22	Sell	A	MXN					100,000,000
P17049	Cap	ene-22	Buy	A	MXN					100,000,000
SDS373	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS381	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS175	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	2,500,000	MXN	2,500,000	MXN	
SDS251	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	2,500,000	MXN	2,500,000	MXN	
SDV207	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	3,557,035	MXN	3,557,035	MXN	
SDV226	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	3,557,035	MXN	3,557,035	MXN	
SEF785	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEF801	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SDS238	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	7,496,308	MXN	7,496,308	MXN	
SDS261	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	7,496,308	MXN	7,496,308	MXN	
SDV064	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	3,800,000	MXN	3,800,000	MXN	
SDV066	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	3,800,000	MXN	3,800,000	MXN	
SDV458	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	7,363,782	MXN	7,363,782	MXN	
SDV467	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	4,003,080	MXN	4,003,080	MXN	
SDV473	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	4,003,080	MXN	4,003,080	MXN	
SDW088	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	7,363,782	MXN	7,363,782	MXN	
SDW263	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	5,420,100	MXN	5,420,100	MXN	
SDW267	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	5,420,100	MXN	5,420,100	MXN	
SDW848	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	10,916,730	MXN	10,916,730	MXN	
SDW849	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	10,916,730	MXN	10,916,730	MXN	
SEF902	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEF916	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SDS438	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDS439	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SEJ476	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	2,250,000,000	MXN	2,250,000,000	MXN	
SEJ479	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	2,250,000,000	MXN	2,250,000,000	MXN	
MNF353	Term Deposit	ene-22	Buy	A	MXN			21,083,333	MXN	
SDU782	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SDV766	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	21,083,333	MXN	21,083,333	MXN	
SDV778	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	21,083,333	MXN	21,083,333	MXN	
SDV797	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	21,083,333	MXN	21,083,333	MXN	
SEJ612	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SFC744	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	65,000,000	MXN	65,000,000	MXN	
SFC765	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	65,000,000	MXN	65,000,000	MXN	
SDS426	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDS428	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDV379	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SEQ333	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	4,500,000	MXN	4,500,000	MXN	
SEQ337	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	4,500,000	MXN	4,500,000	MXN	
C67416	CC Swap	ene-22	Buy	A	USD	15,694,733	USD	308,558,451	MXN	
C67417	CC Swap	ene-22	Buy	A	USD	308,558,451	MXN	15,694,733	USD	
MNF383	Term Deposit	ene-22	Buy	A	MXN			500,000,000	MXN	
SDS382	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	352,746,494	MXN	352,746,494	MXN	
SDS389	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	352,746,494	MXN	352,746,494	MXN	
SDS467	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS484	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS488	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS701	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	15,124,263	MXN	15,124,263	MXN	
SDS727	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	15,124,263	MXN	15,124,263	MXN	
SDU276	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV321	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	10,353,354	MXN	10,353,354	MXN	
SDV353	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	10,353,354	MXN	10,353,354	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SEJ841	SC Swap	ene-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDV384	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDV392	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDV669	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SEQ440	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	4,500,000	MXN	4,500,000	MXN	
SEQ453	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	4,500,000	MXN	4,500,000	MXN	
SDV780	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW401	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDX179	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX581	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDV441	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	120,000,000	MXN	120,000,000	MXN	
SDW756	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	290,000,000	MXN	290,000,000	MXN	
SEK089	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEQ891	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	3,400,000	MXN	3,400,000	MXN	
SEQ901	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	3,400,000	MXN	3,400,000	MXN	
SFA197	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	442,000,000	MXN	442,000,000	MXN	
SFA198	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	442,000,000	MXN	442,000,000	MXN	
SEP136	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	12,000,000	MXN	12,000,000	MXN	
SEP218	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	12,000,000	MXN	12,000,000	MXN	
SEJ534	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEJ552	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SDU982	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	21,746,000	MXN	21,746,000	MXN	
SDV470	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	8,254,000	MXN	8,254,000	MXN	
SDV486	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	21,746,000	MXN	21,746,000	MXN	
SDW792	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	8,254,000	MXN	8,254,000	MXN	
SDV154	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	205,000,000	MXN	205,000,000	MXN	
SDS880	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	32,738,695	MXN	32,738,695	MXN	
SDS910	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	32,738,695	MXN	32,738,695	MXN	
SDU264	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	573,000,000	MXN	573,000,000	MXN	
SDV203	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SEO944	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEW009	SC Swap	feb-22	Buy	A	USD	3,500,000	USD	3,500,000	USD	
SEW047	SC Swap	feb-22	Buy	A	USD	3,500,000	USD	3,500,000	USD	
SEX261	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000,000	MXN	10,000,000,000	MXN	
SEX271	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000,000	MXN	10,000,000,000	MXN	
SDS583	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SDS592	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SDV223	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	700,000,000	MXN	700,000,000	MXN	
SDV227	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	700,000,000	MXN	700,000,000	MXN	
SDV965	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDV968	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	750,000,000	MXN	750,000,000	MXN	
SDV981	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	750,000,000	MXN	750,000,000	MXN	
SDV988	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDW053	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,250,000,000	MXN	1,250,000,000	MXN	
SDW057	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,250,000,000	MXN	1,250,000,000	MXN	
SDW068	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDW071	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDW076	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	750,000,000	MXN	750,000,000	MXN	
SDW094	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	750,000,000	MXN	750,000,000	MXN	
SDW271	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,500,000,000	MXN	1,500,000,000	MXN	
SDW276	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	750,000,000	MXN	750,000,000	MXN	
SDW278	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	750,000,000	MXN	750,000,000	MXN	
SDX211	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SEP194	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEX380	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000,000	MXN	5,000,000,000	MXN	
SEX381	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000,000	MXN	5,000,000,000	MXN	
SDU317	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV329	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDV332	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDX224	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SFB243	SC Swap	feb-22	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SFB251	SC Swap	feb-22	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SDV609	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SEF641	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SEF681	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDV564	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	400,000,000	MXN	400,000,000	MXN	
SDV585	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	400,000,000	MXN	400,000,000	MXN	
SDW139	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX028	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDX265	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX272	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SFR052	SC Swap	feb-22	Buy	A	USD	2,000,000	USD	2,000,000	USD	
SFR109	SC Swap	feb-22	Buy	A	USD	2,000,000	USD	2,000,000	USD	
SDX309	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SEZ631	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	9,406,780	MXN	9,406,780	MXN	
SEZ634	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	9,406,780	MXN	9,406,780	MXN	
P17127	Floor	feb-22	Buy	A	MXN					65,000,000
P17128	Cap	feb-22	Sell	A	MXN					65,000,000
P17129	Cap	feb-22	Buy	A	MXN					65,000,000
P17130	Cap	feb-22	Buy	A	MXN					65,000,000
P17131	Cap	feb-22	Sell	A	MXN					65,000,000
P17288	Floor	feb-22	Sell	A	MXN					65,000,000
SDS683	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	320,000,000	MXN	320,000,000	MXN	
SEP535	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEP543	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SDZ674	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,400,000,000	MXN	1,400,000,000	MXN	
SDZ678	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEY066	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,500,000	MXN	1,500,000	MXN	
SEY104	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,500,000	MXN	1,500,000	MXN	
SEY114	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SEY117	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SEY121	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SEY125	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SEY126	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SEY127	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
P16886	Cap	feb-22	Buy	A	MXN					370,000,000
P16912	Cap	feb-22	Sell	A	MXN					370,000,000
SDS647	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS663	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV020	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDV023	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDV047	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDV058	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDV691	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	815,000,000	MXN	815,000,000	MXN	
SDV804	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	370,000,000	MXN	370,000,000	MXN	
SDW867	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	370,000,000	MXN	370,000,000	MXN	
SDZ923	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,500,000,000	MXN	1,500,000,000	MXN	
SEP940	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEP952	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SET441	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SET481	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEY535	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,500,000	MXN	1,500,000	MXN	
SEY617	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,500,000	MXN	1,500,000	MXN	
P17025	Cap	feb-22	Sell	A	MXN					4,274,423
P17026	Cap	feb-22	Buy	A	MXN					4,274,423
C67418	CC Swap	feb-22	Buy	A	USD	324,171,137	MXN	15,992,656	USD	
C67419	CC Swap	feb-22	Buy	A	USD	15,992,656	USD	324,171,137	MXN	
C67423	CC Swap	feb-22	Buy	A	USD	461,242,185	MXN	23,119,909	USD	
C67424	CC Swap	feb-22	Buy	A	USD	23,119,909	USD	461,242,185	MXN	
P16974	Cap	feb-22	Sell	A	MXN					2,200,000

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
P16975	Cap	feb-22	Buy	A	MXN					2,200,000
SDS018	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	2,500,000,000	MXN	2,500,000,000	MXN	
SDS022	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	2,500,000,000	MXN	2,500,000,000	MXN	
SDT763	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	545,972	MXN	545,972	MXN	
SDT840	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	545,972	MXN	545,972	MXN	
SDV723	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,088,535	MXN	1,088,535	MXN	
SDV733	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,088,535	MXN	1,088,535	MXN	
SDX483	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SEA116	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEP972	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	9,000,000	MXN	9,000,000	MXN	
SEP997	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	9,000,000	MXN	9,000,000	MXN	
SEQ119	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	4,500,000	MXN	4,500,000	MXN	
SEQ135	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	4,500,000	MXN	4,500,000	MXN	
SEQ331	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEQ336	SC Swap	feb-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
C67390	CC Swap	mar-22	Buy	A	USD	924,750	USD	22,101,525	MXN	
C67398	CC Swap	mar-22	Buy	A	USD	22,101,525	MXN	924,750	USD	
SDX434	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SEY744	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	3,300,000	MXN	3,300,000	MXN	
SEY778	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	3,300,000	MXN	3,300,000	MXN	
SDS100	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDX567	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SEA757	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SER309	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000,000	MXN	2,000,000,000	MXN	
SER315	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDT562	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SEU982	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEU997	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEG786	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SEG802	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SEV250	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SEV308	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
P17206	Cap	mar-22	Sell	A	MXN					13,151,179
P17207	Cap	mar-22	Buy	A	MXN					13,151,179
P17208	Cap	mar-22	Sell	A	MXN					13,151,179
P17209	Cap	mar-22	Buy	A	MXN					13,151,179
SDS187	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDS204	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	490,000,000	MXN	490,000,000	MXN	
SEG787	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SEG797	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SEQ606	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEQ620	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SDS214	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDS224	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDW885	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SEG781	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SEG798	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SEG785	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SEG801	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SEQ949	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SEQ973	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
P16887	Cap	mar-22	Sell	A	MXN					15,000,000
SDS374	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDS619	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDS624	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDV079	SC Swap	mar-22	Buy	A	USD	61,797	USD	61,797	USD	
SDV155	SC Swap	mar-22	Buy	A	USD	61,797	USD	61,797	USD	
SFA082	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	3,400,000	MXN	3,400,000	MXN	
SFA108	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	3,400,000	MXN	3,400,000	MXN	
SFA192	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	4,300,000	MXN	4,300,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SFA200	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	4,300,000	MXN	4,300,000	MXN	
SDS551	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	210,000,000	MXN	210,000,000	MXN	
SDW393	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SER263	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SER313	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SFA199	SC Swap	mar-22	Buy	A	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
SFA219	SC Swap	mar-22	Buy	A	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
SFA390	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,820,000	MXN	2,820,000	MXN	
SFA404	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,820,000	MXN	2,820,000	MXN	
MNF453	Term Loan	mar-22	Buy	A	MXN	2,875,000,000	MXN			
MP1990	Term Loan	mar-22	Buy	A	MXN	3,450,000,000	MXN			
SDW005	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDW039	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDV152	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	24,246,708	MXN	24,246,708	MXN	
SDV181	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	8,300,000	MXN	8,300,000	MXN	
SDV496	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	24,246,708	MXN	24,246,708	MXN	
SDV506	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	8,300,000	MXN	8,300,000	MXN	
SDS741	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN	
SDU362	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU408	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV652	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	835,000,000	MXN	835,000,000	MXN	
SDV831	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN	
SEC332	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,500,000,000	MXN	1,500,000,000	MXN	
SET325	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,770,000,000	MXN	1,770,000,000	MXN	
SFA650	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,480,000	MXN	1,480,000	MXN	
SFA738	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,480,000	MXN	1,480,000	MXN	
SDS721	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU458	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SES168	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SES173	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SET434	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000,000	MXN	2,000,000,000	MXN	
SET435	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,000,000,000	MXN	2,000,000,000	MXN	
SET484	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,250,000,000	MXN	2,250,000,000	MXN	
SET524	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SFA918	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	4,000,000	MXN	4,000,000	MXN	
SFA926	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	4,000,000	MXN	4,000,000	MXN	
SFU231	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	197,500,000	MXN	197,500,000	MXN	
SFU232	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SFU233	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SFU234	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	197,500,000	MXN	197,500,000	MXN	
SDS751	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDS754	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS776	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDW288	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	7,992,251	MXN	7,992,251	MXN	
SDW290	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	7,992,251	MXN	7,992,251	MXN	
SDZ068	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,500,000,000	MXN	1,500,000,000	MXN	
SDZ074	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,500,000,000	MXN	1,500,000,000	MXN	
SEA124	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,450,000,000	MXN	1,450,000,000	MXN	
SEA125	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,450,000,000	MXN	1,450,000,000	MXN	
SES292	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SES309	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SEX339	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	4,200,000	MXN	4,200,000	MXN	
SEX378	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	4,200,000	MXN	4,200,000	MXN	
SDV307	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	450,000,000	MXN	450,000,000	MXN	
SDV326	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	450,000,000	MXN	450,000,000	MXN	
SET726	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	890,000,000	MXN	890,000,000	MXN	
P17035	Cap	mar-22	Sell	A	MXN					15,000,000
P17036	Cap	mar-22	Buy	A	MXN					15,000,000
SDS476	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS480	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDS641	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS654	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDS829	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDS899	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS929	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV140	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV839	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SED114	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SED115	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SES516	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SES592	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SDS881	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	700,000,000	MXN	700,000,000	MXN	
SDS885	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	700,000,000	MXN	700,000,000	MXN	
SDV144	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDV846	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDV942	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	64,000,000	MXN	64,000,000	MXN	
SET146	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SET162	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SFZ889	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,140,000,000	MXN	2,140,000,000	MXN	
SDS901	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
P17140	Cap	mar-22	Sell	A	MXN					40,000,000
P17141	Cap	mar-22	Buy	A	MXN					40,000,000
SDS915	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	140,000,000	MXN	140,000,000	MXN	
SDS928	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	140,000,000	MXN	140,000,000	MXN	
SDV515	SC Swap	mar-22	Buy	A	USD	2,700,000	USD	2,700,000	USD	
SDV810	SC Swap	mar-22	Buy	A	USD	2,700,000	USD	2,700,000	USD	
SDW028	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN	
SED855	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDS661	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS669	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS770	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	90,000,000	MXN	90,000,000	MXN	
SDS953	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	4,132,848	MXN	4,132,848	MXN	
SDS962	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	4,132,848	MXN	4,132,848	MXN	
SDV167	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV851	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV858	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	90,000,000	MXN	90,000,000	MXN	
SDV864	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV871	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW166	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SEE089	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDT167	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDU906	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	190,000,000	MXN	190,000,000	MXN	
SEV740	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	2,500,000,000	MXN	2,500,000,000	MXN	
SEV753	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SFE737	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	6,000,000,000	MXN	6,000,000,000	MXN	
SFE738	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	6,000,000,000	MXN	6,000,000,000	MXN	
SFE743	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	5,000,000,000	MXN	5,000,000,000	MXN	
SFE744	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	5,000,000,000	MXN	5,000,000,000	MXN	
C67425	CC Swap	mar-22	Buy	A	USD	451,345,802	MXN	22,086,900	USD	
C67426	CC Swap	mar-22	Buy	A	USD	22,086,900	USD	451,345,802	MXN	
SDV511	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDV535	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SGE555	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	197,500,000	MXN	197,500,000	MXN	
SGE557	SC Swap	mar-22	Buy	A	MXN	197,500,000	MXN	197,500,000	MXN	

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2075883	FX	25,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075885	FX	25,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075891	FX	25,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075893	FX	25,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077835	FX	25,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077837	FX	25,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077839	FX	25,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077840	FX	25,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077841	FX	25,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077851	FX	25,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077853	FX	25,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077855	FX	25,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077856	FX	25,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077857	FX	25,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079314	FX	500,000	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079315	FX	500,000	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079316	FX	52,045	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079318	FX	500,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079319	FX	500,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079320	FX	52,045	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079322	FX	500,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079323	FX	500,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079324	FX	52,045	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079338	FX	500,000	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079339	FX	500,000	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079340	FX	52,045	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079342	FX	500,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079343	FX	500,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079344	FX	52,045	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079346	FX	500,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079347	FX	500,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079348	FX	52,045	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080841	FX	100,000	25-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080843	FX	100,000	25-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080844	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080846	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080850	FX	100,000	25-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080852	FX	100,000	25-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080853	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080855	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081135	FX	400,000	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081139	FX	400,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081143	FX	400,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081144	FX	400,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081145	FX	23,107	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081151	FX	400,000	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081155	FX	400,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081159	FX	400,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081160	FX	400,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081161	FX	23,107	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082382	FX	100,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082406	FX	100,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082578	FX	100,000	11-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082582	FX	100,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082602	FX	100,000	11-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082606	FX	100,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082630	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082631	FX	50,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082632	FX	1,474	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082634	FX	50,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2082654	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082655	FX	50,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082656	FX	1,474	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082658	FX	50,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082678	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082682	FX	50,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082702	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082706	FX	50,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082734	FX	53,200	13-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082735	FX	53,200	13-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082737	FX	53,200	20-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082738	FX	53,200	20-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082740	FX	45,600	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082741	FX	45,600	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082761	FX	53,200	13-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082762	FX	53,200	13-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082764	FX	53,200	20-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082765	FX	53,200	20-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082767	FX	45,600	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082768	FX	45,600	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082782	FX	500,000	04-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082783	FX	500,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082785	FX	500,000	11-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082786	FX	500,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082788	FX	500,000	18-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082789	FX	500,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082791	FX	500,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082792	FX	500,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082794	FX	500,000	01-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082795	FX	500,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082803	FX	500,000	04-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082804	FX	500,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082806	FX	500,000	11-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082807	FX	500,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082809	FX	500,000	18-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082810	FX	500,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082812	FX	500,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082813	FX	500,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082815	FX	500,000	01-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082816	FX	500,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082962	FX	150,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082963	FX	150,000	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082964	FX	10,714	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082966	FX	150,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082967	FX	150,000	14-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082968	FX	10,714	14-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082970	FX	150,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082971	FX	150,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082972	FX	10,714	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082974	FX	150,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082975	FX	150,000	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082976	FX	10,714	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082978	FX	150,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082979	FX	150,000	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082980	FX	10,714	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082982	FX	150,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082983	FX	150,000	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082984	FX	10,714	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082986	FX	150,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082987	FX	150,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

DealNo	OTCtype	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2082988	FX	10,714	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082990	FX	150,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082991	FX	150,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082992	FX	10,714	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082993	FX	150,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082995	FX	150,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082996	FX	10,714	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083022	FX	150,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083023	FX	150,000	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083024	FX	10,714	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083026	FX	150,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083027	FX	150,000	14-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083028	FX	10,714	14-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083030	FX	150,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083031	FX	150,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083032	FX	10,714	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083034	FX	150,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083035	FX	150,000	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083036	FX	10,714	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083038	FX	150,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083039	FX	150,000	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083040	FX	10,714	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083042	FX	150,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083043	FX	150,000	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083044	FX	10,714	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083046	FX	150,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083047	FX	150,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083048	FX	10,714	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083050	FX	150,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083051	FX	150,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083052	FX	10,714	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083053	FX	150,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083055	FX	150,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083056	FX	10,714	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083062	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083063	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083064	FX	6,297	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083066	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083067	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083068	FX	6,297	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083070	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083071	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083072	FX	6,297	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083078	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083079	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083080	FX	6,297	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083082	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083083	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083084	FX	6,297	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083086	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083087	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083088	FX	6,297	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083102	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083103	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083104	FX	6,599	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083106	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083107	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083108	FX	6,599	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083110	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083111	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2083112	FX	6,599	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083126	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083127	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083128	FX	6,599	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083130	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083131	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083132	FX	6,599	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083134	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083135	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083136	FX	6,599	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083150	FX	50,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083151	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083152	FX	3,299	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083154	FX	50,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083155	FX	50,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083156	FX	3,299	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083158	FX	50,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083159	FX	50,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083160	FX	3,299	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083174	FX	50,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083175	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083176	FX	3,299	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083178	FX	50,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083179	FX	50,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083180	FX	3,299	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083182	FX	50,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083183	FX	50,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083184	FX	3,299	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083392	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083393	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083394	FX	4,106	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083396	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083397	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083398	FX	4,106	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083400	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083416	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083417	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083418	FX	4,106	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083420	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083421	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083422	FX	4,106	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083424	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083470	FX	50,000	13-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083471	FX	50,000	13-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083472	FX	1,732	13-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083474	FX	50,000	15-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083475	FX	50,000	15-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083476	FX	1,732	15-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083478	FX	50,000	15-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083494	FX	50,000	13-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083495	FX	50,000	13-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083496	FX	1,732	13-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083498	FX	50,000	15-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083499	FX	50,000	15-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083500	FX	1,732	15-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083502	FX	50,000	15-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083510	FX	150,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083514	FX	150,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083515	FX	150,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083516	FX	7,007	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2083518	FX	150,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083519	FX	150,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083520	FX	7,007	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083526	FX	150,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083530	FX	150,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083531	FX	150,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083532	FX	7,007	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083534	FX	150,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083535	FX	150,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083536	FX	7,007	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083610	FX	50,000	05-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083611	FX	50,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083612	FX	1,746	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083614	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083615	FX	50,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083616	FX	1,746	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083618	FX	50,000	19-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083619	FX	50,000	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083620	FX	1,746	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083622	FX	50,000	26-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083678	FX	50,000	05-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083679	FX	50,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083680	FX	1,746	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083682	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083683	FX	50,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083684	FX	1,746	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083686	FX	50,000	19-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083687	FX	50,000	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083688	FX	1,746	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083690	FX	50,000	26-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083733	FX	50,000	05-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083734	FX	50,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083736	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083737	FX	50,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083739	FX	50,000	19-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083740	FX	50,000	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083742	FX	50,000	26-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083743	FX	50,000	26-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083784	FX	50,000	05-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083785	FX	50,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083787	FX	50,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083788	FX	50,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083790	FX	50,000	19-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083791	FX	50,000	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083793	FX	50,000	26-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083794	FX	50,000	26-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083808	FX	100,000	11-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083809	FX	100,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083810	FX	4,126	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083812	FX	100,000	10-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083813	FX	100,000	10-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083814	FX	4,126	10-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083816	FX	100,000	10-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083832	FX	100,000	11-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083833	FX	100,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083834	FX	4,126	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083836	FX	100,000	10-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083837	FX	100,000	10-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083838	FX	4,126	10-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083840	FX	100,000	10-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

DealNo	OTCtype	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2083901	FX	100,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083904	FX	100,000	24-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083905	FX	100,000	24-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083916	FX	100,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083919	FX	100,000	24-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083920	FX	100,000	24-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083953	FX	250,000	13-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083954	FX	250,000	13-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083955	FX	250,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083956	FX	250,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083957	FX	250,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083958	FX	250,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083989	FX	250,000	13-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083990	FX	250,000	13-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083991	FX	250,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083992	FX	250,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083993	FX	250,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083994	FX	250,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083995	FX	500,000	24-mar-22	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED
2083996	FX	500,000	24-mar-22	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED
2084102	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084103	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084104	FX	5,528	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084106	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084107	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084108	FX	5,528	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084110	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084111	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084112	FX	5,528	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084126	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084127	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084128	FX	5,528	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084130	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084131	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084132	FX	5,528	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084134	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084135	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084136	FX	5,528	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084146	FX	100,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084147	FX	100,000	01-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084148	FX	7,035	01-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084150	FX	100,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084151	FX	100,000	01-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084152	FX	7,035	01-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084154	FX	100,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084155	FX	100,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084156	FX	7,035	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084170	FX	100,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084171	FX	100,000	01-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084172	FX	7,035	01-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084174	FX	100,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084175	FX	100,000	01-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084176	FX	7,035	01-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084178	FX	100,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084179	FX	100,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084180	FX	7,035	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084202	FX	200,000	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084203	FX	200,000	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084204	FX	11,285	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084206	FX	200,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2084207	FX	200,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084208	FX	11,285	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084250	FX	200,000	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084251	FX	200,000	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084252	FX	11,285	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084254	FX	200,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084255	FX	200,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084256	FX	11,285	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084258	FX	200,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084259	FX	200,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084260	FX	11,285	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084364	FX	100,000	06-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084365	FX	100,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084366	FX	3,934	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084368	FX	100,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084369	FX	100,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084370	FX	3,934	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084372	FX	100,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084388	FX	100,000	06-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084389	FX	100,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084390	FX	3,934	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084392	FX	100,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084393	FX	100,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084394	FX	3,934	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084396	FX	100,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084464	FX	250,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084465	FX	250,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084466	FX	11,244	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084468	FX	250,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084469	FX	250,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084470	FX	11,244	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084472	FX	250,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084473	FX	250,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084474	FX	11,244	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084492	FX	250,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084493	FX	250,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084494	FX	11,244	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084496	FX	250,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084497	FX	250,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084498	FX	11,244	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084500	FX	250,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084501	FX	250,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084502	FX	11,244	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084545	FX	250,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084546	FX	250,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084547	FX	250,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084548	FX	250,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084549	FX	250,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084550	FX	250,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084559	FX	250,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084560	FX	250,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084561	FX	250,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084562	FX	250,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084563	FX	250,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084564	FX	250,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084580	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084581	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084582	FX	5,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084584	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084585	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2084586	FX	5,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084588	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084589	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084590	FX	5,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084604	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084605	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084606	FX	5,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084608	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084609	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084610	FX	5,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084612	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084613	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084614	FX	5,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084628	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084629	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084630	FX	6,122	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084632	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084633	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084634	FX	6,122	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084635	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084637	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084638	FX	6,122	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084652	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084653	FX	100,000	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084654	FX	6,122	12-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084656	FX	100,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084657	FX	100,000	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084658	FX	6,122	11-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084659	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084661	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084662	FX	6,122	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084694	FX	100,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084695	FX	100,000	05-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084696	FX	100,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084697	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084699	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084700	FX	100,000	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084701	FX	100,000	19-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084702	FX	100,000	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084704	FX	100,000	26-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084705	FX	100,000	26-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084707	FX	100,000	02-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084708	FX	100,000	02-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084709	FX	100,000	09-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084710	FX	100,000	09-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084711	FX	100,000	09-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084712	FX	100,000	16-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084714	FX	100,000	16-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084715	FX	100,000	23-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084717	FX	100,000	23-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084719	FX	100,000	02-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084720	FX	100,000	02-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084722	FX	100,000	09-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084725	FX	100,000	16-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084726	FX	100,000	16-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084727	FX	100,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084729	FX	100,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084730	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084732	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084748	FX	100,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2084749	FX	100,000	05-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084750	FX	100,000	05-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084751	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084753	FX	100,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084754	FX	100,000	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084755	FX	100,000	19-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084756	FX	100,000	19-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084758	FX	100,000	26-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084759	FX	100,000	26-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084761	FX	100,000	02-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084762	FX	100,000	02-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084763	FX	100,000	09-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084764	FX	100,000	09-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084765	FX	100,000	09-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084766	FX	100,000	16-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084768	FX	100,000	16-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084769	FX	100,000	23-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084771	FX	100,000	23-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084773	FX	100,000	02-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084774	FX	100,000	02-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084776	FX	100,000	09-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084779	FX	100,000	16-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084780	FX	100,000	16-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084781	FX	100,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084783	FX	100,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084784	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084786	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084794	FX	50,000	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084795	FX	50,000	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084797	FX	50,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084798	FX	50,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084799	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084801	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084812	FX	50,000	27-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084813	FX	50,000	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084815	FX	50,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084816	FX	50,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084817	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084819	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084833	FX	50,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084834	FX	50,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084835	FX	2,369	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084837	FX	50,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084838	FX	50,000	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084839	FX	2,369	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084841	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084857	FX	50,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084858	FX	50,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084859	FX	2,369	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084861	FX	50,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084862	FX	50,000	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084863	FX	2,369	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084865	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084881	FX	50,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084882	FX	50,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084883	FX	1,961	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084885	FX	50,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084889	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084905	FX	50,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084906	FX	50,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

DealNo	OTCtype	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2084907	FX	1,961	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084909	FX	50,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084913	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084935	FX	500,000	26-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084937	FX	500,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084939	FX	500,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084953	FX	50,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084954	FX	50,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084955	FX	4,523	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084957	FX	50,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084958	FX	50,000	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084959	FX	4,523	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084961	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084962	FX	50,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084963	FX	4,523	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085001	FX	50,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085002	FX	50,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085003	FX	4,523	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085005	FX	50,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085006	FX	50,000	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085007	FX	4,523	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085009	FX	50,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085010	FX	50,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085011	FX	4,523	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085049	FX	100,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085050	FX	100,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085051	FX	8,535	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085053	FX	100,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085054	FX	100,000	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085055	FX	8,535	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085057	FX	100,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085097	FX	100,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085098	FX	100,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085099	FX	8,535	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085101	FX	100,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085102	FX	100,000	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085103	FX	8,535	22-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085105	FX	100,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085144	FX	300,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085145	FX	300,000	04-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085147	FX	300,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085148	FX	300,000	11-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085150	FX	300,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085151	FX	300,000	18-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085153	FX	300,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085154	FX	300,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085156	FX	300,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085157	FX	300,000	01-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085162	FX	300,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085163	FX	300,000	04-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085165	FX	300,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085166	FX	300,000	11-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085168	FX	300,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085169	FX	300,000	18-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085171	FX	300,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085172	FX	300,000	25-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085174	FX	300,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085175	FX	300,000	01-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085177	FX	200,000	03-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085178	FX	200,000	03-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2085180	FX	200,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085181	FX	200,000	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085183	FX	200,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085186	FX	200,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085187	FX	200,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085189	FX	200,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085190	FX	200,000	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085192	FX	200,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085193	FX	200,000	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085195	FX	200,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085196	FX	200,000	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085198	FX	200,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085201	FX	200,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085202	FX	200,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085204	FX	200,000	03-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085205	FX	200,000	03-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085207	FX	200,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085208	FX	200,000	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085210	FX	200,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085213	FX	200,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085214	FX	200,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085216	FX	200,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085217	FX	200,000	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085219	FX	200,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085220	FX	200,000	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085222	FX	200,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085223	FX	200,000	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085225	FX	200,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085228	FX	200,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085229	FX	200,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085231	FX	150,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085232	FX	150,000	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085233	FX	15,000	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085235	FX	150,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085236	FX	150,000	14-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085237	FX	15,000	14-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085239	FX	150,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085240	FX	150,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085241	FX	15,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085243	FX	150,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085244	FX	150,000	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085245	FX	15,000	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085247	FX	150,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085248	FX	150,000	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085249	FX	15,000	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085251	FX	150,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085252	FX	150,000	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085253	FX	15,000	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085255	FX	150,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085256	FX	150,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085257	FX	15,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085259	FX	150,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085260	FX	150,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085261	FX	15,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085263	FX	150,000	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085264	FX	150,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085265	FX	15,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085267	FX	150,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085268	FX	150,000	14-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085269	FX	15,000	14-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2085271	FX	150,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085272	FX	150,000	18-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085273	FX	15,000	18-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085275	FX	150,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085276	FX	150,000	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085277	FX	15,000	10-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085279	FX	150,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085280	FX	150,000	14-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085281	FX	15,000	14-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085283	FX	150,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085284	FX	150,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085285	FX	15,000	24-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085287	FX	150,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085288	FX	150,000	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085289	FX	15,000	31-ene-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085291	FX	150,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085292	FX	150,000	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085293	FX	15,000	04-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085295	FX	150,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085296	FX	150,000	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085297	FX	15,000	14-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085299	FX	150,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085300	FX	150,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085301	FX	15,000	18-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085303	FX	150,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085304	FX	150,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085305	FX	15,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085307	FX	150,000	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085308	FX	150,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085309	FX	15,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085311	FX	150,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085312	FX	150,000	14-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085313	FX	15,000	14-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085315	FX	150,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085316	FX	150,000	18-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085317	FX	15,000	18-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085321	FX	250,000	26-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085323	FX	250,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085325	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085342	FX	200,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085344	FX	200,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085345	FX	4,575	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085346	FX	200,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085348	FX	200,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085349	FX	4,575	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085358	FX	200,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085360	FX	200,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085361	FX	4,575	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085362	FX	200,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085364	FX	200,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085365	FX	4,575	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085366	FX	250,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085368	FX	250,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085369	FX	11,338	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085370	FX	250,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085372	FX	250,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085373	FX	11,338	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085374	FX	250,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085376	FX	250,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085377	FX	11,338	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2085378	FX	250,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085380	FX	250,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085381	FX	11,338	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085382	FX	250,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085384	FX	250,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085385	FX	11,338	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085386	FX	250,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085388	FX	250,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085389	FX	11,338	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085390	FX	250,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085392	FX	250,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085393	FX	11,338	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085394	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085396	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085397	FX	11,338	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085399	FX	250,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085400	FX	250,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085401	FX	11,338	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085402	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085404	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085405	FX	11,338	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085406	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085408	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085409	FX	11,338	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085410	FX	250,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085412	FX	250,000	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085413	FX	11,338	04-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085414	FX	250,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085416	FX	250,000	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085417	FX	11,338	11-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085418	FX	250,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085420	FX	250,000	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085421	FX	11,338	18-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085422	FX	250,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085424	FX	250,000	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085425	FX	11,338	25-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085426	FX	250,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085428	FX	250,000	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085429	FX	11,338	01-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085430	FX	250,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085432	FX	250,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085433	FX	11,338	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085434	FX	250,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085436	FX	250,000	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085437	FX	11,338	22-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085438	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085440	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085441	FX	11,338	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085443	FX	250,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085444	FX	250,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085445	FX	11,338	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085446	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085448	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085449	FX	11,338	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085450	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085452	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085453	FX	11,338	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085565	FX	50,000	03-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085567	FX	50,000	03-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085568	FX	50,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2085570	FX	50,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085571	FX	50,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085573	FX	50,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085574	FX	50,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085576	FX	50,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085577	FX	50,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085579	FX	50,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085580	FX	50,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085582	FX	50,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085583	FX	50,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085585	FX	50,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085586	FX	50,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085588	FX	50,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085589	FX	50,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085591	FX	50,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085592	FX	50,000	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085593	FX	50,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085594	FX	50,000	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085595	FX	50,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085597	FX	50,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085598	FX	50,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085600	FX	50,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085601	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085603	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085616	FX	50,000	03-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085618	FX	50,000	03-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085619	FX	50,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085621	FX	50,000	10-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085622	FX	50,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085624	FX	50,000	14-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085625	FX	50,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085627	FX	50,000	24-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085628	FX	50,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085630	FX	50,000	31-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085631	FX	50,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085633	FX	50,000	04-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085634	FX	50,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085636	FX	50,000	14-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085637	FX	50,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085639	FX	50,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085640	FX	50,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085642	FX	50,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085643	FX	50,000	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085644	FX	50,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085645	FX	50,000	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085646	FX	50,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085648	FX	50,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085649	FX	50,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085651	FX	50,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085652	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085654	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085794	FX	125,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085796	FX	125,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085797	FX	125,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085799	FX	125,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085800	FX	125,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085801	FX	125,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085802	FX	125,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085848	FX	125,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085850	FX	125,000	12-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2085851	FX	125,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085853	FX	125,000	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085854	FX	125,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085855	FX	125,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085856	FX	125,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085884	FX	2,000,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085886	FX	2,000,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085887	FX	2,000,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085889	FX	2,000,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085891	FX	2,000,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085892	FX	2,000,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085893	FX	2,000,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085895	FX	2,000,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085896	FX	2,000,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085898	FX	2,000,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085900	FX	2,000,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085901	FX	2,000,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085902	FX	1,000,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085904	FX	1,000,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085905	FX	1,000,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085906	FX	1,000,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085907	FX	1,000,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085909	FX	1,000,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085910	FX	1,000,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085911	FX	1,000,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085913	FX	1,000,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085914	FX	1,000,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085915	FX	1,000,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085916	FX	1,000,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085918	FX	1,000,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085919	FX	1,000,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085920	FX	500,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085922	FX	500,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085923	FX	500,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085924	FX	500,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085925	FX	500,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085927	FX	500,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085928	FX	500,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085947	FX	500,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085949	FX	500,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085950	FX	500,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085951	FX	500,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085952	FX	500,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085954	FX	500,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085955	FX	500,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085959	FX	50,000	03-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085960	FX	50,000	03-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085961	FX	50,000	03-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085962	FX	50,000	03-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085963	FX	50,000	03-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085964	FX	50,000	03-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085968	FX	50,000	03-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085969	FX	50,000	03-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085970	FX	50,000	03-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085971	FX	50,000	03-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085972	FX	50,000	03-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085973	FX	50,000	03-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085974	FX	500,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085976	FX	500,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085977	FX	500,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2085979	FX	500,000	06-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085982	FX	109,000,000	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085983	FX	109,000,000	27-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085985	FX	500,000	26-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085987	FX	250,000	26-ene-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085988	FX	500,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085989	FX	500,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085990	FX	500,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085992	FX	500,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085993	FX	500,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085994	FX	500,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085995	FX	500,000	08-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085996	FX	500,000	08-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085998	FX	500,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085999	FX	500,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086001	FX	100,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086002	FX	100,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086003	FX	3,563	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086004	FX	100,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086006	FX	100,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086007	FX	3,563	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086025	FX	100,000	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086026	FX	100,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086027	FX	3,563	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086028	FX	100,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086030	FX	100,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086031	FX	3,563	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086062	FX	35,000	31-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086079	FX	35,000	31-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086088	FX	100,000	25-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086090	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086096	FX	100,000	25-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086098	FX	100,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086104	FX	23,065	10-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086106	FX	23,065	10-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086107	FX	10,920	17-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086109	FX	10,920	17-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086111	FX	32,728	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086112	FX	32,728	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086114	FX	104,160	03-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086115	FX	104,160	03-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086117	FX	93,240	10-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086118	FX	93,240	10-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086120	FX	58,800	17-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086121	FX	58,800	17-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086122	FX	23,065	10-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086124	FX	23,065	10-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086125	FX	10,920	17-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086127	FX	10,920	17-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086129	FX	32,728	24-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086130	FX	32,728	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086132	FX	104,160	03-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086133	FX	104,160	03-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086135	FX	93,240	10-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086136	FX	93,240	10-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086138	FX	58,800	17-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086139	FX	58,800	17-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086168	FX	200,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086169	FX	200,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086170	FX	6,280	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2086192	FX	200,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086193	FX	200,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086194	FX	6,280	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086296	FX	200,000	23-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086297	FX	200,000	23-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086298	FX	10,949	23-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086299	FX	200,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086300	FX	200,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086301	FX	10,949	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086323	FX	200,000	23-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086324	FX	200,000	23-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086325	FX	10,949	23-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086326	FX	200,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086327	FX	200,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086328	FX	10,949	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086391	FX	444,840	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086392	FX	550,440	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086413	FX	444,840	11-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086414	FX	550,440	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086440	FX	200,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086442	FX	200,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086443	FX	7,230	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086448	FX	200,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086450	FX	200,000	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086451	FX	7,230	30-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086512	FX	50,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086514	FX	50,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086515	FX	1,582	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086516	FX	50,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086518	FX	50,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086519	FX	1,582	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086521	FX	50,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086525	FX	50,000	14-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086526	FX	50,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086527	FX	1,582	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086528	FX	50,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086530	FX	50,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086531	FX	1,582	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086532	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086534	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086535	FX	1,582	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086568	FX	50,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086570	FX	50,000	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086571	FX	1,582	18-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086572	FX	50,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086574	FX	50,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086575	FX	1,582	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086577	FX	50,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086581	FX	50,000	14-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086582	FX	50,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086583	FX	1,582	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086584	FX	50,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086586	FX	50,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086587	FX	1,582	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086588	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086590	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086591	FX	1,582	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086625	FX	50,000	15-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086626	FX	50,000	15-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086627	FX	2,183	15-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2086665	FX	50,000	15-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086666	FX	50,000	15-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086667	FX	2,183	15-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086704	FX	250,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086706	FX	500,000	24-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086708	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086710	FX	500,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086713	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086714	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086715	FX	3,190	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086737	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086738	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086739	FX	3,190	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086761	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086762	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086763	FX	3,095	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086785	FX	100,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086786	FX	100,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086787	FX	3,095	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086808	FX	200,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086810	FX	200,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086811	FX	8,920	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086848	FX	200,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086850	FX	200,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086851	FX	8,920	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087008	FX	50,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087010	FX	50,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087011	FX	2,230	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087048	FX	50,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087050	FX	50,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087051	FX	2,230	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087094	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087095	FX	250,000	01-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087096	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087098	FX	250,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087099	FX	250,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087101	FX	250,000	15-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087102	FX	250,000	15-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087103	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087105	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087106	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087108	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087148	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087149	FX	250,000	01-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087150	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087152	FX	250,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087153	FX	250,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087155	FX	250,000	15-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087156	FX	250,000	15-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087157	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087159	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087160	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087162	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087307	FX	50,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087308	FX	50,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087309	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087311	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087337	FX	50,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087338	FX	50,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087339	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2087341	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087367	FX	50,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087368	FX	50,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087369	FX	1,429	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087370	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087372	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087373	FX	1,429	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087407	FX	50,000	11-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087408	FX	50,000	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087409	FX	1,429	11-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087410	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087412	FX	50,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087413	FX	1,429	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087446	FX	800,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087448	FX	800,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087449	FX	39,437	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087486	FX	800,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087488	FX	800,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087489	FX	39,437	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087562	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087563	FX	250,000	01-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087564	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087566	FX	250,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087567	FX	250,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087569	FX	250,000	15-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087570	FX	250,000	15-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087571	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087572	FX	250,000	22-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087573	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087574	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087576	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087616	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087617	FX	250,000	01-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087618	FX	250,000	01-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087620	FX	250,000	08-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087621	FX	250,000	08-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087623	FX	250,000	15-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087624	FX	250,000	15-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087625	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087626	FX	250,000	22-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087627	FX	250,000	22-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087628	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087630	FX	250,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087902	FX	250,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087903	FX	250,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087904	FX	10,952	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087934	FX	250,000	23-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087935	FX	250,000	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087936	FX	10,952	23-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088044	FX	236,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088045	FX	236,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088046	FX	10,551	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088048	FX	236,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088049	FX	236,000	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088050	FX	10,551	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088052	FX	236,000	14-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088053	FX	236,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088054	FX	10,551	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088056	FX	236,000	18-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088057	FX	236,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2088058	FX	10,551	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088059	FX	236,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088061	FX	236,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088062	FX	10,551	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088092	FX	23,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088093	FX	23,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088094	FX	1,028	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088096	FX	23,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088097	FX	23,000	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088098	FX	1,028	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088100	FX	23,000	14-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088101	FX	23,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088102	FX	1,028	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088104	FX	23,000	18-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088105	FX	23,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088106	FX	1,028	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088107	FX	23,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088109	FX	23,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088110	FX	1,028	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088140	FX	259,000	28-feb-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088141	FX	259,000	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088142	FX	11,579	28-feb-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088144	FX	259,000	07-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088145	FX	259,000	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088146	FX	11,579	07-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088148	FX	259,000	14-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088149	FX	259,000	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088150	FX	11,579	14-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088152	FX	259,000	18-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088153	FX	259,000	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088154	FX	11,579	18-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088155	FX	259,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088157	FX	259,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088158	FX	11,579	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088262	FX	250,000	31-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088268	FX	250,000	31-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088641	FX	50,000	24-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088643	FX	50,000	24-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088644	FX	50,000	31-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088646	FX	50,000	31-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088686	FX	50,000	24-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088688	FX	50,000	24-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088689	FX	50,000	31-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088691	FX	50,000	31-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088855	FX	500,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088857	FX	500,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088858	FX	24,471	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088903	FX	236,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088905	FX	236,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088906	FX	11,550	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088951	FX	23,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088953	FX	23,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088954	FX	1,126	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088999	FX	759,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089001	FX	759,000	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089002	FX	37,146	28-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090025	FX	200,000	29-mar-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090026	FX	200,000	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090027	FX	11,285	29-mar-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022010303230	B	USDMXN	01/02/2022	4,115,000	20.66	(85,003,193)
2022010303341	B	USDMXN	01/02/2022	589,750	20.62	(12,158,497)
2022010403056	B	USDMXN	01/02/2022	589,750	20.59	(12,145,267)
2022010503220	B	USDMXN	01/02/2022	589,750	20.50	(12,091,763)
2022010703170	B	USDMXN	01/02/2022	589,750	20.53	(12,104,686)
2022010703400	BO	USDMXN	01/02/2022	12,500	20.42	(255,306)
2022010703466	S	USDMXN	01/02/2022	(12,500)	20.42	255,298
2022011103215	B	USDMXN	01/02/2022	589,750	20.43	(12,045,982)
2022011203253	B	USDMXN	01/02/2022	589,750	20.40	(12,030,688)
2022011303023	B	USDMXN	01/02/2022	589,750	20.38	(12,021,342)
2022011403465	B	USDMXN	01/02/2022	100,000	20.38	(2,038,496)
2022012703292	B	USDMXN	01/02/2022	3,500,000	20.74	(72,572,500)
2022020203047	B	USDMXN	01/03/2022	657,225	20.65	(13,572,112)
2022020203174	B	USDMXN	01/03/2022	657,225	20.68	(13,591,016)
2022020803037	B	USDMXN	01/03/2022	657,225	20.69	(13,599,071)
2022020903104	BO	USDMXN	01/03/2022	657,000	20.61	(13,541,460)
2022020903181	B	USDMXN	01/03/2022	657,225	20.55	(13,504,420)
2022020903186	BO	USDMXN	01/03/2022	225	20.55	(4,624)
2022021003241	B	USDMXN	01/03/2022	657,225	20.47	(13,452,094)
2022021003383	BO	USDMXN	01/03/2022	19,500	20.55	(400,738)
2022021103029	B	USDMXN	01/03/2022	657,225	20.48	(13,459,952)
20220212103506	BO	USDMXN	01/03/2022	2,400,000	20.57	(49,362,932)
20220212803764	BO	USDMXN	01/03/2022	2,000,000	20.90	(41,802,701)
2022021403299	BO	USDMXN	01/03/2022	657,000	20.45	(13,435,838)
2022021503266	B	USDMXN	01/03/2022	657,450	20.42	(13,427,349)
2022011303223	B	USDMXN	02/02/2022	500,000	20.41	(10,203,114)
20220212103632	SO	USDMXN	02/02/2022	(200,000)	20.48	4,095,977
2022011303232	B	USDMXN	02/03/2022	500,000	20.51	(10,252,622)
20220212703677	BO	USDMXN	02/03/2022	56,300	20.90	(1,176,842)
2022013103306	BO	USDMXN	02/03/2022	23,950	20.76	(497,129)
2022013103480	BO	USDMXN	02/03/2022	300,000	20.88	(6,262,601)
2022021703120	BO	USDMXN	02/03/2022	45,000	20.32	(914,430)
2022021803375	B	USDMXN	02/03/2022	259,000	20.31	(5,261,523)
2022010303056	B	USDMXN	03/02/2022	30,000	20.66	(619,883)
2022010503225	BO	USDMXN	03/02/2022	18,512	20.55	(380,373)
2022010603396	B	USDMXN	03/02/2022	30,000	20.59	(617,702)
2022010703467	B	USDMXN	03/02/2022	12,500	20.43	(255,417)
2022011203216	B	USDMXN	03/02/2022	50,000	20.42	(1,020,947)
2022011303264	B	USDMXN	03/02/2022	30,000	20.41	(612,313)
2022011403133	B	USDMXN	03/02/2022	30,000	20.36	(610,797)
2022011703308	B	USDMXN	03/02/2022	30,000	20.35	(610,516)
2022011703461	B	USDMXN	03/02/2022	30,000	20.34	(610,208)
2022012003209	S	USDMXN	03/02/2022	(60,000)	20.46	1,227,555
2022012703133	B	USDMXN	03/02/2022	923,918	20.77	(19,187,854)
2022020203113	B	USDMXN	03/03/2022	30,000	20.71	(621,184)
2022020303162	BO	USDMXN	03/03/2022	57,510	20.61	(1,185,374)
2022010503228	BO	USDMXN	03/03/2022	1,032	20.65	(21,311)
2022010503229	BO	USDMXN	03/03/2022	11,072	20.62	(228,300)
2022010603404	B	USDMXN	03/03/2022	30,000	20.69	(620,712)
2022020903169	BO	USDMXN	03/03/2022	6,300	20.56	(129,532)
2022020903436	B	USDMXN	03/03/2022	30,000	20.55	(616,594)
2022021003163	B	USDMXN	03/03/2022	100,000	20.46	(2,045,955)
2022021003335	BO	USDMXN	03/03/2022	61,000	20.53	(1,252,589)
2022011303272	B	USDMXN	03/03/2022	30,000	20.52	(615,472)
2022011403142	B	USDMXN	03/03/2022	30,000	20.47	(614,042)
2022011703317	B	USDMXN	03/03/2022	30,000	20.45	(613,537)
2022012703141	B	USDMXN	03/03/2022	773,092	20.87	(16,132,761)
2022021503319	B	USDMXN	03/03/2022	30,000	20.42	(612,619)
2022021603278	B	USDMXN	03/03/2022	90,000	20.35	(1,831,820)
2022021603476	BO	USDMXN	03/03/2022	30,000	20.35	(610,419)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022022203420	S	USDMXN	03/03/2022	(160,000)	20.32	3,250,951
2022022403113	SO	USDMXN	03/03/2022	(60,000)	20.64	1,238,214
2022022403420	SO	USDMXN	03/03/2022	(500,000)	20.73	10,365,992
2022010303088	B	USDMXN	04/02/2022	750,000	20.66	(15,495,209)
2022010403308	S	USDMXN	04/02/2022	(400,000)	20.65	8,259,293
2022010503467	S	USDMXN	04/02/2022	(600,000)	20.66	12,398,325
2022011403147	B	USDMXN	04/02/2022	50,000	20.37	(1,018,555)
2022011903308	SO	USDMXN	04/02/2022	(200,000)	20.49	4,098,070
2022012003213	S	USDMXN	04/02/2022	(394,000)	20.46	8,062,174
2022012103642	S	EURMXN	04/02/2022	(285,680)	23.25	6,642,659
2022012103631	SO	USDMXN	04/02/2022	(150,000)	20.49	3,072,908
2022010303099	B	USDMXN	04/03/2022	300,000	20.77	(6,229,969)
2022011203115	B	USDMXN	04/03/2022	250,000	20.55	(5,137,818)
2022011403488	B	USDMXN	04/03/2022	65,000	20.50	(1,332,199)
2022012803056	SO	USDMXN	04/03/2022	(100,000)	20.91	2,090,537
2022021603049	BO	USDMXN	04/03/2022	50,000	20.40	(1,020,169)
2022021603199	BO	USDMXN	04/03/2022	100,000	20.37	(2,036,662)
2022022403114	SO	USDMXN	04/03/2022	(180,000)	20.64	3,714,932
2022010703295	BO	USDMXN	07/03/2022	70,000	20.60	(1,441,835)
2022021603500	BO	USDMXN	07/03/2022	300,000	20.32	(6,096,533)
2022022403115	SO	USDMXN	07/03/2022	(386,000)	20.66	7,972,846
2022020303435	S	EURMXN	08/02/2022	(750,000)	23.52	17,643,000
2022020303043	B	USDMXN	08/02/2022	100,000	20.60	(2,059,780)
2022010503470	S	USDMXN	08/02/2022	(400,000)	20.68	8,271,409
2022011103311	S	USDMXN	08/02/2022	(600,000)	20.49	12,295,056
2022011703240	BO	USDMXN	08/02/2022	50,000	20.36	(1,018,148)
2022012003217	S	USDMXN	08/02/2022	(164,000)	20.48	3,357,971
2022012503015	SO	USDMXN	08/02/2022	(446,000)	20.71	9,237,170
2022020303436	B	EURMXN	08/03/2022	750,000	23.65	(17,734,833)
2022021003564	BO	USDMXN	08/03/2022	2,000,000	20.64	(41,276,704)
2022021003565	BO	USDMXN	08/03/2022	500,000	20.64	(10,319,519)
2022021003574	BO	USDMXN	08/03/2022	2,500,000	20.64	(51,599,693)
2022013103427	B	USDMXN	08/03/2022	100,000	20.71	(2,071,268)
2022021603186	BO	USDMXN	08/03/2022	70,000	20.38	(1,426,539)
2022022403116	SO	USDMXN	08/03/2022	(122,350)	20.66	2,527,803
2022020403156	B	USDMXN	09/02/2022	150,000	20.77	(3,115,470)
2022020403011	S	USDMXN	09/02/2022	(168,364)	20.66	3,478,114
2022020403014	S	USDMXN	09/02/2022	(246,137)	20.66	5,083,960
2022020403016	S	USDMXN	09/02/2022	(256,296)	20.65	5,293,281
2022020403018	S	USDMXN	09/02/2022	(257,979)	20.65	5,327,937
2022020403020	S	USDMXN	09/02/2022	(260,473)	20.66	5,381,789
2022020403023	S	USDMXN	09/02/2022	(261,825)	20.66	5,410,299
2022020403025	S	USDMXN	09/02/2022	(220,008)	20.66	4,546,179
2022020403027	S	USDMXN	09/02/2022	(200,222)	20.66	4,136,707
2022020403029	S	USDMXN	09/02/2022	(245,373)	20.66	5,068,302
2022020403031	S	USDMXN	09/02/2022	(265,926)	20.66	5,493,526
2022020403034	S	USDMXN	09/02/2022	(82,530)	20.66	1,704,996
2022020403036	S	USDMXN	09/02/2022	(251,141)	20.66	5,187,569
2022020403038	S	USDMXN	09/02/2022	(253,764)	20.65	5,240,886
2022010703257	BO	USDMXN	09/02/2022	23,250	20.51	(476,778)
2022011003268	BO	USDMXN	09/02/2022	29,200	20.48	(597,880)
2022011303226	B	USDMXN	09/02/2022	500,000	20.43	(10,214,540)
2022020803434	BO	USDMXN	09/03/2022	51,000	20.71	(1,056,231)
2022011303234	B	USDMXN	09/03/2022	500,000	20.53	(10,265,933)
2022021703121	BO	USDMXN	09/03/2022	45,000	20.34	(915,484)
2022021803377	B	USDMXN	09/03/2022	259,000	20.34	(5,267,683)
2022022303046	B	USDMXN	09/03/2022	1,800,000	20.23	(36,415,532)
2022020203110	BO	USDMXN	10/02/2022	12,172	20.63	(251,091)
2022010303058	B	USDMXN	10/02/2022	30,000	20.69	(620,656)
2022010503226	BO	USDMXN	10/02/2022	18,512	20.57	(380,836)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022010503293	B	USDMXN	10/02/2022	210,000	20.50	(4,303,995)
2022010603398	B	USDMXN	10/02/2022	30,000	20.61	(618,431)
2022011303266	B	USDMXN	10/02/2022	30,000	20.44	(613,090)
2022011403135	B	USDMXN	10/02/2022	30,000	20.38	(611,511)
2022011403467	B	USDMXN	10/02/2022	210,000	20.42	(4,287,217)
2022011703311	B	USDMXN	10/02/2022	30,000	20.37	(611,231)
2022011703465	B	USDMXN	10/02/2022	60,000	20.36	(1,221,784)
2022012503017	SO	USDMXN	10/02/2022	(61,000)	20.72	1,263,734
2022012703135	B	USDMXN	10/02/2022	923,918	20.79	(19,208,963)
2022020203115	B	USDMXN	10/03/2022	30,000	20.73	(622,034)
2022020203220	B	USDMXN	10/03/2022	210,000	20.70	(4,347,583)
2022010503297	B	USDMXN	10/03/2022	210,000	20.60	(4,325,977)
2022030703566	S	USDMXN	10/03/2022	(300,000)	21.36	6,407,957
2022020903438	B	USDMXN	10/03/2022	30,000	20.58	(617,351)
2022011303274	B	USDMXN	10/03/2022	30,000	20.54	(616,256)
2022011403472	B	USDMXN	10/03/2022	210,000	20.52	(4,308,533)
2022011703319	B	USDMXN	10/03/2022	30,000	20.48	(614,358)
2022012703143	B	USDMXN	10/03/2022	773,092	20.90	(16,153,873)
2022021603280	B	USDMXN	10/03/2022	90,000	20.38	(1,834,076)
2022021603477	BO	USDMXN	10/03/2022	30,000	20.37	(611,172)
2022021703164	BO	USDMXN	10/03/2022	50,000	20.36	(1,017,835)
2022022203111	B	USDMXN	10/03/2022	60,000	20.37	(1,221,975)
2022010303090	B	USDMXN	11/02/2022	250,000	20.68	(5,170,604)
2022010403197	B	USDMXN	11/02/2022	32,183	20.64	(664,112)
2022010603052	S	USDMXN	11/02/2022	(3,500,000)	20.61	72,148,731
2022011903506	SO	USDMXN	11/02/2022	(200,000)	20.59	4,118,504
2022012403102	SO	USDMXN	11/02/2022	(25,000)	20.65	516,189
2022012603043	SO	USDMXN	11/02/2022	(50,000)	20.70	1,035,134
2022012603324	SO	USDMXN	11/02/2022	(280,000)	20.67	5,786,493
2022021103485	BO	USDMXN	11/03/2022	200,000	20.58	(4,115,430)
2022011203120	B	USDMXN	11/03/2022	250,000	20.57	(5,142,292)
2022011403492	B	USDMXN	11/03/2022	130,000	20.52	(2,667,754)
2022012803691	SO	USDMXN	11/03/2022	(150,000)	20.99	3,147,894
2022021603155	BO	USDMXN	11/03/2022	1,000,000	20.39	(20,388,819)
2022021603200	BO	USDMXN	11/03/2022	100,000	20.39	(2,039,248)
2022022203408	BO	USDMXN	11/03/2022	30,000	20.35	(610,472)
2022022403117	SO	USDMXN	11/03/2022	(133,000)	20.67	2,749,039
2022010303050	B	USDMXN	13/01/2022	15,000	20.60	(308,961)
2022010503381	BO	USDMXN	13/01/2022	6,390	20.50	(130,982)
2022010503344	BO	USDMXN	18/01/2022	77,600	20.44	(1,586,282)
2022011303022	S	USDMXN	18/01/2022	(589,750)	20.34	11,994,630
2022011303149	S	USDMXN	18/01/2022	(140,000)	20.35	2,849,574
2022011303151	S	USDMXN	18/01/2022	(300,000)	20.35	6,105,960
2022011303158	S	USDMXN	18/01/2022	(2,399,463)	20.35	48,818,985
2022011303220	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,178,800
2022011303222	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,178,950
2022011303225	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,178,400
2022011303227	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,178,450
2022011303229	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,178,850
2022011303231	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,178,700
2022011303233	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,178,850
2022011303235	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,179,300
2022011303240	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,180,250
2022011303242	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,180,850
2022011303244	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,180,750
2022011303247	S	USDMXN	18/01/2022	(500,000)	20.36	10,180,650
2022011303263	S	USDMXN	18/01/2022	(30,000)	20.36	610,743
2022011303265	S	USDMXN	18/01/2022	(30,000)	20.36	610,803
2022011303267	S	USDMXN	18/01/2022	(30,000)	20.36	610,830
2022011303269	S	USDMXN	18/01/2022	(30,000)	20.36	610,908

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022011303271	S	USDMXN	18/01/2022	(30,000)	20.36	610,884
2022011303273	S	USDMXN	18/01/2022	(30,000)	20.36	610,878
2022011303569	S	USDMXN	18/01/2022	(5,066,364)	20.33	102,993,363
2022011403132	S	USDMXN	19/01/2022	(30,000)	20.31	609,333
2022011403134	S	USDMXN	19/01/2022	(30,000)	20.31	609,333
2022011403137	S	USDMXN	19/01/2022	(30,000)	20.31	609,336
2022011403139	S	USDMXN	19/01/2022	(30,000)	20.32	609,465
2022011403141	S	USDMXN	19/01/2022	(30,000)	20.32	609,549
2022011403146	S	USDMXN	19/01/2022	(50,000)	20.32	1,015,945
2022011403461	S	USDMXN	19/01/2022	(100,000)	20.34	2,034,280
2022011403464	S	USDMXN	19/01/2022	(100,000)	20.34	2,034,270
2022011403466	S	USDMXN	19/01/2022	(210,000)	20.34	4,271,904
2022011403469	S	USDMXN	19/01/2022	(210,000)	20.34	4,271,295
2022011403471	S	USDMXN	19/01/2022	(210,000)	20.34	4,271,570
2022011403474	S	USDMXN	19/01/2022	(210,000)	20.34	4,271,602
2022011403477	S	USDMXN	19/01/2022	(210,000)	20.34	4,271,711
2022011403481	S	USDMXN	19/01/2022	(100,000)	20.34	2,034,190
2022011403487	S	USDMXN	19/01/2022	(65,000)	20.34	1,322,214
2022011403491	S	USDMXN	19/01/2022	(130,000)	20.34	2,644,387
2022011403495	S	USDMXN	19/01/2022	(130,000)	20.34	2,644,396
2022011403497	S	USDMXN	19/01/2022	(65,000)	20.34	1,322,179
2022010303052	B	USDMXN	20/01/2022	15,000	20.61	(309,179)
2022010503221	BO	USDMXN	20/01/2022	31,328	20.50	(642,172)
2022010303084	B	USDMXN	21/01/2022	300,000	20.62	(6,184,869)
2022011303150	B	USDMXN	21/01/2022	140,000	20.36	(2,850,904)
2022011403006	SO	USDMXN	21/01/2022	(200,000)	20.31	4,061,487
2022011703480	SO	USDMXN	24/01/2022	(200,000)	20.31	4,061,963
2022011403462	B	USDMXN	25/01/2022	100,000	20.36	(2,036,190)
2022011703481	SO	USDMXN	25/01/2022	(200,000)	20.31	4,062,500
2022011303152	B	USDMXN	26/01/2022	300,000	20.38	(6,113,645)
2022011303221	B	USDMXN	26/01/2022	500,000	20.38	(10,191,410)
2022010303054	B	USDMXN	27/01/2022	15,000	20.64	(309,574)
2022010503222	BO	USDMXN	27/01/2022	50,000	20.45	(1,022,415)
2022010503224	BO	USDMXN	27/01/2022	18,512	20.52	(379,917)
2022011303296	BO	USDMXN	27/01/2022	200,000	20.38	(4,076,907)
2022011703232	B	USDMXN	27/01/2022	100,000	20.32	(2,031,758)
2022011803216	B	USDMXN	27/01/2022	250,000,000	20.40	(5,099,875,000)
2022011803218	S	USDMXN	27/01/2022	(250,000,000)	20.40	5,099,875,000
2022010703345	BO	USDMXN	28/01/2022	1,350,000	20.43	(27,587,015)
2022011103411	B	USDMXN	28/01/2022	4,281,831	20.44	(87,534,618)
2022011203425	BO	USDMXN	28/01/2022	25,000	20.41	(510,198)
2022011803345	B	USDMXN	28/01/2022	9,420,255	20.46	(192,739,215)
2022011803244	SO	USDMXN	28/01/2022	(200,000)	20.42	4,083,012
2022011903505	SO	USDMXN	28/01/2022	(100,000)	20.54	2,054,175
2022012003221	S	USDMXN	28/01/2022	(135,000)	20.44	2,759,606
2022010303086	B	USDMXN	31/01/2022	183,050	20.65	(3,780,058)
2022011303109	BO	USDMXN	31/01/2022	650,000	20.41	(13,268,167)
2022011803245	SO	USDMXN	31/01/2022	(200,000)	20.43	4,085,008
2022020303409	BO	USDMXN	14/02/2022	5,523,001	20.63	(113,960,039)
2022012603325	SO	USDMXN	14/02/2022	(60,000)	20.68	1,240,620
2022012703692	BO	USDMXN	14/02/2022	10	20.84	(208)
2022012703619	SO	USDMXN	14/02/2022	(486,000)	20.83	10,124,951
2022012703658	S	USDMXN	14/02/2022	(4,197,860)	20.84	87,490,648
2022012703708	SO	USDMXN	14/02/2022	(10)	20.82	213
2022020103309	BO	EURMXN	15/02/2022	111,115	23.23	(2,581,263)
2022020103339	B	USDMXN	15/02/2022	12,500,000	20.65	(258,068,675)
2022020103343	B	USDMXN	15/02/2022	12,500,000	20.65	(258,068,675)
2022010303231	SO	USDMXN	15/02/2022	(320)	20.71	6,627
2022010503345	BO	USDMXN	15/02/2022	70,000	20.54	(1,437,889)
2022011103412	S	USDMXN	15/02/2022	(4,281,831)	20.50	87,788,857

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022011103414	S	USDMXN	15/02/2022	(6,718,169)	20.51	137,756,409
2022011403099	B	USDMXN	15/02/2022	4,000,000	20.41	(81,646,625)
2022011403482	B	USDMXN	15/02/2022	100,000	20.43	(2,043,286)
2022011703243	BO	USDMXN	15/02/2022	50,000	20.39	(1,019,395)
2022011803336	SO	USDMXN	15/02/2022	(4,838,294)	20.53	99,340,712
2022011803346	S	USDMXN	15/02/2022	(9,420,255)	20.52	193,335,344
2022012703620	SO	USDMXN	15/02/2022	(289,000)	20.84	6,022,724
2022020203184	B	USDMXN	16/02/2022	110,906	20.63	(2,287,689)
2022020203437	B	USDMXN	16/02/2022	123,761	20.61	(2,550,535)
2022020403012	B	USDMXN	16/02/2022	168,364	20.68	(3,481,959)
2022020903339	BO	USDMXN	16/02/2022	200,000	20.47	(4,094,504)
2022011303228	B	USDMXN	16/02/2022	500,000	20.45	(10,226,910)
2022011303405	BO	USDMXN	16/02/2022	25,050	20.43	(511,778)
2022012703257	B	USDMXN	16/02/2022	881,633	20.81	(18,342,805)
2022012803164	B	USDMXN	16/02/2022	988,502	20.92	(20,678,111)
2022012803459	B	USDMXN	16/02/2022	307,162	20.90	(6,421,094)
2022012803556	B	USDMXN	16/02/2022	307,614	20.91	(6,432,426)
2022013103446	B	USDMXN	16/02/2022	90,158	20.65	(1,861,664)
2022013103577	B	USDMXN	16/02/2022	33,838	20.65	(698,899)
2022020103257	BO	USDMXN	17/02/2022	6,300	20.65	(130,118)
2022010303060	B	USDMXN	17/02/2022	30,000	20.72	(621,492)
2022010403182	B	USDMXN	17/02/2022	11,000,000	20.67	(227,339,035)
2022010403201	B	USDMXN	17/02/2022	64,995	20.65	(1,342,273)
2022010603400	B	USDMXN	17/02/2022	30,000	20.64	(619,213)
2022011303268	B	USDMXN	17/02/2022	30,000	20.46	(613,846)
2022011403138	B	USDMXN	17/02/2022	30,000	20.41	(612,264)
2022011703313	B	USDMXN	17/02/2022	30,000	20.40	(611,986)
2022011703467	B	USDMXN	17/02/2022	60,000	20.39	(1,223,300)
2022011803337	B	USDMXN	17/02/2022	16,240	20.54	(333,583)
2022012103435	BO	USDMXN	17/02/2022	8,243	20.53	(169,214)
2022012603236	BO	USDMXN	17/02/2022	10,000	20.73	(207,288)
2022012703137	B	USDMXN	17/02/2022	923,918	20.81	(19,225,855)
2022020103206	SO	USDMXN	18/02/2022	(100,000)	20.64	2,063,613
2022010303093	B	USDMXN	18/02/2022	250,000	20.71	(5,177,441)
2022010403189	B	USDMXN	18/02/2022	1,506,940	20.66	(31,137,485)
2022010503501	S	USDMXN	18/02/2022	(3,500,000)	20.73	72,559,726
2022021003253	B	USDMXN	18/02/2022	50,000	20.42	(1,021,235)
2022021103275	BO	USDMXN	18/02/2022	400,000	20.44	(8,174,882)
2022010403193	B	USDMXN	22/02/2022	1,493,103	20.67	(30,867,984)
2022010403222	BO	USDMXN	22/02/2022	90	20.71	(1,863)
2022021003264	B	USDMXN	22/02/2022	50,000	20.45	(1,022,345)
2022021003382	BO	USDMXN	22/02/2022	82,500	20.53	(1,693,436)
2022011303165	BO	USDMXN	22/02/2022	2,442,122	20.47	(49,988,066)
2022011803263	BO	USDMXN	22/02/2022	16,240	20.55	(333,672)
2022011803338	S	USDMXN	22/02/2022	(16,240)	20.56	333,871
2022011903507	SO	USDMXN	22/02/2022	(200,000)	20.63	4,126,344
2022021603377	SO	USDMXN	22/02/2022	(5,000,000)	20.31	101,570,595
2022021703095	S	USDMXN	22/02/2022	(2,436,552)	20.30	49,467,610
2022021703605	S	USDMXN	22/02/2022	(84,814)	20.31	1,722,632
2022021703607	S	USDMXN	22/02/2022	(85,852)	20.31	1,743,706
2022021703609	S	USDMXN	22/02/2022	(86,028)	20.31	1,747,280
2022021703611	S	USDMXN	22/02/2022	(67,366)	20.31	1,368,311
2022021703613	S	USDMXN	22/02/2022	(66,932)	20.31	1,359,556
2022021703615	S	USDMXN	22/02/2022	(89,057)	20.31	1,808,917
2022021703617	S	USDMXN	22/02/2022	(89,084)	20.31	1,809,456
2022011303230	B	USDMXN	23/02/2022	500,000	20.48	(10,239,926)
2022012003178	BO	USDMXN	23/02/2022	26,600	20.54	(546,282)
2022012403216	BO	USDMXN	23/02/2022	23,550	20.78	(489,329)
2022021503264	BO	USDMXN	23/02/2022	200,000	20.40	(4,080,915)
2022021703010	B	USDMXN	23/02/2022	3,150,000	20.28	(63,867,825)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022021803280	B	USDMXN	23/02/2022	2,000	20.29	(40,587)
2022021803259	S	USDMXN	23/02/2022	(2,885,864)	20.30	58,573,516
2022021803262	S	USDMXN	23/02/2022	(60,000)	20.29	1,217,484
2022021803264	S	USDMXN	23/02/2022	(110,000)	20.29	2,231,955
2022021803266	S	USDMXN	23/02/2022	(110,000)	20.29	2,231,944
2022021803268	S	USDMXN	23/02/2022	(110,000)	20.29	2,231,988
2022021803270	S	USDMXN	23/02/2022	(107,000)	20.29	2,171,116
2022021803272	S	USDMXN	23/02/2022	(107,000)	20.29	2,171,073
2022021803274	S	USDMXN	23/02/2022	(107,000)	20.29	2,171,330
2022021803276	S	USDMXN	23/02/2022	(300,000)	20.29	6,087,297
2022021803278	S	USDMXN	23/02/2022	(300,000)	20.29	6,086,895
2022021803374	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,343
2022021803376	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,317
2022021803378	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,343
2022021803380	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,343
2022021803382	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,265
2022021803384	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,317
2022021803386	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,628
2022021803388	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,680
2022021803390	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,706
2022021803392	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,680
2022021803394	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,628
2022021803396	S	USDMXN	23/02/2022	(259,000)	20.29	5,255,499
2022021803585	S	USDMXN	23/02/2022	(657,225)	20.29	13,335,227
2022020103258	BO	USDMXN	24/02/2022	18,900	20.68	(390,817)
2022010303062	B	USDMXN	24/02/2022	30,000	20.74	(622,319)
2022020303165	BO	USDMXN	24/02/2022	10,000	20.59	(205,880)
2022010503227	BO	USDMXN	24/02/2022	12,104	20.62	(249,636)
2022010603402	B	USDMXN	24/02/2022	30,000	20.66	(619,905)
2022020903170	BO	USDMXN	24/02/2022	6,300	20.54	(129,374)
2022021103279	BO	USDMXN	24/02/2022	400,000	20.45	(8,180,843)
2022011303270	B	USDMXN	24/02/2022	30,000	20.49	(614,706)
2022011403140	B	USDMXN	24/02/2022	30,000	20.44	(613,158)
2022011703315	B	USDMXN	24/02/2022	30,000	20.42	(612,719)
2022011703469	B	USDMXN	24/02/2022	60,000	20.41	(1,224,839)
2022012703139	B	USDMXN	24/02/2022	923,918	20.83	(19,249,712)
2022020203218	B	USDMXN	25/02/2022	210,000	20.66	(4,337,718)
2022010303095	B	USDMXN	25/02/2022	250,000	20.74	(5,184,553)
2022020303479	S	USDMXN	25/02/2022	(133,286)	20.65	2,752,885
2022020303497	SO	USDMXN	25/02/2022	(265,050)	20.65	5,472,631
2022010503295	B	USDMXN	25/02/2022	210,000	20.55	(4,315,958)
2022010603488	B	USDMXN	25/02/2022	463,952	20.67	(9,589,124)
2022021103305	B	USDMXN	25/02/2022	50,000	20.44	(1,022,159)
2022011403470	B	USDMXN	25/02/2022	210,000	20.47	(4,298,119)
2022012603040	SO	USDMXN	25/02/2022	(100,000)	20.75	2,074,557
2022012703707	BO	USDMXN	25/02/2022	108,627	20.87	(2,266,723)
2022021503053	BO	USDMXN	25/02/2022	650,000	20.47	(13,305,754)
2022021603039	BO	USDMXN	25/02/2022	1,000,000	20.38	(20,380,293)
2022020103328	SO	USDMXN	28/02/2022	(5,000,000)	20.68	103,423,524
2022020103340	S	USDMXN	28/02/2022	(12,500,000)	20.69	258,627,388
2022020103344	S	USDMXN	28/02/2022	(12,500,000)	20.69	258,627,388
2022020103348	S	USDMXN	28/02/2022	(4,935,406)	20.70	102,159,130
2022010303097	B	USDMXN	28/02/2022	163,000	20.75	(3,382,233)
2022010503465	B	USDMXN	28/02/2022	230,967	20.75	(4,793,470)
2022021003248	B	USDMXN	28/02/2022	300,000	20.46	(6,137,798)
2022011903009	B	USDMXN	28/02/2022	589,750	20.52	(12,102,267)
2022012003236	B	USDMXN	28/02/2022	589,750	20.56	(12,124,893)
2022012103005	B	USDMXN	28/02/2022	589,750	20.62	(12,163,489)
2022012403229	B	USDMXN	28/02/2022	589,750	20.79	(12,262,719)
2022012503158	B	USDMXN	28/02/2022	589,750	20.81	(12,269,903)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022012703084	B	USDMXN	28/02/2022	589,750	20.87	(12,305,852)
2022012703344	B	USDMXN	28/02/2022	589,750	20.87	(12,308,777)
2022012803024	B	USDMXN	28/02/2022	589,750	20.85	(12,294,537)
2022012803431	B	USDMXN	28/02/2022	589,750	20.97	(12,367,274)
2022021503317	B	USDMXN	28/02/2022	320,000	20.41	(6,531,138)
2022021803202	BO	USDMXN	28/02/2022	450,000	20.31	(9,140,239)
2022022203409	BO	USDMXN	14/03/2022	20,000	20.36	(407,192)
2022022303272	B	USDMXN	14/03/2022	40,000	20.33	(813,091)
2022022303360	BO	USDMXN	14/03/2022	674,860	20.29	(13,695,861)
2022022403118	SO	USDMXN	14/03/2022	(451,000)	20.67	9,322,107
2022020203077	SO	USDMXN	15/03/2022	(200,000)	20.72	4,143,639
2022030203202	BO	USDMXN	15/03/2022	51,000	20.68	(1,054,484)
2022021003384	BO	USDMXN	15/03/2022	71,000	20.61	(1,463,159)
2022011303570	B	USDMXN	15/03/2022	5,066,364	20.53	(103,996,772)
2022012703640	SO	USDMXN	15/03/2022	(2,496,555)	20.95	52,298,170
2022022303275	B	USDMXN	15/03/2022	60,000	20.33	(1,219,832)
2022022403084	SO	USDMXN	15/03/2022	(100,000)	20.68	2,067,711
2022022403119	SO	USDMXN	15/03/2022	(426,000)	20.68	8,809,591
2022022403568	S	USDMXN	15/03/2022	(156,144)	20.65	3,224,893
2022022503300	BO	USDMXN	15/03/2022	2,235,592	20.46	(45,730,716)
2022020203188	B	USDMXN	16/03/2022	112,237	20.73	(2,326,346)
2022020203440	B	USDMXN	16/03/2022	142,409	20.71	(2,948,892)
2022020403015	B	USDMXN	16/03/2022	246,137	20.78	(5,113,819)
2022030403361	S	USDMXN	16/03/2022	(750,000)	20.94	15,706,275
2022020803469	B	USDMXN	16/03/2022	61,268	20.74	(1,270,722)
2022021003300	BO	USDMXN	16/03/2022	26,300	20.56	(540,823)
2022011303236	B	USDMXN	16/03/2022	500,000	20.56	(10,279,749)
2022012703259	B	USDMXN	16/03/2022	898,898	20.92	(18,803,358)
2022012803161	B	USDMXN	16/03/2022	1,159,919	21.02	(24,383,717)
2022012803463	B	USDMXN	16/03/2022	329,188	21.01	(6,915,196)
2022012803544	B	USDMXN	16/03/2022	291,379	21.02	(6,123,913)
2022013103454	B	USDMXN	16/03/2022	97,232	20.75	(2,017,620)
2022013103581	B	USDMXN	16/03/2022	35,115	20.75	(728,741)
2022021603307	BO	USDMXN	16/03/2022	22,150	20.41	(452,081)
2022021603548	BO	USDMXN	16/03/2022	750,000	20.37	(15,277,396)
2022021703186	BO	USDMXN	16/03/2022	78,549	20.37	(1,600,262)
2022021803379	B	USDMXN	16/03/2022	259,000	20.36	(5,274,410)
2022021803503	BO	USDMXN	16/03/2022	42,650	20.36	(868,534)
2022022303646	B	USDMXN	16/03/2022	3,434,935	20.32	(69,787,337)
2022022503496	B	USDMXN	16/03/2022	357,625	20.43	(7,305,836)
2022020203117	B	USDMXN	17/03/2022	30,000	20.76	(622,692)
2022030203384	S	USDMXN	17/03/2022	(105,000)	20.68	2,171,031
2022020903440	B	USDMXN	17/03/2022	30,000	20.60	(618,142)
2022011703321	B	USDMXN	17/03/2022	30,000	20.50	(615,135)
2022011703463	B	USDMXN	17/03/2022	30,000	20.49	(614,823)
2022012703145	B	USDMXN	17/03/2022	773,092	20.92	(16,175,557)
2022021603282	B	USDMXN	17/03/2022	90,000	20.40	(1,836,364)
2022021603478	BO	USDMXN	17/03/2022	30,000	20.40	(611,918)
2022022203114	B	USDMXN	17/03/2022	60,000	20.39	(1,223,507)
2022030203386	S	USDMXN	18/03/2022	(134,000)	20.68	2,771,153
2022020903434	B	USDMXN	18/03/2022	2,000,000	20.61	(41,213,010)
2022011203124	B	USDMXN	18/03/2022	250,000	20.59	(5,148,368)
2022011403496	B	USDMXN	18/03/2022	130,000	20.55	(2,671,160)
2022011703080	B	USDMXN	18/03/2022	300,000	20.50	(6,150,417)
2022012803692	SO	USDMXN	18/03/2022	(100,000)	21.01	2,101,263
2022021603201	BO	USDMXN	18/03/2022	100,000	20.42	(2,041,688)
2022021703163	BO	USDMXN	18/03/2022	1,000,000	20.38	(20,382,274)
2022022303522	B	USDMXN	18/03/2022	1,000,000	20.33	(20,329,316)
2022022503598	B	USDMXN	18/03/2022	50,000	20.42	(1,021,054)
2022022803465	SO	USDMXN	18/03/2022	(957,938)	20.61	19,745,689

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022030203203	BO	USDMXN	22/03/2022	51,000	20.70	(1,055,645)
2022030203388	S	USDMXN	22/03/2022	(289,000)	20.69	5,980,663
2022030303190	BO	USDMXN	22/03/2022	64,000	20.78	(1,329,728)
2022030403463	B	USDMXN	22/03/2022	750,000	21.00	(15,749,646)
2022030703268	B	EURMXN	22/03/2022	750,000	23.17	(17,378,034)
2022030703220	S	USDMXN	22/03/2022	(750,000)	21.27	15,950,386
2022030803434	SO	USDMXN	22/03/2022	(122,000)	21.38	2,607,800
2022030903297	BO	USDMXN	22/03/2022	35,000	20.99	(734,550)
2022031103286	BO	USDMXN	22/03/2022	60,000	20.89	(1,253,419)
2022012603422	BO	USDMXN	22/03/2022	99,254	20.96	(2,080,620)
2022021603187	BO	USDMXN	22/03/2022	50,000	20.43	(1,021,495)
2022021803263	B	USDMXN	22/03/2022	60,000	20.39	(1,223,174)
2022031403308	BO	USDMXN	22/03/2022	30,000	20.92	(627,570)
2022031703437	B	USDMXN	22/03/2022	379,000	20.53	(7,780,472)
2022020803074	S	USDMXN	23/03/2022	(150,000)	20.80	3,119,614
2022031103287	BO	USDMXN	23/03/2022	30,000	20.89	(626,822)
2022011303241	B	USDMXN	23/03/2022	500,000	20.59	(10,293,922)
2022021703122	BO	USDMXN	23/03/2022	45,000	20.39	(917,746)
2022021803381	B	USDMXN	23/03/2022	259,000	20.39	(5,280,733)
2022022403378	BO	USDMXN	23/03/2022	22,150	20.80	(460,700)
2022031403307	BO	USDMXN	23/03/2022	30,000	20.92	(627,678)
2022031803320	S	USDMXN	23/03/2022	(269,000)	20.40	5,487,584
2022020203119	B	USDMXN	24/03/2022	30,000	20.78	(623,549)
2022030803433	SO	USDMXN	24/03/2022	(125,000)	21.38	2,671,971
2022020903442	B	USDMXN	24/03/2022	30,000	20.63	(618,943)
2022020903493	B	USDMXN	24/03/2022	100,000	20.63	(2,063,464)
2022031103288	BO	USDMXN	24/03/2022	60,000	20.90	(1,253,870)
2022011703472	B	USDMXN	24/03/2022	60,000	20.52	(1,231,278)
2022012703148	B	USDMXN	24/03/2022	773,092	20.95	(16,195,690)
2022021603288	B	USDMXN	24/03/2022	90,000	20.43	(1,838,753)
2022021603479	BO	USDMXN	24/03/2022	30,000	20.42	(612,693)
2022022203116	B	USDMXN	24/03/2022	60,000	20.42	(1,224,996)
2022022303049	B	USDMXN	24/03/2022	1,800,000	20.28	(36,511,689)
2022020203223	B	USDMXN	25/03/2022	210,000	20.76	(4,359,203)
2022020203078	SO	USDMXN	25/03/2022	(200,000)	20.76	4,151,410
2022030203034	S	USDMXN	25/03/2022	(4,000,000)	20.84	83,347,760
2022010503299	B	USDMXN	25/03/2022	210,000	20.66	(4,338,237)
2022030803431	SO	USDMXN	25/03/2022	(381,000)	21.38	8,144,483
2022011203128	B	USDMXN	25/03/2022	250,000	20.62	(5,155,547)
2022011403475	B	USDMXN	25/03/2022	210,000	20.57	(4,320,415)
2022011403498	B	USDMXN	25/03/2022	65,000	20.57	(1,337,288)
2022012703597	SO	USDMXN	25/03/2022	(200,000)	21.00	4,200,637
2022021403237	BO	USDMXN	25/03/2022	500,000	20.54	(10,270,172)
2022021603202	BO	USDMXN	25/03/2022	100,000	20.44	(2,044,274)
2022021603264	BO	USDMXN	25/03/2022	300,000	20.47	(6,141,246)
2022021803203	BO	USDMXN	25/03/2022	300,000	20.40	(6,121,354)
2022022203417	B	USDMXN	25/03/2022	2,430,000	20.40	(49,561,130)
2022031403306	BO	USDMXN	25/03/2022	100,000	20.88	(2,087,992)
2022021803265	B	USDMXN	28/03/2022	110,000	20.41	(2,244,846)
2022022103265	B	USDMXN	28/03/2022	250,000	20.44	(5,109,174)
2022031403309	BO	USDMXN	28/03/2022	40,000	20.94	(837,644)
2022031403310	BO	USDMXN	28/03/2022	20,000	20.90	(418,058)
2022030203205	BO	USDMXN	29/03/2022	93,000	20.73	(1,927,541)
2022030703571	B	USDMXN	29/03/2022	298,600	21.42	(6,397,448)
2022030703568	S	USDMXN	29/03/2022	(350,000)	21.42	7,498,441
2022030703570	S	USDMXN	29/03/2022	(298,600)	21.42	6,397,063
2022030903298	BO	USDMXN	29/03/2022	30,000	21.01	(630,396)
2022021603188	BO	USDMXN	29/03/2022	60,000	20.46	(1,227,432)
2022022303498	B	USDMXN	29/03/2022	350,000	20.37	(7,129,810)
2022031403312	BO	USDMXN	29/03/2022	30,000	20.91	(627,198)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022031503274	BO	USDMXN	29/03/2022	30,000	20.91	(627,217)
2022030803160	SO	USDMXN	30/03/2022	(333,333)	21.51	7,170,694
2022011303243	B	USDMXN	30/03/2022	500,000	20.62	(10,307,880)
2022012003450	B	USDMXN	30/03/2022	2,117,015	20.75	(43,926,687)
2022021603484	BO	USDMXN	30/03/2022	300,000	20.42	(6,124,742)
2022021703377	BO	USDMXN	30/03/2022	300,000	20.37	(6,111,485)
2022021803001	BO	USDMXN	30/03/2022	45,000	20.41	(918,231)
2022021803383	B	USDMXN	30/03/2022	259,000	20.42	(5,287,508)
2022022103158	B	EURMXN	30/03/2022	300,000	23.16	(6,948,489)
2022022303209	BO	USDMXN	30/03/2022	300,000	20.35	(6,105,695)
2022022403375	BO	USDMXN	30/03/2022	22,450	20.82	(467,492)
2022031503275	BO	USDMXN	30/03/2022	20,000	20.91	(418,220)
2022031603323	BO	USDMXN	30/03/2022	10,000	20.83	(208,317)
2022031703469	SO	USDMXN	30/03/2022	(5,982,660)	20.55	122,940,199
2022032303470	B	USDMXN	30/03/2022	759,000	20.19	(15,327,049)
2022020203121	B	USDMXN	31/03/2022	30,000	20.81	(624,352)
2022010303064	B	USDMXN	31/03/2022	108,000	20.88	(2,254,825)
2022030703034	SO	USDMXN	31/03/2022	(150,000)	21.34	3,201,183
2022030703483	SO	USDMXN	31/03/2022	(575,000)	21.39	12,296,553
2022030803290	BO	EURMXN	31/03/2022	111,522	23.37	(2,606,268)
2022030803276	BO	USDMXN	31/03/2022	8,589,185	21.47	(184,408,851)
2022020903444	B	USDMXN	31/03/2022	30,000	20.66	(619,748)
2022020903497	B	USDMXN	31/03/2022	100,000	20.66	(2,066,156)
2022031103198	B	USDMXN	31/03/2022	150,000,000	21.01	(3,151,500,000)
2022031103186	S	USDMXN	31/03/2022	(30,000,000)	21.01	630,343,620
2022031103213	S	USDMXN	31/03/2022	(130,000,000)	21.02	2,731,950,000
2022031103219	S	USDMXN	31/03/2022	(120,000,000)	21.02	2,521,800,000
2022011703475	B	USDMXN	31/03/2022	60,000	20.55	(1,232,921)
2022012603317	BO	USDMXN	31/03/2022	51,700	20.84	(1,077,678)
2022012703150	B	USDMXN	31/03/2022	773,092	20.98	(16,215,748)
2022021603182	B	USDMXN	31/03/2022	657,225	20.46	(13,447,512)
2022021603203	BO	USDMXN	31/03/2022	100,000	20.46	(2,046,490)
2022021603290	B	USDMXN	31/03/2022	90,000	20.46	(1,841,134)
2022021603480	BO	USDMXN	31/03/2022	30,000	20.45	(613,473)
2022021703086	BO	USDMXN	31/03/2022	657,000	20.44	(13,427,645)
2022021703336	BO	USDMXN	31/03/2022	657,000	20.42	(13,417,168)
2022021703638	BO	USDMXN	31/03/2022	450	20.45	(9,204)
2022021803586	B	USDMXN	31/03/2022	657,225	20.42	(13,418,681)
2022022103053	B	USDMXN	31/03/2022	657,225	20.39	(13,403,685)
2022022103127	B	USDMXN	31/03/2022	657,225	20.42	(13,418,201)
2022022203120	B	USDMXN	31/03/2022	657,225	20.44	(13,433,595)
2022022203123	B	USDMXN	31/03/2022	60,000	20.44	(1,226,590)
2022022203238	B	USDMXN	31/03/2022	657,225	20.41	(13,411,771)
2022022203481	S	USDMXN	31/03/2022	(11,000,000)	20.45	224,921,166
2022022403327	BO	USDMXN	31/03/2022	657,000	20.78	(13,654,031)
2022022403588	BO	USDMXN	31/03/2022	225	20.65	(4,647)
2022022803108	B	USDMXN	31/03/2022	657,225	20.50	(13,474,030)
2022022803277	B	USDMXN	31/03/2022	657,225	20.53	(13,494,711)
2022031503546	BO	EURMXN	31/03/2022	96,188	22.88	(2,200,598)
2022031503515	B	USDMXN	31/03/2022	8,000,000	20.88	(167,043,520)
2022031503583	BO	USDMXN	31/03/2022	50,000	20.89	(1,044,617)
2022031603324	BO	USDMXN	31/03/2022	10,000	20.84	(208,355)
2022032203439	B	USDMXN	31/03/2022	10,974,651	20.30	(222,805,609)
2022010503382	SO	USDMXN	13/01/2022	(6,390)	20.51	131,034
2022010503382	SO	USDMXN	13/01/2022	(6,390)	20.51	131,034
2022011003069	B	USDMXN	14/01/2022	150,000	20.47	(3,070,200)
2022011003069	B	USDMXN	14/01/2022	150,000	20.47	(3,070,200)
2022010503411	SO	USDMXN	18/01/2022	(77,600)	20.49	1,590,296
2022010503411	SO	USDMXN	18/01/2022	(77,600)	20.49	1,590,296
2022010503177	SO	USDMXN	20/01/2022	(31,328)	20.51	642,421

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022010503177	SO	USDMXN	20/01/2022	(31,328)	20.51	642,421
2022011403701	SO	USDMXN	20/01/2022	(1,600,000)	20.30	32,484,800
2022011403707	S	USDMXN	20/01/2022	(1,600,000)	20.30	32,484,800
2022011403701	SO	USDMXN	20/01/2022	(1,600,000)	20.30	32,484,800
2022011403707	S	USDMXN	20/01/2022	(1,600,000)	20.30	32,484,800
2022011303128	SO	USDMXN	21/01/2022	(140,000)	20.39	2,854,180
2022011303128	SO	USDMXN	21/01/2022	(140,000)	20.39	2,854,180
2022011403018	BO	USDMXN	21/01/2022	200,000	20.30	(4,060,600)
2022011403018	BO	USDMXN	21/01/2022	200,000	20.30	(4,060,600)
2022011703001	S	USDMXN	21/01/2022	(300,000)	20.30	6,090,000
2022011703002	S	USDMXN	21/01/2022	(300,000)	20.30	6,090,000
2022011703001	S	USDMXN	21/01/2022	(300,000)	20.30	6,090,000
2022011703002	S	USDMXN	21/01/2022	(300,000)	20.30	6,090,000
2022011303135	SO	USDMXN	31/01/2022	(650,000)	20.42	13,273,000
2022011303148	SO	USDMXN	31/01/2022	(650,000)	20.42	13,273,000
2022011803252	BO	USDMXN	31/01/2022	200,000	20.42	(4,083,000)
2022011803254	BO	USDMXN	31/01/2022	200,000	20.42	(4,083,000)
2022010303220	S	USDMXN	01/02/2022	(2,000,000)	20.66	41,328,000
2022010303224	S	USDMXN	01/02/2022	(300,000)	20.66	6,199,200
2022010303226	S	USDMXN	01/02/2022	(315,000)	20.66	6,509,160
2022010303228	S	USDMXN	01/02/2022	(1,500,000)	20.66	30,996,000
2022010303299	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.64	12,173,207
2022010303220	S	USDMXN	01/02/2022	(2,000,000)	20.66	41,328,000
2022010303224	S	USDMXN	01/02/2022	(300,000)	20.66	6,199,200
2022010303226	S	USDMXN	01/02/2022	(315,000)	20.66	6,509,160
2022010303228	S	USDMXN	01/02/2022	(1,500,000)	20.66	30,996,000
2022010303299	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.64	12,173,207
2022010403074	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.65	12,177,158
2022010403074	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.65	12,177,158
2022010503118	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.46	12,065,400
2022010503118	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.46	12,065,400
2022010703187	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.52	12,103,144
2022010703187	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.52	12,103,144
2022011103239	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.42	12,045,054
2022011103239	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.42	12,045,054
2022011203270	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.43	12,048,887
2022011203270	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.43	12,048,887
2022011303017	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.43	12,050,067
2022011303017	SON	USDMXN	01/02/2022	(589,750)	20.43	12,050,067
2022011303304	SO	USDMXN	02/02/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022011303304	SO	USDMXN	02/02/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022012103633	BO	USDMXN	02/02/2022	200,000	20.45	(4,090,400)
2022012103633	BO	USDMXN	02/02/2022	200,000	20.45	(4,090,400)
2022010503175	SO	USDMXN	03/02/2022	(18,512)	20.51	379,613
2022010503175	SO	USDMXN	03/02/2022	(18,512)	20.51	379,613
2022010603334	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.52	615,585
2022010603334	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.52	615,585
2022010703406	SO	USDMXN	03/02/2022	(12,500)	20.45	255,563
2022010703406	SO	USDMXN	03/02/2022	(12,500)	20.45	255,563
2022011203170	SO	USDMXN	03/02/2022	(50,000)	20.43	1,021,600
2022011203170	SO	USDMXN	03/02/2022	(50,000)	20.43	1,021,600
2022011303208	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.41	612,330
2022011303208	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.41	612,330
2022011403085	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.36	610,800
2022011403085	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.36	610,800
2022011703278	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.36	610,740
2022011703445	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.37	610,980
2022011703278	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.36	610,740
2022011703445	SO	USDMXN	03/02/2022	(30,000)	20.37	610,980
2022012003184	BO	USDMXN	03/02/2022	60,000	20.37	(1,222,260)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022012003184	BO	USDMXN	03/02/2022	60,000	20.37	(1,222,260)
2022012703205	SO	USDMXN	03/02/2022	(923,918)	20.98	19,384,529
2022012703205	SO	USDMXN	03/02/2022	(923,918)	20.98	19,384,529
2022011403121	SO	USDMXN	04/02/2022	(50,000)	20.40	1,019,950
2022011403121	SO	USDMXN	04/02/2022	(50,000)	20.40	1,019,950
2022011903310	BO	USDMXN	04/02/2022	200,000	20.48	(4,095,000)
2022011903310	BO	USDMXN	04/02/2022	200,000	20.48	(4,095,000)
2022012003154	BO	USDMXN	04/02/2022	107,000	20.37	(2,180,018)
2022012003163	BO	USDMXN	04/02/2022	156,000	20.37	(3,178,344)
2022012003169	BO	USDMXN	04/02/2022	131,000	20.37	(2,668,994)
2022012003154	BO	USDMXN	04/02/2022	107,000	20.37	(2,180,018)
2022012003163	BO	USDMXN	04/02/2022	156,000	20.37	(3,178,344)
2022012003169	BO	USDMXN	04/02/2022	131,000	20.37	(2,668,994)
2022012103153	B	EURMXN	04/02/2022	285,680	23.25	(6,642,060)
2022012103634	BO	USDMXN	04/02/2022	150,000	20.47	(3,070,500)
2022012103153	B	EURMXN	04/02/2022	285,680	23.25	(6,642,060)
2022012103634	BO	USDMXN	04/02/2022	150,000	20.47	(3,070,500)
2022013103323	B	USDMXN	04/02/2022	50,000	20.65	(1,032,500)
2022013103323	B	USDMXN	04/02/2022	50,000	20.65	(1,032,500)
2022011703260	SO	USDMXN	08/02/2022	(50,000)	20.43	1,021,550
2022012003179	BO	USDMXN	08/02/2022	104,000	20.39	(2,120,352)
2022012003359	BO	USDMXN	08/02/2022	60,000	20.39	(1,223,280)
2022012503035	BO	USDMXN	08/02/2022	121,000	20.54	(2,485,340)
2022012503039	BO	USDMXN	08/02/2022	157,000	20.54	(3,224,780)
2022012503042	BO	USDMXN	08/02/2022	108,000	20.54	(2,218,320)
2022012503047	BO	USDMXN	08/02/2022	60,000	20.54	(1,232,400)
2022020203389	S	USDMXN	08/02/2022	(400,000)	20.59	8,235,800
2022020203391	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022020203393	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022020203395	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022020203397	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022020203399	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022020203401	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022020203403	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022020203405	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022020203407	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022020203409	S	USDMXN	08/02/2022	(500,000)	20.59	10,294,750
2022010703263	SO	USDMXN	09/02/2022	(23,250)	20.57	478,160
2022011003290	SO	USDMXN	09/02/2022	(29,200)	20.54	599,680
2022011303306	SO	USDMXN	09/02/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022020303094	S	USDMXN	09/02/2022	(300,000)	20.57	6,170,100
2022020303096	S	USDMXN	09/02/2022	(300,000)	20.57	6,170,100
2022020303477	S	USDMXN	09/02/2022	(9,720)	20.62	200,392
2022020303478	S	USDMXN	09/02/2022	(11,136)	20.62	229,585
2022010503174	SO	USDMXN	10/02/2022	(18,512)	20.51	379,613
2022010503254	SO	USDMXN	10/02/2022	(210,000)	20.57	4,319,070
2022010603333	SO	USDMXN	10/02/2022	(30,000)	20.54	616,290
2022011303207	SO	USDMXN	10/02/2022	(30,000)	20.44	613,065
2022011403084	SO	USDMXN	10/02/2022	(30,000)	20.39	611,655
2022011403413	SO	USDMXN	10/02/2022	(210,000)	20.41	4,285,995
2022011703277	SO	USDMXN	10/02/2022	(30,000)	20.38	611,535
2022011703444	SO	USDMXN	10/02/2022	(60,000)	20.39	1,223,550
2022012503051	BO	USDMXN	10/02/2022	61,000	20.55	(1,253,367)
2022012703204	SO	USDMXN	10/02/2022	(923,918)	20.98	19,384,529
2022020203124	SO	USDMXN	10/02/2022	(12,172)	20.63	251,139
2022020403170	B	EURMXN	11/02/2022	285,680	23.75	(6,784,900)
2022010403187	SO	USDMXN	11/02/2022	(32,183)	20.65	664,418
2022010603202	BO	USDMXN	11/02/2022	3,500,000	20.74	(72,602,250)
2022011903513	BO	USDMXN	11/02/2022	200,000	20.56	(4,112,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022012403109	BO	USDMXN	11/02/2022	25,000	20.63	(515,750)
2022012603046	BO	USDMXN	11/02/2022	50,000	20.69	(1,034,500)
2022012603392	BO	USDMXN	11/02/2022	160,000	20.48	(3,277,440)
2022012603398	BO	USDMXN	11/02/2022	120,000	20.48	(2,458,080)
2022012603408	BO	USDMXN	14/02/2022	60,000	20.49	(1,229,580)
2022012703634	BO	USDMXN	14/02/2022	168,000	20.67	(3,471,888)
2022012703645	BO	USDMXN	14/02/2022	159,000	20.67	(3,285,894)
2022012703662	BO	USDMXN	14/02/2022	159,000	20.67	(3,285,894)
2022012703681	BON	USDMXN	14/02/2022	4,197,860	20.83	(87,420,439)
2022020303442	SON	USDMXN	14/02/2022	(5,523,001)	20.64	114,016,830
2022010503410	SO	USDMXN	15/02/2022	(70,000)	20.59	1,441,545
2022011103431	BON	USDMXN	15/02/2022	11,000,000	20.49	(225,381,200)
2022011403403	SO	USDMXN	15/02/2022	(100,000)	20.46	2,046,400
2022011403645	S	USDMXN	15/02/2022	(2,000,000)	20.41	40,824,000
2022011403647	S	USDMXN	15/02/2022	(2,000,000)	20.41	40,824,000
2022011703259	SO	USDMXN	15/02/2022	(50,000)	20.46	1,022,800
2022011803353	BON	USDMXN	15/02/2022	14,258,549	20.52	(292,642,470)
2022012703668	BO	USDMXN	15/02/2022	108,000	20.67	(2,232,252)
2022012703670	BO	USDMXN	15/02/2022	121,000	20.67	(2,500,949)
2022012703671	BO	USDMXN	15/02/2022	60,000	20.67	(1,240,140)
2022020103390	SON	EURMXN	15/02/2022	(111,115)	23.22	2,580,422
2022020103394	SON	USDMXN	15/02/2022	(12,500,000)	20.64	258,060,000
2022020903270	S	USDMXN	15/02/2022	(5,000,000)	20.51	102,550,000
2022020903274	S	USDMXN	15/02/2022	(24,995,000)	20.51	512,647,450
2022011303307	SO	USDMXN	16/02/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022011303416	SO	USDMXN	16/02/2022	(25,050)	20.49	513,350
2022012703373	SO	USDMXN	16/02/2022	(92,646)	21.51	1,992,463
2022012703374	SO	USDMXN	16/02/2022	(196,117)	21.51	4,217,731
2022012703377	SO	USDMXN	16/02/2022	(86,263)	21.51	1,855,189
2022012703378	SO	USDMXN	16/02/2022	(279,914)	21.51	6,019,886
2022012703379	SO	USDMXN	16/02/2022	(80,119)	21.51	1,723,055
2022012703404	SO	USDMXN	16/02/2022	(76,278)	21.51	1,640,450
2022012703406	SO	USDMXN	16/02/2022	(70,296)	21.51	1,511,800
2022012803175	SO	USDMXN	16/02/2022	(589,555)	21.62	12,745,000
2022012803176	SO	USDMXN	16/02/2022	(98,036)	21.62	2,119,342
2022012803177	SO	USDMXN	16/02/2022	(63,120)	21.62	1,364,528
2022012803178	SO	USDMXN	16/02/2022	(237,791)	21.62	5,140,566
2022012803559	SO	USDMXN	16/02/2022	(113,112)	21.62	2,445,199
2022012803560	SO	USDMXN	16/02/2022	(69,283)	21.62	1,497,725
2022012803561	SO	USDMXN	16/02/2022	(63,443)	21.62	1,371,479
2022012803573	SO	USDMXN	16/02/2022	(61,324)	21.62	1,325,672
2022012803697	SO	USDMXN	16/02/2022	(307,614)	21.61	6,646,000
2022013103513	SO	USDMXN	16/02/2022	(90,158)	21.34	1,923,584
2022013103625	SO	USDMXN	16/02/2022	(33,838)	21.32	721,504
2022020203248	SO	USDMXN	16/02/2022	(31,306)	21.31	667,256
2022020203249	SO	USDMXN	16/02/2022	(79,600)	21.31	1,696,594
2022020203495	SO	USDMXN	16/02/2022	(53,833)	21.28	1,145,383
2022020203496	SO	USDMXN	16/02/2022	(69,928)	21.28	1,487,830
2022020403069	SO	USDMXN	16/02/2022	(156,291)	21.39	3,342,283
2022020403070	SO	USDMXN	16/02/2022	(12,073)	21.39	258,181
2022020903364	SO	USDMXN	16/02/2022	(200,000)	20.50	4,099,000
2022021003069	S	USDMXN	16/02/2022	(550,000)	20.44	11,239,250
2022010403186	SO	USDMXN	17/02/2022	(11,064,995)	20.67	228,696,849
2022010603332	SO	USDMXN	17/02/2022	(30,000)	20.57	617,085
2022011303206	SO	USDMXN	17/02/2022	(30,000)	20.46	613,785
2022011403083	SO	USDMXN	17/02/2022	(30,000)	20.41	612,285
2022011703276	SO	USDMXN	17/02/2022	(30,000)	20.41	612,255
2022011703443	SO	USDMXN	17/02/2022	(60,000)	20.42	1,224,990
2022011803266	SO	USDMXN	17/02/2022	(16,240)	20.55	333,748
2022012103618	SO	USDMXN	17/02/2022	(8,243)	20.54	169,311

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022012603241	SO	USDMXN	17/02/2022	(10,000)	20.73	207,340
2022012703203	SO	USDMXN	17/02/2022	(923,918)	20.98	19,384,529
2022020103275	SO	USDMXN	17/02/2022	(6,300)	20.68	130,276
2022010403185	SO	USDMXN	18/02/2022	(1,506,940)	20.67	31,151,464
2022010503498	BO	USDMXN	18/02/2022	3,500,000	20.71	(72,471,700)
2022020103211	BO	USDMXN	18/02/2022	100,000	20.62	(2,062,000)
2022021003250	SO	USDMXN	18/02/2022	(50,000)	20.47	1,023,650
2022021103298	SO	USDMXN	18/02/2022	(400,000)	20.46	8,184,800
2022010503475	SON	USDMXN	28/02/2022	(230,967)	20.71	4,782,395
2022011903014	SON	USDMXN	28/02/2022	(589,750)	20.50	12,092,529
2022012003231	SON	USDMXN	28/02/2022	(589,750)	20.56	12,124,081
2022012103034	SON	USDMXN	28/02/2022	(589,750)	20.60	12,147,965
2022012403251	SON	USDMXN	28/02/2022	(589,750)	20.80	12,264,146
2022012503163	SON	USDMXN	28/02/2022	(589,750)	20.81	12,270,928
2022012703022	SON	USDMXN	28/02/2022	(589,750)	20.83	12,287,146
2022012703358	SON	USDMXN	28/02/2022	(589,750)	20.83	12,286,262
2022012803040	SON	USDMXN	28/02/2022	(589,750)	20.86	12,301,006
2022012803422	SON	USDMXN	28/02/2022	(589,750)	20.97	12,365,288
2022020103392	BON	USDMXN	28/02/2022	11,435,406	20.68	(236,507,065)
2022020103396	BON	USDMXN	28/02/2022	11,000,000	20.69	(227,568,000)
2022021003232	SO	USDMXN	28/02/2022	(100,000)	20.47	2,047,100
2022021003233	SO	USDMXN	28/02/2022	(100,000)	20.47	2,047,100
2022021003234	SO	USDMXN	28/02/2022	(100,000)	20.47	2,047,100
2022021503270	SO	USDMXN	28/02/2022	(20,000)	20.48	409,520
2022021503279	SO	USDMXN	28/02/2022	(50,000)	20.46	1,022,950
2022021503280	SO	USDMXN	28/02/2022	(100,000)	20.46	2,045,900
2022021503281	SO	USDMXN	28/02/2022	(100,000)	20.46	2,045,900
2022021503282	SO	USDMXN	28/02/2022	(50,000)	20.46	1,022,950
2022021503367	SON	USDMXN	28/02/2022	(13,000,000)	20.42	265,395,000
2022021803213	SO	USDMXN	28/02/2022	(450,000)	20.33	9,148,500
2022012103509	SO	USDMXN	01/03/2022	(2,400,000)	20.57	49,375,200
2022012103509	SO	USDMXN	01/03/2022	(2,400,000)	20.57	49,375,200
2022012103509	SO	USDMXN	01/03/2022	(2,400,000)	20.57	49,375,200
2022012803757	SO	USDMXN	01/03/2022	(2,000,000)	20.93	41,859,000
2022012803757	SO	USDMXN	01/03/2022	(2,000,000)	20.93	41,859,000
2022012803757	SO	USDMXN	01/03/2022	(2,000,000)	20.93	41,859,000
2022020203036	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.62	13,552,637
2022020203186	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.70	13,603,572
2022020203036	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.62	13,552,637
2022020203186	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.70	13,603,572
2022020203036	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.62	13,552,637
2022020203186	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.70	13,603,572
2022020803004	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.73	13,621,974
2022020803004	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.73	13,621,974
2022020803004	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.73	13,621,974
2022020903095	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.62	13,550,994
2022020903159	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.58	13,523,390
2022020903095	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.62	13,550,994
2022020903159	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.58	13,523,390
2022020903095	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.62	13,550,994
2022020903159	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.58	13,523,390
2022021003203	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.46	13,443,537
2022021003412	SO	USDMXN	01/03/2022	(19,500)	20.60	401,729
2022021003203	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.46	13,443,537
2022021003412	SO	USDMXN	01/03/2022	(19,500)	20.60	401,729
2022021003203	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.46	13,443,537
2022021003412	SO	USDMXN	01/03/2022	(19,500)	20.60	401,729
2022021103053	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.50	13,474,756
2022021103053	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.50	13,474,756
2022021103053	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.50	13,474,756

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022021403149	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.46	13,444,195
2022021403149	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.46	13,444,195
2022021403149	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.46	13,444,195
2022021503208	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.43	13,425,464
2022021503208	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.43	13,425,464
2022021503208	SON	USDMXN	01/03/2022	(657,225)	20.43	13,425,464
2022011303310	SO	USDMXN	02/03/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022011303310	SO	USDMXN	02/03/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022011303310	SO	USDMXN	02/03/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022012703709	SO	USDMXN	02/03/2022	(56,300)	20.96	1,179,879
2022012703709	SO	USDMXN	02/03/2022	(56,300)	20.96	1,179,879
2022012703709	SO	USDMXN	02/03/2022	(56,300)	20.96	1,179,879
2022013103314	SO	USDMXN	02/03/2022	(23,950)	20.82	498,615
2022013103478	SO	USDMXN	02/03/2022	(300,000)	20.92	6,275,700
2022013103314	SO	USDMXN	02/03/2022	(23,950)	20.82	498,615
2022013103478	SO	USDMXN	02/03/2022	(300,000)	20.92	6,275,700
2022013103314	SO	USDMXN	02/03/2022	(23,950)	20.82	498,615
2022013103314	SO	USDMXN	02/03/2022	(23,950)	20.82	498,615
2022013103478	SO	USDMXN	02/03/2022	(300,000)	20.92	6,275,700
2022021703207	SO	USDMXN	02/03/2022	(45,000)	20.42	919,053
2022021703207	SO	USDMXN	02/03/2022	(45,000)	20.42	919,053
2022021703207	SO	USDMXN	02/03/2022	(45,000)	20.42	919,053
2022021803340	SO	USDMXN	02/03/2022	(236,000)	20.47	4,830,826
2022021803363	SO	USDMXN	02/03/2022	(23,000)	20.47	470,801
2022021803340	SO	USDMXN	02/03/2022	(236,000)	20.47	4,830,826
2022021803363	SO	USDMXN	02/03/2022	(23,000)	20.47	470,801
2022021803340	SO	USDMXN	02/03/2022	(236,000)	20.47	4,830,826
2022021803363	SO	USDMXN	02/03/2022	(23,000)	20.47	470,801
2022022403425	B	USDMXN	02/03/2022	500,000	20.72	(10,360,000)
2022022403425	B	USDMXN	02/03/2022	500,000	20.72	(10,360,000)
2022022403425	B	USDMXN	02/03/2022	500,000	20.72	(10,360,000)
2022010503172	SO	USDMXN	03/03/2022	(12,104)	20.51	248,208
2022010503172	SO	USDMXN	03/03/2022	(12,104)	20.51	248,208
2022010503172	SO	USDMXN	03/03/2022	(12,104)	20.51	248,208
2022010603330	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.62	618,585
2022010603330	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.62	618,585
2022010603330	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.62	618,585
2022011303204	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.51	615,315
2022011303204	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.51	615,315
2022011303204	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.51	615,315
2022011403081	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.46	613,755
2022011403081	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.46	613,755
2022011403081	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.46	613,755
2022011703274	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.46	613,770
2022011703274	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.46	613,770
2022011703274	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.46	613,770
2022012703201	SO	USDMXN	03/03/2022	(773,092)	20.98	16,220,098
2022012703201	SO	USDMXN	03/03/2022	(773,092)	20.98	16,220,098
2022012703201	SO	USDMXN	03/03/2022	(773,092)	20.98	16,220,098
2022020203086	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.64	619,125
2022020203086	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.64	619,125
2022020203086	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.64	619,125
2022020303173	SO	USDMXN	03/03/2022	(57,510)	20.63	1,186,148
2022020303173	SO	USDMXN	03/03/2022	(57,510)	20.63	1,186,148
2022020303173	SO	USDMXN	03/03/2022	(57,510)	20.63	1,186,148
2022020903202	SO	USDMXN	03/03/2022	(6,300)	20.56	129,500
2022020903414	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.53	616,035
2022020903202	SO	USDMXN	03/03/2022	(6,300)	20.56	129,500
2022020903414	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.53	616,035
2022020903202	SO	USDMXN	03/03/2022	(6,300)	20.56	129,500
2022020903414	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.53	616,035

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022021003144	SO	USDMXN	03/03/2022	(100,000)	20.54	2,053,700
2022021003272	SO	USDMXN	03/03/2022	(61,000)	20.59	1,256,204
2022021003144	SO	USDMXN	03/03/2022	(100,000)	20.54	2,053,700
2022021003272	SO	USDMXN	03/03/2022	(61,000)	20.59	1,256,204
2022021003144	SO	USDMXN	03/03/2022	(100,000)	20.54	2,053,700
2022021003272	SO	USDMXN	03/03/2022	(61,000)	20.59	1,256,204
2022021503269	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.49	614,610
2022021503269	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.49	614,610
2022021503269	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.49	614,610
2022021603166	SO	USDMXN	03/03/2022	(90,000)	20.39	1,834,929
2022021603455	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.35	610,590
2022021603166	SO	USDMXN	03/03/2022	(90,000)	20.39	1,834,929
2022021603455	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.35	610,590
2022021603166	SO	USDMXN	03/03/2022	(90,000)	20.39	1,834,929
2022021603455	SO	USDMXN	03/03/2022	(30,000)	20.35	610,590
2022022403232	BO	USDMXN	03/03/2022	24,000	20.48	(491,628)
2022022403246	BO	USDMXN	03/03/2022	36,000	20.48	(737,442)
2022022403431	BO	USDMXN	03/03/2022	500,000	20.73	(10,362,500)
2022022403232	BO	USDMXN	03/03/2022	24,000	20.48	(491,628)
2022022403246	BO	USDMXN	03/03/2022	36,000	20.48	(737,442)
2022022403431	BO	USDMXN	03/03/2022	500,000	20.73	(10,362,500)
2022022403232	BO	USDMXN	03/03/2022	24,000	20.48	(491,628)
2022022403246	BO	USDMXN	03/03/2022	36,000	20.48	(737,442)
2022022403431	BO	USDMXN	03/03/2022	500,000	20.73	(10,362,500)
2022011203042	SO	USDMXN	04/03/2022	(250,000)	20.59	5,148,625
2022011203042	SO	USDMXN	04/03/2022	(250,000)	20.59	5,148,625
2022011203042	SO	USDMXN	04/03/2022	(250,000)	20.59	5,148,625
2022011403528	SO	USDMXN	04/03/2022	(65,000)	20.53	1,334,483
2022011403528	SO	USDMXN	04/03/2022	(65,000)	20.53	1,334,483
2022011403528	SO	USDMXN	04/03/2022	(65,000)	20.53	1,334,483
2022012803059	BO	USDMXN	04/03/2022	100,000	20.87	(2,087,000)
2022012803059	BO	USDMXN	04/03/2022	100,000	20.87	(2,087,000)
2022012803059	BO	USDMXN	04/03/2022	100,000	20.87	(2,087,000)
2022021603079	SO	USDMXN	04/03/2022	(50,000)	20.48	1,023,950
2022021603232	SO	USDMXN	04/03/2022	(100,000)	20.42	2,041,770
2022021603079	SO	USDMXN	04/03/2022	(50,000)	20.48	1,023,950
2022021603232	SO	USDMXN	04/03/2022	(100,000)	20.42	2,041,770
2022021603079	SO	USDMXN	04/03/2022	(50,000)	20.48	1,023,950
2022021603232	SO	USDMXN	04/03/2022	(100,000)	20.42	2,041,770
2022022403245	BO	USDMXN	04/03/2022	46,000	20.49	(942,402)
2022022403257	BO	USDMXN	04/03/2022	134,000	20.49	(2,745,258)
2022022403245	BO	USDMXN	04/03/2022	46,000	20.49	(942,402)
2022022403257	BO	USDMXN	04/03/2022	134,000	20.49	(2,745,258)
2022022403245	BO	USDMXN	04/03/2022	46,000	20.49	(942,402)
2022022403257	BO	USDMXN	04/03/2022	134,000	20.49	(2,745,258)
2022010703307	SO	USDMXN	07/03/2022	(70,000)	20.68	1,447,600
2022021603528	SO	USDMXN	07/03/2022	(300,000)	20.37	6,110,400
2022022403254	BO	USDMXN	07/03/2022	162,000	20.50	(3,320,352)
2022022403255	BO	USDMXN	07/03/2022	90,000	20.50	(1,844,640)
2022022403256	BO	USDMXN	07/03/2022	134,000	20.50	(2,746,464)
2022030103189	B	USDMXN	07/03/2022	500,000	20.58	(10,290,000)
2022013103421	SO	USDMXN	08/03/2022	(100,000)	20.79	2,079,200
2022020303432	S	EURMXN	08/03/2022	(750,000)	23.65	17,734,500
2022021003577	SO	USDMXN	08/03/2022	(2,500,000)	20.64	51,610,000
2022021003581	SO	USDMXN	08/03/2022	(2,500,000)	20.64	51,607,500
2022021603195	SO	USDMXN	08/03/2022	(70,000)	20.46	1,432,256
2022022403270	BO	USDMXN	08/03/2022	122,349	20.50	(2,508,042)
2022030203338	S	USDMXN	08/03/2022	(300,000)	20.63	6,188,400
2022011303319	SO	USDMXN	09/03/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022020803441	SO	USDMXN	09/03/2022	(51,000)	20.78	1,059,525

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022021703206	SO	USDMXN	09/03/2022	(45,000)	20.45	920,160
2022021803339	SO	USDMXN	09/03/2022	(236,000)	20.47	4,830,826
2022021803362	SO	USDMXN	09/03/2022	(23,000)	20.47	470,801
2022022303170	SO	USDMXN	09/03/2022	(1,800,000)	20.45	36,810,000
2022010503252	SO	USDMXN	10/03/2022	(210,000)	20.67	4,341,330
2022011303203	SO	USDMXN	10/03/2022	(30,000)	20.54	616,095
2022011403411	SO	USDMXN	10/03/2022	(210,000)	20.51	4,306,260
2022011703273	SO	USDMXN	10/03/2022	(30,000)	20.49	614,550
2022012703200	SO	USDMXN	10/03/2022	(773,092)	20.98	16,220,098
2022020203085	SO	USDMXN	10/03/2022	(30,000)	20.66	619,905
2022020203181	SO	USDMXN	10/03/2022	(210,000)	20.73	4,354,140
2022020903413	SO	USDMXN	10/03/2022	(30,000)	20.56	616,815
2022021603167	SO	USDMXN	10/03/2022	(90,000)	20.41	1,837,197
2022021603457	SO	USDMXN	10/03/2022	(30,000)	20.38	611,346
2022021703228	SO	USDMXN	10/03/2022	(50,000)	20.41	1,020,285
2022022203015	SO	USDMXN	10/03/2022	(60,000)	20.38	1,222,620
2022011203046	SO	USDMXN	11/03/2022	(250,000)	20.62	5,155,000
2022011403527	SO	USDMXN	11/03/2022	(130,000)	20.56	2,672,410
2022012803702	BO	USDMXN	11/03/2022	150,000	20.96	(3,144,000)
2022021103278	SO	USDMXN	11/03/2022	(200,000)	20.51	4,101,200
2022021603160	SO	USDMXN	11/03/2022	(1,000,000)	20.39	20,391,000
2022021603231	SO	USDMXN	11/03/2022	(100,000)	20.44	2,044,070
2022022203284	SO	USDMXN	11/03/2022	(30,000)	20.40	612,135
2022022403273	BO	USDMXN	11/03/2022	133,000	20.51	(2,727,564)
2022022203287	SO	USDMXN	14/03/2022	(20,000)	20.42	408,300
2022022303222	SON	USDMXN	14/03/2022	(674,859)	20.29	13,695,589
2022022303229	SO	USDMXN	14/03/2022	(40,000)	20.28	811,280
2022022403288	BO	USDMXN	14/03/2022	167,000	20.52	(3,426,339)
2022022403289	BO	USDMXN	14/03/2022	150,000	20.52	(3,077,550)
2022022403299	BO	USDMXN	14/03/2022	134,000	20.52	(2,749,278)
2022011303602	SON	USDMXN	15/03/2022	(5,066,364)	20.52	103,946,590
2022012703687	BON	USDMXN	15/03/2022	2,496,555	20.94	(52,285,345)
2022020203090	BO	USDMXN	15/03/2022	200,000	20.70	(4,139,000)
2022021003411	SO	USDMXN	15/03/2022	(71,000)	20.65	1,466,292
2022021103542	S	EURMXN	15/03/2022	(1,000,000)	23.42	23,421,000
2022021103551	S	USDMXN	15/03/2022	(4,000,000)	20.64	82,550,000
2022022303228	SO	USDMXN	15/03/2022	(10,000)	20.29	202,850
2022022303230	SO	USDMXN	15/03/2022	(50,000)	20.28	1,014,000
2022022403097	BO	USDMXN	15/03/2022	100,000	20.67	(2,066,600)
2022022403298	BO	USDMXN	15/03/2022	59,000	20.52	(1,210,680)
2022022403316	BO	USDMXN	15/03/2022	122,000	20.52	(2,503,440)
2022022403317	BO	USDMXN	15/03/2022	90,000	20.52	(1,846,800)
2022022403318	BO	USDMXN	15/03/2022	155,000	20.52	(3,180,600)
2022022403620	BON	USDMXN	15/03/2022	156,145	20.67	(3,227,819)
2022022503317	SON	USDMXN	15/03/2022	(2,235,593)	20.46	45,733,518
2022030203228	SO	USDMXN	15/03/2022	(51,000)	20.77	1,059,041
2022030903150	S	USDMXN	15/03/2022	(256,175)	21.00	5,379,669
2022011303325	SO	USDMXN	16/03/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022012703392	SO	USDMXN	16/03/2022	(101,910)	21.51	2,191,697
2022012703393	SO	USDMXN	16/03/2022	(198,470)	21.51	4,268,336
2022012703394	SO	USDMXN	16/03/2022	(75,732)	21.51	1,628,708
2022012703395	SO	USDMXN	16/03/2022	(71,138)	21.51	1,529,908
2022012703396	SO	USDMXN	16/03/2022	(87,297)	21.51	1,877,427
2022012703397	SO	USDMXN	16/03/2022	(283,271)	21.51	6,092,083
2022012703398	SO	USDMXN	16/03/2022	(81,080)	21.51	1,743,723
2022012803181	SO	USDMXN	16/03/2022	(727,902)	21.62	15,735,785
2022012803182	SO	USDMXN	16/03/2022	(124,465)	21.62	2,690,684
2022012803183	SO	USDMXN	16/03/2022	(80,943)	21.62	1,749,826
2022012803184	SO	USDMXN	16/03/2022	(226,609)	21.62	4,898,833
2022012803568	SO	USDMXN	16/03/2022	(62,059)	21.62	1,341,560

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022012803569	SO	USDMXN	16/03/2022	(114,468)	21.62	2,474,512
2022012803570	SO	USDMXN	16/03/2022	(70,114)	21.62	1,515,689
2022012803571	SO	USDMXN	16/03/2022	(82,547)	21.62	1,784,460
2022012803694	SO	USDMXN	16/03/2022	(291,379)	21.61	6,295,243
2022013103512	SO	USDMXN	16/03/2022	(97,232)	21.34	2,074,513
2022013103624	SO	USDMXN	16/03/2022	(35,115)	21.32	748,733
2022020203246	SO	USDMXN	16/03/2022	(31,682)	21.31	675,270
2022020203247	SO	USDMXN	16/03/2022	(80,555)	21.31	1,716,949
2022020203493	SO	USDMXN	16/03/2022	(62,251)	21.28	1,324,490
2022020203494	SO	USDMXN	16/03/2022	(80,158)	21.28	1,705,490
2022020403066	SO	USDMXN	16/03/2022	(75,755)	21.39	1,620,021
2022020403067	SO	USDMXN	16/03/2022	(158,165)	21.39	3,382,359
2022020403068	SO	USDMXN	16/03/2022	(12,217)	21.39	261,261
2022020803513	SO	USDMXN	16/03/2022	(61,268)	21.30	1,305,192
2022021003310	SO	USDMXN	16/03/2022	(26,300)	20.63	542,490
2022021603319	SO	USDMXN	16/03/2022	(22,150)	20.47	453,300
2022021703177	SO	USDMXN	16/03/2022	(78,549)	21.05	1,653,142
2022021803338	SO	USDMXN	16/03/2022	(236,000)	20.47	4,830,826
2022021803361	SO	USDMXN	16/03/2022	(23,000)	20.47	470,801
2022021803505	SO	USDMXN	16/03/2022	(42,650)	20.43	871,212
2022022303663	SO	USDMXN	16/03/2022	(803,785)	21.00	16,878,922
2022022303677	SO	USDMXN	16/03/2022	(744,029)	21.00	15,624,088
2022022303701	SO	USDMXN	16/03/2022	(1,887,121)	21.00	39,628,220
2022022503557	SO	USDMXN	16/03/2022	(117,550)	21.07	2,477,249
2022022503558	SO	USDMXN	16/03/2022	(240,075)	21.07	5,059,341
2022011703272	SO	USDMXN	17/03/2022	(30,000)	20.51	615,330
2022011703441	SO	USDMXN	17/03/2022	(30,000)	20.52	615,570
2022012703199	SO	USDMXN	17/03/2022	(773,092)	20.98	16,220,098
2022020203084	SO	USDMXN	17/03/2022	(30,000)	20.69	620,685
2022020903412	SO	USDMXN	17/03/2022	(30,000)	20.59	617,610
2022021603168	SO	USDMXN	17/03/2022	(90,000)	20.44	1,839,375
2022021603459	SO	USDMXN	17/03/2022	(30,000)	20.40	612,096
2022022203017	SO	USDMXN	17/03/2022	(60,000)	20.40	1,224,060
2022030203373	BO	USDMXN	17/03/2022	105,000	20.58	(2,160,428)
2022011203047	SO	USDMXN	18/03/2022	(250,000)	20.65	5,161,750
2022011403534	SO	USDMXN	18/03/2022	(130,000)	20.58	2,675,790
2022011703067	SO	USDMXN	18/03/2022	(100,000)	20.52	2,052,200
2022011703068	SO	USDMXN	18/03/2022	(100,000)	20.52	2,052,200
2022011703069	SO	USDMXN	18/03/2022	(100,000)	20.52	2,052,200
2022012803703	BO	USDMXN	18/03/2022	100,000	21.00	(2,100,000)
2022020903622	SO	USDMXN	18/03/2022	(2,000,000)	20.58	41,152,000
2022021603230	SO	USDMXN	18/03/2022	(100,000)	20.47	2,047,100
2022021703182	SO	USDMXN	18/03/2022	(1,000,000)	20.42	20,422,700
2022022303717	SO	USDMXN	18/03/2022	(1,000,000)	20.35	20,346,000
2022022503590	SO	USDMXN	18/03/2022	(50,000)	20.50	1,024,750
2022022803398	BO	USDMXN	18/03/2022	957,938	20.57	(19,700,000)
2022030203372	BO	USDMXN	18/03/2022	134,000	20.58	(2,757,519)
2022030903059	B	USDMXN	18/03/2022	20,000,000	21.10	(421,902,000)
2022012603425	SO	USDMXN	22/03/2022	(99,254)	21.03	2,087,069
2022021603194	SO	USDMXN	22/03/2022	(50,000)	20.51	1,025,600
2022021803039	SO	USDMXN	22/03/2022	(60,000)	20.53	1,231,728
2022030203370	BO	USDMXN	22/03/2022	134,000	20.59	(2,759,395)
2022030203371	BO	USDMXN	22/03/2022	155,000	20.59	(3,191,838)
2022030203227	SO	USDMXN	22/03/2022	(51,000)	20.79	1,060,316
2022030303311	SO	USDMXN	22/03/2022	(64,000)	20.93	1,339,200
2022030403472	S	USDMXN	22/03/2022	(750,000)	21.01	15,756,000
2022030703274	S	EURMXN	22/03/2022	(750,000)	23.16	17,371,875
2022030703226	B	USDMXN	22/03/2022	750,000	21.26	(15,945,750)
2022030803522	BO	USDMXN	22/03/2022	122,000	21.17	(2,582,252)
2022030903315	SO	USDMXN	22/03/2022	(35,000)	21.05	736,680

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022031103277	SO	USDMXN	22/03/2022	(60,000)	20.94	1,256,520
2022031403197	SO	USDMXN	22/03/2022	(30,000)	20.99	629,790
2022031603030	S	USDMXN	22/03/2022	(300,000)	20.80	6,240,000
2022031603031	S	USDMXN	22/03/2022	(300,000)	20.80	6,240,000
2022011303327	SO	USDMXN	23/03/2022	(500,000)	20.50	10,248,900
2022020803075	BO	USDMXN	23/03/2022	150,000	20.79	(3,118,950)
2022021703205	SO	USDMXN	23/03/2022	(45,000)	20.50	922,491
2022021803337	SO	USDMXN	23/03/2022	(236,000)	20.47	4,830,826
2022021803360	SO	USDMXN	23/03/2022	(23,000)	20.47	470,801
2022022403400	SO	USDMXN	23/03/2022	(22,150)	20.85	461,783
2022031103276	SO	USDMXN	23/03/2022	(30,000)	20.95	628,380
2022031403199	SO	USDMXN	23/03/2022	(30,000)	21.00	629,895
2022031603235	S	USDMXN	23/03/2022	(150,000)	20.73	3,108,900
2022011703440	SO	USDMXN	24/03/2022	(60,000)	20.55	1,232,760
2022012703198	SO	USDMXN	24/03/2022	(773,092)	20.98	16,220,098
2022020203083	SO	USDMXN	24/03/2022	(30,000)	20.72	621,450
2022020903411	SO	USDMXN	24/03/2022	(30,000)	20.61	618,390
2022021603171	SO	USDMXN	24/03/2022	(90,000)	20.46	1,841,724
2022021603461	SO	USDMXN	24/03/2022	(30,000)	20.43	612,870
2022022203021	SO	USDMXN	24/03/2022	(60,000)	20.43	1,225,530
2022022303173	SO	USDMXN	24/03/2022	(1,800,000)	20.45	36,810,000
2022030803600	BO	USDMXN	24/03/2022	125,000	21.17	(2,646,750)
2022031103275	SO	USDMXN	24/03/2022	(60,000)	20.95	1,257,000
2022031803003	S	USDMXN	24/03/2022	(300,000)	20.51	6,152,700
2022031803004	S	USDMXN	24/03/2022	(300,000)	20.51	6,152,700
2022031803497	S	USDMXN	24/03/2022	(253,000)	20.39	5,158,619
2022010503251	SO	USDMXN	25/03/2022	(210,000)	20.73	4,353,720
2022011203048	SO	USDMXN	25/03/2022	(250,000)	20.67	5,168,375
2022011403410	SO	USDMXN	25/03/2022	(210,000)	20.56	4,318,125
2022011403537	SO	USDMXN	25/03/2022	(65,000)	20.61	1,339,618
2022012703603	BO	USDMXN	25/03/2022	200,000	20.97	(4,194,000)
2022020203095	BO	USDMXN	25/03/2022	200,000	20.71	(4,142,600)
2022020203180	SO	USDMXN	25/03/2022	(210,000)	20.79	4,365,690
2022021403284	SO	USDMXN	25/03/2022	(100,000)	20.56	2,055,950
2022021403285	SO	USDMXN	25/03/2022	(100,000)	20.56	2,055,950
2022021403286	SO	USDMXN	25/03/2022	(150,000)	20.56	3,083,925
2022021403287	SO	USDMXN	25/03/2022	(150,000)	20.56	3,083,925
2022021603229	SO	USDMXN	25/03/2022	(100,000)	20.49	2,049,350
2022021603283	SO	USDMXN	25/03/2022	(50,000)	20.50	1,025,185
2022021603284	SO	USDMXN	25/03/2022	(50,000)	20.50	1,025,185
2022021603285	SO	USDMXN	25/03/2022	(100,000)	20.50	2,050,370
2022021603286	SO	USDMXN	25/03/2022	(100,000)	20.50	2,050,370
2022021803218	SO	USDMXN	25/03/2022	(300,000)	20.44	6,132,000
2022022203260	SO	USDMXN	25/03/2022	(1,900,000)	20.38	38,720,100
2022022203262	SO	USDMXN	25/03/2022	(530,000)	20.38	10,800,870
2022030803530	BO	USDMXN	25/03/2022	139,000	21.18	(2,943,603)
2022030803531	BO	USDMXN	25/03/2022	103,000	21.18	(2,181,231)
2022030803545	BO	USDMXN	25/03/2022	139,000	21.18	(2,943,603)
2022031403198	SO	USDMXN	25/03/2022	(40,000)	21.00	840,160
2022031403200	SO	USDMXN	25/03/2022	(60,000)	20.95	1,257,240
2022031803001	S	USDMXN	25/03/2022	(300,000)	20.52	6,154,800
2022031803002	S	USDMXN	25/03/2022	(300,000)	20.52	6,154,800
2022020303550	B	USDMXN	09/02/2022	500,000	20.56	(10,278,430)
2022020403186	B	USDMXN	10/02/2022	3,500,000	20.78	(72,720,900)
2022031703002	B	USDMXN	23/03/2022	3,150,000	20.65	(65,044,980)

Liquidados anticipadamente

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
C67351	CC Swap	jun-26	Buy	U	USD	5,000,000	USD	94,075,000	MXN	
C67352	CC Swap	ago-26	Buy	U	USD	19,950,000	USD	376,286,925	MXN	
C67353	CC Swap	abr-24	Buy	U	USD	4,500,000	USD	84,903,750	MXN	
C67354	CC Swap	sep-26	Buy	U	USD	134,785,000	MXN	7,000,000	USD	
C67361	CC Swap	ago-26	Buy	U	USD	376,286,925	MXN	19,950,000	USD	
C67363	CC Swap	jun-26	Buy	U	USD	94,075,000	MXN	5,000,000	USD	
C67366	CC Swap	ene-26	Buy	U	USD	20,000,000	USD	393,960,000	MXN	
C67372	CC Swap	abr-24	Buy	U	USD	84,903,750	MXN	4,500,000	USD	
C67373	CC Swap	ene-26	Buy	U	USD	393,960,000	MXN	20,000,000	USD	
C67385	CC Swap	sep-26	Buy	U	USD	7,000,000	USD	134,785,000	MXN	
C67396	CC Swap	ene-26	Buy	U	USD	385,230,000	MXN	20,000,000	USD	
C67397	CC Swap	ene-26	Buy	U	USD	20,000,000	USD	385,230,000	MXN	
C75755	CC Swap	feb-23	Buy	U	USD	713,639,500	MXN	35,000,000	USD	
C76143	CC Swap	oct-25	Buy	U	USD	164,614,500	MXN	7,850,000	USD	
C76144	CC Swap	oct-25	Buy	U	USD	7,850,000	USD	164,614,500	MXN	
C76206	CC Swap	abr-25	Buy	U	USD	147,609,000	MXN	6,930,000	USD	
C76337	CC Swap	abr-25	Buy	U	USD	6,930,000	USD	147,609,000	MXN	
E68033	Eq Option	feb-22	Sell	U	MXN					89,440,000
E69590	Eq Option	feb-22	Buy	U	MXN					89,440,000
E73032	Eq Option	may-23	Buy	U	MXN					789,810,000
E73033	Eq Option	may-23	Sell	U	MXN					789,810,000
E73034	Eq Option	may-23	Sell	U	MXN					789,810,000
E73035	Eq Option	may-23	Buy	U	MXN					789,810,000
E73036	Eq Option	abr-24	Sell	U	MXN					494,650,000
E73037	Eq Option	abr-24	Sell	U	MXN					494,650,000
E73038	Eq Option	abr-24	Buy	U	MXN					494,650,000
E73039	Eq Option	abr-24	Buy	U	MXN					494,650,000
E74340	Eq Option	mar-23	Buy	U	MXN					648,191,000
E74341	Eq Option	mar-23	Sell	U	MXN					648,191,000
E74342	Eq Option	mar-23	Sell	U	MXN					648,191,000
E74343	Eq Option	mar-23	Buy	U	MXN					648,191,000
E75700	Eq Option	mar-23	Buy	U	MXN					647,691,000
E75701	Eq Option	mar-23	Sell	U	MXN					647,691,000
E75702	Eq Option	mar-23	Sell	U	MXN					647,691,000
E75703	Eq Option	mar-23	Buy	U	MXN					647,691,000
MNF324	Term Deposit	ene-24	Buy	U	USD			95,500,000	USD	
MNF342	Term Deposit	oct-22	Buy	U	MXN			171,491,749	MXN	
P17013	Cap	dic-22	Sell	U	MXN					33,333,333
P17014	Cap	dic-22	Buy	U	MXN					33,333,333
P17284	Cap	ago-23	Sell	U	MXN					50,000,000
P17285	Cap	ago-23	Buy	U	MXN					50,000,000
SDR912	SC Swap	oct-22	Buy	U	MXN	12,700,000	MXN	12,700,000	MXN	
SDS001	SC Swap	mar-27	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS013	SC Swap	oct-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS042	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	231,500,000	MXN	231,500,000	MXN	
SDS046	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	526,216,790	MXN	526,216,790	MXN	
SDS069	SC Swap	ago-22	Buy	U	MXN	310,658,329	MXN	310,658,329	MXN	
SDS093	SC Swap	oct-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS098	SC Swap	oct-27	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS101	SC Swap	feb-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS109	SC Swap	nov-24	Buy	U	MXN	9,333,344	MXN	9,333,344	MXN	
SDS122	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS177	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	9,000,000	MXN	9,000,000	MXN	
SDS189	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS199	SC Swap	sep-24	Buy	U	MXN	120,000,000	MXN	120,000,000	MXN	
SDS231	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS244	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	180,000,000	MXN	180,000,000	MXN	
SDS286	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	600,000,000	MXN	600,000,000	MXN	
SDS350	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	180,000,000	MXN	180,000,000	MXN	
SDS481	SC Swap	oct-23	Buy	U	MXN	16,000,000	MXN	16,000,000	MXN	
SDS494	SC Swap	oct-23	Buy	U	MXN	16,000,000	MXN	16,000,000	MXN	
SDS514	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS537	SC Swap	ago-23	Buy	U	MXN	1,500,000	MXN	1,500,000	MXN	
SDS543	SC Swap	ago-23	Buy	U	MXN	1,500,000	MXN	1,500,000	MXN	
SDS558	SC Swap	sep-28	Buy	U	MXN	86,935,840	MXN	86,935,840	MXN	
SDS573	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDS620	SC Swap	nov-23	Buy	U	MXN	65,000,000	MXN	65,000,000	MXN	
SDS623	SC Swap	nov-27	Buy	U	MXN	81,209,080	MXN	81,209,080	MXN	
SDS689	SC Swap	nov-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS724	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	26,000,000	MXN	26,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDS731	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	26,000,000	MXN	26,000,000	MXN	
SDS766	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	115,000,000	MXN	115,000,000	MXN	
SDS787	SC Swap	oct-23	Buy	U	MXN	42,000,000	MXN	42,000,000	MXN	
SDS790	SC Swap	oct-23	Buy	U	MXN	42,000,000	MXN	42,000,000	MXN	
SDS792	SC Swap	abr-22	Buy	U	USD	50,000,000	USD	50,000,000	USD	
SDS793	SC Swap	abr-22	Buy	U	USD	50,000,000	USD	50,000,000	USD	
SDS795	SC Swap	feb-29	Buy	U	MXN	35,300,000	MXN	35,300,000	MXN	
SDS798	SC Swap	nov-22	Buy	U	MXN	87,500,000	MXN	87,500,000	MXN	
SDS800	SC Swap	oct-22	Buy	U	MXN	1	MXN	1	MXN	
SDS807	SC Swap	nov-22	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDS812	SC Swap	jun-25	Buy	U	MXN	95,000,000	MXN	95,000,000	MXN	
SDS818	SC Swap	feb-29	Buy	U	MXN	32,700,000	MXN	32,700,000	MXN	
SDS826	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	600,000,000	MXN	600,000,000	MXN	
SDS836	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	600,000,000	MXN	600,000,000	MXN	
SDS864	SC Swap	nov-22	Buy	U	MXN	285,000,000	MXN	285,000,000	MXN	
SDS872	SC Swap	nov-27	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS873	SC Swap	nov-32	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDS903	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDS921	SC Swap	nov-30	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDS948	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT032	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SDT037	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDT048	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	3,143,028,382	MXN	3,143,028,382	MXN	
SDT076	SC Swap	ago-22	Buy	U	MXN	85,000,000	MXN	85,000,000	MXN	
SDT107	SC Swap	nov-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT133	SC Swap	nov-22	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDT171	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	1	MXN	1	MXN	
SDT176	SC Swap	nov-24	Buy	U	MXN	25,237,510	MXN	25,237,510	MXN	
SDT186	SC Swap	oct-22	Buy	U	MXN	171,491,749	MXN	171,491,749	MXN	
SDT187	SC Swap	oct-22	Buy	U	MXN	171,491,749	MXN	171,491,749	MXN	
SDT191	SC Swap	mar-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT203	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	154,166,000	MXN	154,166,000	MXN	
SDT204	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT231	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT257	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT270	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT272	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT288	SC Swap	ago-22	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDT299	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	140,000,000	MXN	140,000,000	MXN	
SDT301	SC Swap	may-24	Buy	U	MXN	16,500,000	MXN	16,500,000	MXN	
SDT303	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	35,000,000	MXN	35,000,000	MXN	
SDT312	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT325	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT338	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT340	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT345	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT365	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDT368	SC Swap	abr-22	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDT369	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	4,000,000	MXN	4,000,000	MXN	
SDT371	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDT382	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDT401	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT405	SC Swap	abr-28	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT417	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT443	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT445	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT449	SC Swap	dic-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT452	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT471	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT477	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDT486	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT528	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT537	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT544	SC Swap	may-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT548	SC Swap	dic-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT576	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDT683	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT684	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT693	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDT722	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDT727	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT757	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT759	SC Swap	sep-22	Buy	U	MXN	225,000,000	MXN	225,000,000	MXN	
SDT761	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT775	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT785	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT788	SC Swap	nov-27	Buy	U	MXN	35,952,000	MXN	35,952,000	MXN	
SDT791	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT796	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT805	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT808	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDT810	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDT811	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT821	SC Swap	jul-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT831	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDT834	SC Swap	abr-23	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDT836	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT851	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT858	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT868	SC Swap	may-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT871	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	120,000,000	MXN	120,000,000	MXN	
SDT881	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT893	SC Swap	dic-26	Buy	U	MXN	120,726,667	MXN	120,726,667	MXN	
SDT896	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDT899	SC Swap	jul-23	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDT901	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT930	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT960	SC Swap	may-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT985	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU009	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU049	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU050	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU055	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU061	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU077	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU086	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU103	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDU113	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU116	SC Swap	abr-22	Buy	U	MXN	350,000,000	MXN	350,000,000	MXN	
SDU119	SC Swap	nov-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU121	SC Swap	feb-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU132	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU154	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU174	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU189	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU198	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDU204	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	310,000,000	MXN	310,000,000	MXN	
SDU227	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU228	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU231	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU262	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDU277	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU280	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU287	SC Swap	ago-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU301	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU307	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU314	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDU318	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU319	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU335	SC Swap	abr-31	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU339	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU354	SC Swap	ago-27	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU368	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDU376	SC Swap	abr-22	Buy	U	MXN	710,000,000	MXN	710,000,000	MXN	
SDU387	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDU392	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU400	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU406	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU437	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU438	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDU441	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU449	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	1	MXN	1	MXN	
SDU453	SC Swap	sep-22	Buy	U	MXN	140,000,000	MXN	140,000,000	MXN	
SDU470	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU471	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDU475	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU476	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU477	SC Swap	dic-24	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDU490	SC Swap	sep-24	Buy	U	MXN	132,000,000	MXN	132,000,000	MXN	
SDU506	SC Swap	ago-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU514	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	414,129,324	MXN	414,129,324	MXN	
SDU515	SC Swap	may-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU520	SC Swap	jun-26	Buy	U	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDU524	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU532	SC Swap	dic-24	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDU535	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU540	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU542	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU548	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDU556	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDU564	SC Swap	jun-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU582	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU583	SC Swap	ene-24	Buy	U	USD	95,500,000	USD	95,500,000	USD	
SDU587	SC Swap	ene-24	Buy	U	USD	95,500,000	USD	95,500,000	USD	
SDU597	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU599	SC Swap	ene-24	Buy	U	USD	95,500,000	USD	95,500,000	USD	
SDU600	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	458,399,361	MXN	458,399,361	MXN	
SDU610	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU626	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU628	SC Swap	jun-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU631	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU643	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDU650	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU651	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU656	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU673	SC Swap	ene-24	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU680	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU684	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	252,000,000	MXN	252,000,000	MXN	
SDU692	SC Swap	jun-26	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDU702	SC Swap	ago-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU703	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU709	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU716	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU717	SC Swap	ene-24	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDU742	SC Swap	dic-24	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDU755	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU760	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU773	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU781	SC Swap	mar-24	Buy	U	MXN	120,000,000	MXN	120,000,000	MXN	
SDU788	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU800	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU806	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU815	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SDU824	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU839	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU849	SC Swap	ene-28	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU855	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU916	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU946	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU952	SC Swap	sep-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU957	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU988	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU996	SC Swap	feb-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV001	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDV013	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV017	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV027	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV053	SC Swap	mar-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV055	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV086	SC Swap	may-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDV089	SC Swap	feb-22	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDV101	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV112	SC Swap	oct-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV113	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV142	SC Swap	dic-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV188	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV189	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV191	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	223,549,140	MXN	223,549,140	MXN	
SDV198	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV225	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV242	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV244	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV255	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV259	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDV271	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDV275	SC Swap	feb-28	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV287	SC Swap	abr-23	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDV294	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV300	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	91,500,000	MXN	91,500,000	MXN	
SDV301	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	91,500,000	MXN	91,500,000	MXN	
SDV303	SC Swap	dic-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV308	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	24,163,895	MXN	24,163,895	MXN	
SDV311	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	90,000,000	MXN	90,000,000	MXN	
SDV312	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV331	SC Swap	oct-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV337	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV363	SC Swap	dic-23	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV364	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV369	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV373	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	75,000,000	MXN	75,000,000	MXN	
SDV375	SC Swap	oct-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV381	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV382	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV408	SC Swap	dic-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV409	SC Swap	oct-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV419	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV431	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV450	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	155,000,000	MXN	155,000,000	MXN	
SDV499	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV526	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV530	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV593	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV607	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDV612	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV624	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	350,000,000	MXN	350,000,000	MXN	
SDV630	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV633	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV636	SC Swap	oct-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV639	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	109,038,997	MXN	109,038,997	MXN	
SDV646	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV653	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV677	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDV679	SC Swap	oct-24	Buy	U	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN	
SDV685	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV690	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	90,000,000	MXN	90,000,000	MXN	
SDV698	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV702	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV708	SC Swap	oct-24	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV714	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV734	SC Swap	oct-24	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV739	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV743	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDV752	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV798	SC Swap	oct-22	Buy	U	MXN	203,841,054	MXN	203,841,054	MXN	
SDV800	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV801	SC Swap	may-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV805	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV808	SC Swap	jun-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV824	SC Swap	oct-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV826	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDV828	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDV832	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV848	SC Swap	dic-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV850	SC Swap	oct-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV854	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV855	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDV866	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDV873	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV888	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDV900	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV901	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDV906	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV911	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDV922	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV948	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV963	SC Swap	ago-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV971	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV983	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV984	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV987	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW003	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW006	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDW024	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW026	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW037	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW038	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW042	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW045	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDW056	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW072	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDW080	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW081	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDW084	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW092	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW097	SC Swap	jun-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW102	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW106	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW111	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	225,000,000	MXN	225,000,000	MXN	
SDW123	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDW130	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	65,000,000	MXN	65,000,000	MXN	
SDW131	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW140	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	400,000,000	MXN	400,000,000	MXN	
SDW142	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW156	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDW165	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW169	SC Swap	ago-27	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW175	SC Swap	jun-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW187	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW197	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDW202	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDW220	SC Swap	jul-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW221	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW240	SC Swap	ago-24	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW255	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW273	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW274	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW322	SC Swap	jul-24	Buy	U	MXN	55,000,000	MXN	55,000,000	MXN	
SDW323	SC Swap	dic-24	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW334	SC Swap	ago-22	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDW344	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW346	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW351	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW366	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW377	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW398	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDW439	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW442	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW457	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW461	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW470	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDW472	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDW473	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW477	SC Swap	jun-23	Buy	U	MXN	120,000,000	MXN	120,000,000	MXN	
SDW485	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW499	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDW500	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDW506	SC Swap	abr-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW514	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW532	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW536	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW542	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDW555	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW562	SC Swap	abr-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW572	SC Swap	jun-28	Buy	U	MXN	47,460,000	MXN	47,460,000	MXN	
SDW574	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW584	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW609	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW622	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW632	SC Swap	may-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW634	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW656	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW658	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW665	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDW670	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW683	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDW698	SC Swap	ene-27	Buy	U	MXN	45,000,000	MXN	45,000,000	MXN	
SDW705	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDW720	SC Swap	may-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW728	SC Swap	feb-24	Buy	U	MXN	115,000,000	MXN	115,000,000	MXN	
SDW741	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW744	SC Swap	may-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW746	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDW763	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW766	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW771	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW782	SC Swap	abr-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW790	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDW802	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW811	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW839	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW858	SC Swap	ago-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW864	SC Swap	feb-23	Buy	U	MXN	325,000,000	MXN	325,000,000	MXN	
SDW871	SC Swap	may-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW892	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW893	SC Swap	jun-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW897	SC Swap	may-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW900	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW911	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDW923	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW936	SC Swap	jul-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW944	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW947	SC Swap	nov-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW964	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW976	SC Swap	may-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW981	SC Swap	mar-23	Buy	U	MXN	75,000,000	MXN	75,000,000	MXN	
SDW982	SC Swap	jun-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW983	SC Swap	nov-23	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW998	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDX001	SC Swap	jun-26	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDX006	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX016	SC Swap	nov-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX037	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDX038	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDX045	SC Swap	sep-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX050	SC Swap	ene-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDX051	SC Swap	may-23	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX056	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX060	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX066	SC Swap	dic-23	Buy	U	MXN	91,000,000	MXN	91,000,000	MXN	
SDX067	SC Swap	sep-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDX075	SC Swap	dic-23	Buy	U	MXN	41,000,000	MXN	41,000,000	MXN	
SDX079	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX097	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDX119	SC Swap	nov-25	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDX120	SC Swap	may-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX121	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX123	SC Swap	dic-23	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX130	SC Swap	dic-23	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX134	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDX136	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDX137	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX138	SC Swap	dic-23	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX140	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDX145	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX147	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX155	SC Swap	ene-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX160	SC Swap	ene-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX166	SC Swap	ene-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX169	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	120,000,000	MXN	120,000,000	MXN	
SDX174	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDX175	SC Swap	feb-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX176	SC Swap	ene-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDX178	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX180	SC Swap	ene-25	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDX187	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDX192	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX201	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX203	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX207	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDX214	SC Swap	feb-24	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX222	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDX230	SC Swap	feb-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDX231	SC Swap	feb-24	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDX233	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX235	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX236	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	310,000,000	MXN	310,000,000	MXN	
SDX237	SC Swap	ago-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX240	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX243	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX251	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX255	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDX268	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX270	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX277	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX302	SC Swap	mar-24	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX305	SC Swap	mar-24	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX311	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	350,000,000	MXN	350,000,000	MXN	
SDX314	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	290,000,000	MXN	290,000,000	MXN	
SDX332	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDX338	SC Swap	may-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX339	SC Swap	mar-24	Buy	U	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDX340	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX342	SC Swap	mar-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX347	SC Swap	ene-24	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX355	SC Swap	dic-25	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX356	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	40,000,000	MXN	40,000,000	MXN	
SDX386	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX433	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDX564	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDY520	SC Swap	dic-23	Buy	U	MXN	249,685,346	MXN	249,685,346	MXN	

Trans ID	Trans Product ID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SEA117	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SEB364	SC Swap	jun-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SEB944	SC Swap	jun-31	Buy	U	MXN	25,000,000	MXN	25,000,000	MXN	
SED498	SC Swap	dic-26	Buy	U	MXN	58,333,333	MXN	58,333,333	MXN	
SEG070	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	337,500,000	MXN	337,500,000	MXN	
SEO901	SC Swap	jul-26	Buy	U	MXN	218,277,669	MXN	218,277,669	MXN	
SEP454	SC Swap	ago-22	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SER306	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	2,000,000,000	MXN	2,000,000,000	MXN	
SER314	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SES393	SC Swap	sep-31	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SES978	SC Swap	jun-22	Buy	U	MXN	350,000,000	MXN	350,000,000	MXN	
SEV744	SC Swap	mar-22	Buy	U	MXN	2,500,000,000	MXN	2,500,000,000	MXN	
SEW483	SC Swap	oct-23	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SEX244	SC Swap	dic-26	Buy	U	MXN	77,777,778	MXN	77,777,778	MXN	
SEY773	SC Swap	oct-22	Buy	U	MXN	450,000,000	MXN	450,000,000	MXN	
SFF718	SC Swap	dic-24	Buy	U	MXN	115,000,000	MXN	115,000,000	MXN	
SFG138	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	325,000,000	MXN	325,000,000	MXN	
SFG318	SC Swap	may-28	Buy	U	MXN	4,283,500	MXN	4,283,500	MXN	
SFT602	SC Swap	ene-25	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SFW836	SC Swap	ene-27	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SFW837	SC Swap	ene-27	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SFX162	SC Swap	ene-25	Buy	U	MXN	28,299,950	MXN	28,299,950	MXN	
SFX313	SC Swap	feb-27	Buy	U	MXN	78,000,000	MXN	78,000,000	MXN	
SFY667	SC Swap	feb-24	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SFY819	SC Swap	ene-26	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SFY851	SC Swap	feb-23	Buy	U	USD	4,500,000	USD	4,500,000	USD	

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

Cifras expresadas en pesos

Deal	Producto	Fecha de evento	Contraparte/ Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
SAK055	Interest Rate Swap	ene-22	Cliente 1	MXN	915,332	NO FONDEO SU CUENTA
SX6539	Interest Rate Swap	ene-22	Cliente 2	MXN	1,032,927	NO FONDEO SU CUENTA
SAK055	Interest Rate Swap	feb-22	Cliente 3	MXN	903,565	NO FONDEO SU CUENTA
SX6539	Interest Rate Swap	feb-22	Cliente 4	MXN	863,719	NO FONDEO SU CUENTA
C67387	Cross Currency Swaps	feb-22	Cliente 5	MXN	2,172,412	TIENE TEMAS DE LIQUIDEZ ENVIÓ CORREO CON CARTA
C67387	Cross Currency Swaps	feb-22	Cliente 6	MXN	271,695	TIENE TEMAS DE LIQUIDEZ ENVIÓ CORREO CON CARTA
C67390	Cross Currency Swaps	mar-22	Cliente 7	MXN	69,003	TIENE TEMAS DE LIQUIDEZ ENVIÓ CORREO CON CARTA
C67390	Cross Currency Swaps	mar-22	Cliente 8	MXN	11,536,796	TIENE TEMAS DE LIQUIDEZ ENVIÓ CORREO CON CARTA
SDT815	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente 9	MXN	14,315	NO ENVIO LOS FONDOS POR TEMAS CON SU SISTEMA
	LLAMADA DE MARGEN	mar-22	Cliente 10	MXN	7,600,000	TUVIERON FALLAS CON SU SISTEMA DE PAGOS
SDT175	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente 11	MXN	14,820	NO FONDEO SU CUENTA
SDS941	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente 12	MXN	71,913	NO FONDEO SU CUENTA
SDT297	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente 13	MXN	6,025	NO FONDEO SU CUENTA
2022022403316	Forwards FX	mar-22	Cliente 14	USD	122,000	NO FONDEO SU CUENTA
SDW519	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente 15	MXN	4,958	NO ENVIO LOS FONDOS
SAK055	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente 16	MXN	666,296	NO FONDEO SU CUENTA
SDS115	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente 17	MXN	2,556	NO FONDEO SU CUENTA
SX6539	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente 18	MXN	692,591	NO FONDEO SU CUENTA
SDT314	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente 19	MXN	52,869	NO FONDEO SU CUNETETA
C67387	Cross Currency Swaps	mar-22	Cliente 20	MXN	2,172,412	NO FONDEO SU CUNETETA
C67387	Cross Currency Swaps	mar-22	Cliente 21	MXN	275,738	NO FONDEO SU CUNETETA

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte

Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertura o Negociación	Nacional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores dados en garantía
				VP Trim Anterior	VP Trim Actual	VP Trim Anterior	VP Trim Actual	0 A 1 AÑO	1 A 5 AÑOS	5 A 10 AÑOS	
Forwards	NEGO	3,298,653,323	Compra	Divisas	Divisas	157,227,004,722	136,329,046,937	3,044,514,994	254,138,329	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	3,490,794,931	Venta	Divisas	Divisas	(157,055,536,726)	(136,116,384,001)	3,265,706,696	225,088,236	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	558,229,000	Compra	Acción	Acción	31,496,552	217,645,480	-	558,229,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	(328,294,000)	Venta	Acción	Acción	(12,370,883)	(191,664,644)	-	(328,294,000)	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	7,426,680,616	Compra	Divisas	Divisas	59,129,616	164,017,986	7,343,535,818	83,144,798	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	7,426,680,616	Venta	Divisas	Divisas	(59,129,168)	(164,018,410)	7,343,535,818	83,144,798	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,354,716,000	Compra	Índice	Índice	290,464,284	291,016,692	152,600,000	3,202,116,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Índice	Índice	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	32,299,355,291	Compra	Tasas	Tasas	362,835,543	599,905,185	-	27,958,798,311	4,340,556,980	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	31,869,754,176	Venta	Tasas	Tasas	(349,719,103)	(579,699,670)	-	27,709,972,932	4,159,781,245	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	685,420,000	Compra	Acción NE	Acción NE	52,765,601	186,646,497	-	685,420,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	455,729,000	Venta	Acción NE	Acción NE	(71,891,270)	(212,627,333)	-	455,729,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Índice NE	Índice NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,354,716,000	Venta	Índice NE	Índice NE	(290,464,284)	(291,016,692)	152,600,000	3,202,116,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Divisas NE	Divisas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Divisas NE	Divisas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	9,013,082,970	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	39,294,046	330,632,090	-	5,469,150,889	3,543,932,082	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	(2,767,990)	CCIRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	(8,138,348)	(4,400,003)	-	(2,767,990)	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	43,031,012,837	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	768,406,137	1,684,465,667	300,000,000	22,863,450,160	19,867,562,677	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	1,380,442	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD	FIJA EUR / LIBOR USD	(1,715,667)	1,820,081	-	1,380,442	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	48,411,310	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	158,833,038	115,462,194	-	48,411,310	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	18,730,944,235	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	(649,146,886)	262,013,756	-	5,106,331,186	13,624,613,048	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	297,131,863,601	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	6,787,882,881	10,834,226,892	69,691,823,616	97,526,124,389	129,913,915,596	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	23,491,433,817	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	170,483,512	(328,450,026)	37,398,998	11,375,421,945	12,078,612,874	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	300,826,174,560	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	(6,790,129,555)	(11,092,302,253)	71,818,853,189	93,007,244,068	136,000,077,303	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2022 Y 2021

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
100000000000			A C T I V O	653,468,290,457	0
100200001001			Efectivo y equivalentes de efectivo	37,448,103,681	0
100400001001			Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	864,460,162	0
100600001001			INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS	112,914,725,777	0
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	50,976,294,268	0
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	56,771,376,624	0
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	5,167,054,885	0
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	5,167,889,566	0
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-834,681	0
101000001001			Deudores por reporte	3,201,385,046	0
101200001001			PRÉSTAMO DE VALORES	0	0
101400001001			Instrumentos financieros derivados	30,073,155,725	0
	101400102001		Con fines de negociación	24,105,235,410	0
	101400102002		Con fines de cobertura	5,967,920,315	0
101600001001			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS	-937,661,502	0
	101800104001		Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1	422,779,913,604	0
	101800105001		Créditos comerciales	221,646,880,480	0
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	184,618,558,462	0
		101800107002	Entidades financieras	17,720,180,638	0
		101800107003	Entidades gubernamentales	19,308,141,380	0
	101800105002		Créditos de consumo	33,599,697,020	0
	101800105003		Créditos a la vivienda	167,533,336,104	0
		101800507023	Media y residencial	161,489,772,381	0
		101800507024	De interés social	5,120,157	0
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	6,038,443,566	0
		101800507026	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800507027	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800105004		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
	101800104002		Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2	3,568,859,202	0
	101800205005		Créditos comerciales	785,416,488	0
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	656,084,361	0
		101800506008	Entidades financieras	0	0
		101800506009	Entidades gubernamentales	129,332,127	0
	101800205006		Créditos de consumo	550,069,612	0
	101800205007		Créditos a la vivienda	2,233,373,102	0
		101800706018	Media y residencial	2,126,115,400	0
		101800706019	De interés social	0	0
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	107,257,702	0
		101800706021	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800706022	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104003		Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	16,180,234,150	0
	101800305008		Créditos comerciales	7,800,459,884	0
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	7,753,003,413	0
		101800806024	Entidades financieras	47,456,471	0
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	0
	101800305009		Créditos de consumo	1,034,520,246	0
	101800305010		Créditos a la vivienda	7,345,254,020	0
		101801006034	Media y residencial	7,148,975,991	0
		101801006035	De interés social	12,027,777	0
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	184,250,252	0
		101801006037	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801006038	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104004		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: 2022

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 2022 Y 2021

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
		101801306051	De interés social	0	0
		101801306052	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	0	0
		101801306053	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801306054	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	131800103001		Cartera de crédito	442,529,006,956	0
	131800103002		Partidas diferidas	0	0
	101800103003		ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS	-15,598,582,344	0
	131800102001		Cartera de crédito (neto)	426,930,424,612	0
	131800102002		Derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
131800001001			Total de cartera de crédito (neto)	426,930,424,612	0
102000001001			Activos virtuales	0	0
102200001001			BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
132400001001			Otras cuentas por cobrar (neto)	20,319,653,270	0
132600001001			Bienes adjudicados (neto)	168,636,069	0
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	16,533,054	0
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	5,340,109,523	0
133400001001			Propiedades, mobiliario y equipo (neto)	4,233,354,033	0
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,696,170,440	0
103800001001			INVERSIONES PERMANENTES	52,541,968	0
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	5,615,389,323	0
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,531,309,276	0
134400001001			Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	0	0
104600001001			Crédito mercantil	0	0
200000000000			P A S I V O	582,876,946,100	0
200200001001			CAPTACIÓN TRADICIONAL	429,019,245,108	0
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	216,843,243,062	0
	200200102002		Depósitos a plazo	189,619,109,942	0
		200200203003	Del público en general	187,317,054,285	0
		200200203004	Mercado de dinero	2,302,055,657	0
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	21,676,002,060	0
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	880,890,044	0
200400001001			PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS	41,936,461,019	0
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	17,391,724,184	0
	200400102003		De largo plazo	24,544,736,835	0
230600001001			VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR	0	0
200800001001			ACREEDORES POR REPORTO	36,205,041,089	0
201000001001			PRÉSTAMO DE VALORES	0	0
201200001001			COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA	1,797,567,498	0
	201200102001		Reportos	1,674,400,131	0
	201200102002		Préstamo de valores	123,167,367	0
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			Instrumentos financieros derivados	27,833,221,137	0
	201400102001		Con fines de negociación	23,877,181,722	0
	201400102002		Con fines de cobertura	3,956,039,415	0
201600001001			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS	6,382,253	0
201800001001			OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
202000001001			Pasivo por arrendamiento	2,781,445,358	0
202200001001			Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal	0	0
202400001001			OTRAS CUENTAS POR PAGAR	25,976,421,905	0
	202400102001		Acreedores por liquidación de operaciones	10,228,378,852	0
	202400102002		Acreedores por cuentas de margen	1,503,490,068	0
	202400102003		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	3,005,845,347	0
	202400102004		Contribuciones por pagar	372,364,036	0
	202400102005		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	10,866,343,602	0
202600001001			Pasivos relacionados con grupos de activos mantenidos para la venta	0	0
202800001001			Pasivos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2022 Y 2021

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
203000001001			Instrumentos financieros que califican como pasivo	9,096,341,472	0
	203000102001		OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN	9,096,341,472	0
	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	1,057,274,951	0
203600001001			Pasivo por beneficios a los empleados	5,625,250,922	0
203800001001			Créditos diferidos y cobros anticipados	1,542,293,388	0
400000000000			CAPITAL CONTABLE	70,591,344,357	0
440200001001			Participación controladora	70,590,197,922	0
	400200102001		CAPITAL CONTRIBUIDO	11,575,052,037	0
		400200103001	Capital social	9,207,023,304	0
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	0
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	1,036,846,090	0
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	0
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		CAPITAL GANADO	59,015,145,885	0
		400200203010	Reservas de capital	6,897,399,203	0
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	0
		400200203012	Resultados acumulados	51,509,679,758	0
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	48,060,825,191	0
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	3,448,854,567	0
	400200203013		Otros resultados integrales	445,749,630	0
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-159,935,114	0
		400201304007	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0
		400201304008	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	736,689,615	0
		400201304009	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0
		400201304010	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304011	Incremento por actualización de Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304012	Remediación de beneficios definidos a los empleados	-131,004,871	0
		400201304013	Incremento por actualización de la remediación de beneficios definidos a los empleados	0	0
		400201304014	Efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304015	Incremento por actualización del efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304016	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
		400201304017	Incremento por actualización del resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	400200203014		Participación en ORI de otras entidades	0	0
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA	1,146,435	0
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	27,800	0
	440400102002		Otra participación no controladora	1,118,635	0
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			CUENTAS DE ORDEN	6,037,595,634,794	0
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	3,501,297,210,428	0
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	429,401,125,522	0
	700800102001		Fideicomisos	400,291,661,487	0
	700800102002		Mandatos	29,109,464,035	0
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	587,042,527,795	0
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	12,986,321,779	0
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	1,674,169,048	0
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,064,620,138	0
702000001001			Otras cuentas de registro	1,504,129,660,084	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01

AÑO: 2022

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

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 31 DE MARZO DE 2022 Y 2021

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	12,029,762,169	0
600400101002	Gastos por intereses	6,045,331,020	0
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	MARGEN FINANCIERO	5,984,431,149	0
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	-1,430,264,670	0
330000000002	MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS	7,414,695,819	0
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	1,193,889,808	0
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	191,585,576	0
501400301007	Resultado por intermediación	378,921,266	0
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	134,795,672	0
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	4,473,929,502	0
330000000003	RESULTADO DE LA OPERACIÓN	4,456,787,487	0
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	299,040	0
330000000004	RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD	4,457,086,527	0
602400501012	Impuestos a la utilidad	1,008,204,160	0
330000000005	RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS	3,448,882,367	0
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	RESULTADO NETO	3,448,882,367	0
502800701014	Otros Resultados Integrales	304,804,028	0
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-48,897,221	0
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	357,398,839	0
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remediación de beneficios definidos a los empleados	-3,697,590	0
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	0	0
330000000007	RESULTADO INTEGRAL	3,753,686,395	0
543200601016	Resultado neto atribuible a:	3,448,882,367	0
543201602158	Participación controladora	3,448,854,567	0
543201602159	Participación no controladora	27,800	0
543400701017	Resultado integral atribuible a:	3,753,686,395	0
543401702160	Participación controladora	3,753,686,395	0
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: 2022

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2022 Y 2021

CONSOLIDADO
Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	AÑO ACTUAL IMPORTE	AÑO ANTERIOR IMPORTE
		Actividades de operación		
851000102001		Resultado antes de impuestos a la utilidad	4,457,086,527	0
851000102002		Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:	-1,738,950,519	0
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	245,750,153	0
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	155,487,128	0
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	-32,759,575	0
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-299,040	0
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	-2,107,129,185	0
	851000203006	Operaciones discontinuadas	0	0
	851000203007	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	0	0
851000102003		Ajustes por partidas asociadas con actividades de financiamiento	-5,984,431,149	0
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	594,819,073	0
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	239,817,000	0
	851000303003	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000303004	Otros intereses	-6,819,067,222	0
851000102004		Cambios en partidas de operación	-22,035,095,501	0
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	-6,471,083,850	0
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	1,533,185,808	0
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	10,596,454,928	0
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	8,615,880,585	0
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-5,711,438,691	0
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	-4,461,598,458	0
	851000403008	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	851000403009	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	851000403010	Cambio en activos virtuales	0	0
	851000403011	Cambio en otras cuentas por cobrar (neto)	-8,542,793,555	0
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-39,876,478	0
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	-1,846,930,429	0
	851000403014	Cambio en captación tradicional	-13,155,804,135	0
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	-19,810,255,981	0
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	-37,122	0
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	-960,089,744	0
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	4,814,456,388	0
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	42,091,189	0
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	454,377,757	0
	851000403021	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	851000403022	Cambio en activos/pasivos por beneficios a los empleados	1,298,611,295	0
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	13,175,886,075	0
	851000403024	Cambio en otras provisiones	0	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-1,566,131,083	0
851000001001		Flujos netos de efectivo de actividades de operación	-25,301,390,642	0
		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	-79,581,576	0
	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	-4,992	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	0	0
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-97,347,163	0
	851000202013	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	851000202014	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	851000202015	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

AL 31 DE MARZO DE 2022 Y 2021

**CONSOLIDADO
Impresión Final**

(PESOS)

			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	-176,933,731	0
		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	-594,819,073	0
	851000302003	Pagos de pasivo por arrendamiento	0	0
	851000302004	Cobros por emisión de acciones	0	0
	851000302005	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	851000302006	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302007	Pagos asociados a instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302008	Pagos de dividendos en efectivo	0	0
	851000302009	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	851000302010	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo	0	0
	851000302011	Pagos asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	-239,817,000	0
	851000302012	Pagos por intereses por pasivo por arrendamiento	-5,400,402	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	12,058,983,027	0
	851000302016	Otros pagos por actividades de financiamiento	-5,234,515,403	0
851000001003		Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento	5,984,431,149	0
	851000000000	Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo	-19,493,893,224	0
	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	56,941,996,905	0
	100200001001	Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo	37,448,103,681	0

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

TRIMESTRE: 01

AÑO: 2022

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

ESTADO DE CAMBIOS EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE
 CRÉDITO

AL 31 DE MARZO DE 2022 Y 2021

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado									Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de Instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de Instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remedaciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversión	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Participación en ORI de otras entidades			
Saldo al inicio del periodo	10,457,688.673	0	1,117,363.364	0	7,059,716.497	48,574,357.437	-111,037.893	379,290.776	0	-127,307.281	0	0	0	67,350,071.573	1,118.635	67,351,190.208
Ajustes retrospectivos por cambios contables	0	0	0	0	0	-513,532.246	0	0	0	0	0	0	0	-513,532.246	0	-513,532.246
Ajustes retrospectivos por correcciones de errores	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Saldo ajustado	10,457,688.673	0	1,117,363.364	0	7,059,716.497	48,060,825.191	-111,037.893	379,290.776	0	-127,307.281	0	0	0	66,836,539.327	1,118.635	66,837,657.962
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 impliquen 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	3,448,854.567	0	0	0	0	0	0	0	3,448,854.567	27.800	3,448,882.367
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	-48,897.221	357,398.839	0	-3,697.590	0	0	0	304,804.028	0	304,804.028
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	-48,897.221	0	0	0	0	0	0	-48,897.221	0	-48,897.221
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	357,398.839	0	0	0	0	0	357,398.839	0	357,398.839
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
Remedación de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-3,697.590	0	0	0	-3,697.590	0	-3,697.590
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	0	0	0	0
Total	0	0	0	0	0	3,448,854.567	-48,897.221	357,398.839	0	-3,697.590	0	0	0	3,753,658.595	27.800	3,753,686.395
Saldo al final del periodo	10,457,688.673	0	1,117,363.364	0	7,059,716.497	51,508,679.758	-159,935.114	736,689.615	0	-131,004.871	0	0	0	70,590,197.922	1,146.435	70,591,344.357

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 1 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Anexo 3 Scotiabank Inverlat

Scotiabank-Indicadores FinancierosT1 2022

ROE

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

ROA

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

MIN

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 2 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Eficiencia Operativa

(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio) 2.7%

Índice de Morosidad

(Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre) 3.7%

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

(Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.) 96.4%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito 19.86%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales

(crédito, mercado y operacional) 16.49%

Liquidez

(Activos líquidos / Pasivos líquidos) 42.0%

* Sujeto a aprobación del Banco Central.

Scotiabank- Información Financiera

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar 2022

Ingresos por intereses 12,030

Gastos por intereses (6,045)

Margen Financiero 5,985

Comisiones 1,002

Resultado por Intermediación 379

OI OE 135

Ingresos no Financieros 1,516

Total Ingresos 7,501

Gastos de Administración y Promoción (4,474)

PTPP 3,027

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios 1,430

Resultado de la Operación 4,457

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

Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 4,457

Impuestos a la Utilidad (1,008)

Resultado Neto 3,449

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

En el primer trimestre de 2022, la utilidad neta consolidada de Grupo Financiero Scotiabank Inverlat S.A. de C.V. (Grupo Financiero Scotiabank), se ubicó en \$3,449 millones, la cual se debe principalmente a ingresos por margen financiero, ingresos no financieros y menores requerimientos de reservas en cartera comercial; compensados por gastos de administración y promoción e impuestos a la utilidad.

Ingresos no Financieros

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar 2022

Actividades Fiduciarias 65

Apertura de Cuenta 4

Cartas de Crédito sin Refinanciamiento 57

Cheques Certificados 1

Manejo de Cuenta 83

Operaciones de Crédito 391

Otras Comisiones y Tarifas 330

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 3 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Servicios de Banca Electrónica 44
Transferencia de Fondos 27
Total de Comisiones y Tarifas (netas) 1,002

Scotiabank -Otros Ingresos/Egresos de la Operación
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
2022
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas(14)
Aportaciones al IPAB(502)
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo 83
Estimación por Pérdida de Valor de Bienes Adjudicados(4)
Ingresos por Arrendamiento 72
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a Funcionarios y Empleados 29
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación 851
Quebrantos(405)
Recuperaciones 3
Resultado en Venta de Bienes Adjudicados 22
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación 135

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
2022
Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios1,430

En el primer trimestre de 2022, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$1,430 millones, integrada principalmente por menores requerimientos en la cartera comercial.

Gastos de Administración y Promoción
Gastos de Administración y Promoción
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
2022
Gastos de Personal(2,402)
Gastos de Operación(2,072)
Total de Gastos de Administración y Promoción(4,474)

Impuestos a la Utilidad
Scotiabank-Impuestos
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
2022
Impuesto a la Utilidad Causado(622)
Impuesto a la Utilidad Diferido(386)
Total de Impuestos a la Utilidad(1,008)

En el primer trimestre de 2022, se registró un impuesto neto a cargo por \$1,004 millones lo que representa una tasa efectiva del periodo de 22.6%.

Balance General
Scotiabank - Cifras relevantes del Balance General
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
2022
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores 183,564
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 426,349

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 4 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 16,180
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(15,599)
Otros Activos 42,974
Total Activo 653,468
Depósitos 429,019
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos 41,936
Obligaciones Subordinadas en Circulación 9,096
Otros Pasivos 102,826
Capital 70,591
Total Pasivo y Capital 653,468

Al 31 de marzo de 2022, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$653,468 millones, se integran principalmente por la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1 y 2 de comercial y vivienda, inversiones en instrumentos financieros por cobrar y vender, negociables, efectivo y equivalentes de efectivo e instrumentos financieros derivados con fines de negociación.

El total del pasivo ascendió a \$582,877 millones al 31 de marzo de 2022, integrado principalmente por depósitos de clientes y títulos de crédito emitidos, préstamos bancarios y de otros organismos, otros pasivos (acreedores por reportos, instrumentos financieros derivados con fines de negociación, acreedores por liquidación de operaciones y pasivos por beneficios a los empleados) y obligaciones subordinadas en circulación.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar
2022

Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales 34,150
Créditos a la Vivienda 169,766
Total Préstamos de Menudeo 203,916
Actividad Empresarial o Comercial 185,275
Entidades Financieras 17,720
Entidades Gubernamentales 19,438
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales 222,433
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 426,349

El total de préstamos comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de marzo de 2022, se ubicaron en \$222,433 millones, integrados por créditos de actividad empresarial o comerciales, seguido de entidades gubernamentales y financieras.

El total de préstamos de menudeo al 31 de marzo de 2022, se ubicaron en \$203,916 millones, integrados por créditos de vivienda, seguido de tarjeta de crédito y otros préstamos personales.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar
2022

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 16,180
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(15,599)
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta 581
Índice de morosidad 3.7%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 5 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Al 31 de marzo de 2022 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 se ubicó en \$16,180 millones y la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$15,599 millones. El índice de morosidad fue de 3.7%.

Depósitos

Scotiabank - Depósitos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar 2022

Total Depósitos Vista y Ahorro 216,843

 Público en General 187,317

 Mercado de Dinero 2,302

Total Depósitos a Plazo 189,619

Títulos de Crédito Emitidos 21,676

Cuenta global de captación sin movimientos 881

Total de Depósitos 429,019

Al 31 de marzo de 2022, el total de depósitos se ubica en \$429,019 millones, integrados principalmente por depósitos de vista y ahorro y público en general.

Scotiabank

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

(millones de pesos al 31 de marzo de 2022)

Emisor Títulos Tasa Plazo Importe

I-BANSAN-22165 11,959,235,5276.40% 2811,911

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros

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

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

Instrumentos financieros negociables 49,875 1,078 23 - 50,976

Sin restricción: 4,301 100 23 - 4,424

Restringidos: 45,574 978 - - 46,552

 En operaciones de reporto 39,357 978 - - 40,335

 Préstamos de valores 131 - - - 131

 Otros 6,086 - - - 6,086

Instrumentos financieros para cobrar o vender 38,458 17,064 - 1,250 56,772

Sin restricción: 38,276 17,064 - 1,250 56,590

Restringidos: 182 - - - 182

 En operaciones de reporto - - - - -

 Otros 182 - - - 182

Instrumentos financieros para cobrar principal e interés 5,167 - - - 5,167

Sin restricción 5,167 - - - 5,167

Total 193,500 18,142 231,250 112,915

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados

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

Contratos Adelantados Futuros Opciones Operaciones Estructuradas Swaps Paquetes de Instrumentos Derivados

Total activo Total

pasivo

Posición Posición Posición Posición Posición Posición

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

Pasiva

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 6 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Negociación	3,011	2,800	--	1,079	741	465	593	19,550	19,743	--	24,105	23,877
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	5,968	3,956	-	5,968 3,956

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

Contratos adelantados	Futuros	Operaciones Estructuradas	Opciones	Swaps	Paquetes de instrumentos Derivados
Posición	Posición	Posición	Posición	Posición	Posición
Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
Con fines de negociación					
Posición USD	3,299	3,485	-----		
Posición EUR	56				
Divisas USD	-----	369	369	----	
Divisas EUR					
Divisas MXN	-----	969	----		
Acciones MXN	----	685	456	583	28
Índices MXN	-----	3,355	3,355	-----	
Tasa de interés					
Pesos	-----	25,965	25,557	305,697	309,448
Dólares	-----	318	317	171,312	1,658
Euros	-----	23	--		
Pesos Colombianos	-----	177,500	---		
Con fines de cobertura					
Tasa de interés					
Pesos	-----	43,031	---		
Dólares	-----	453	--		
Euros	-----	4	---		

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

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	147,712	36,907	184,619
Créditos a entidades financieras	17,702	18	17,720
Créditos a entidades gubernamentales	19,308	-	19,308
Créditos al consumo	33,600	-	33,600
Créditos a la vivienda	167,512	21	167,533
Total	385,834	36,946	422,780

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

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	344	312	656
Créditos a entidades gubernamentales	130	-	130
Créditos al consumo	550	-	550
Créditos a la vivienda	2,233	-	2,233
Total	3,257	312	3,569

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

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	16,287	1,466	7,753
Créditos a entidades financieras	47	-	47
Créditos al consumo	1,035	-	1,035
Créditos a la vivienda	7,304	41	7,345
Total	14,673	1,507	16,180

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 7 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3
(millones de pesos)
Saldo al 31 de diciembre de 202116,943
Liquidaciones(85)
Castigos y quitas(539)
Traspasos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2(91)
Fluctuación de tipo de cambio(48)
Saldo al 31 de marzo de 202216,180

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios
(millones de pesos)
Saldo al 31 de diciembre de 202116,702
Más: Creación de reservas2
Calificación(1,335)
Menos: Liberaciones-
Cancelaciones -
Adjudicaciones y otros8
Castigos y quitas539
Comercial36
Hipotecario40
Consumo463
Efecto inicial metodología(821)
Desliz cambiario 44
Saldo al 31 de marzo de 202215,599

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito31 mar
2022
Cartera Vigente
Metropolitano56.1%
Noroeste - Centrol2.1%
Norte15.7%
Bajío9.7%
Sur6.4%
Cartera Vencida
Metropolitano40.5%
Noroeste - Centrol18.0%
Norte8.1%
Bajío17.0%
Sur16.3%

Scotiabank-Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico
(millones de pesos al 31 de marzo de 2022)
No. Acreditados / GruposMonto% Capital Básico
115,46525.61%
28,68814.39%
36,67311.05%
46,62710.97%
Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos 30,826

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia
Al 31 de marzo de 2022
(millones de pesos)
Importe Cartera CrediticiaReservas Preventivas Necesarias
Cartera ComercialConsumoCartera de ViviendaTotal Reservas Preventivas

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 8 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

No Revolventes Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes

Exceptuada calificada

Riesgo A1	390,508	990	99	584	272	1,945
Riesgo A2	31,958	289	26	179	12	506
Riesgo B1	8,925	105	44	58	12	219
Riesgo B2	6,590	11	50	37	57	155
Riesgo B3	6,953	104	14	41	54	213
Riesgo C1	4,524	129	23	75	54	281
Riesgo C2	3,212	15	25	140	209	389
Riesgo D	5,572	266	43	344	992	1,645
Riesgo E	11,563	5,824	797	316	1,388	8,325
Total	469,805	7,733	1,121	1,774	3,050	13,678
Exceso	1,921					

Reservas Constituidas 15,599

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 2022.

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

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$
-	
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	
27	
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos	27
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	1,867
Total	\$ 1,921

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 9 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 2022 mantiene el Banco en el rubro de "Inversiones en Instrumentos Financieros - Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses" son:

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes especiales (millones de pesos)

Títulos	Importe	Vencimiento
B4 2207073,961,83154007-jul-22		
B4 22080421,792304-ago-22		
B4 27070111,209,6861,52801-jul-27		
BC 220804 3,115-04-ago-22		
BV 2707016-01-jul-27		
Total	15,196,4302,071	

Tasa Promedio

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional (millones de pesos al 31 de marzo de 2022) Pesos Dólares Udis

Depósitos a la vista (incluye ahorro)	2.66%	0.08%
Depósitos a plazo	5.32%	0.00%

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

Vencimiento	Préstamos	Financiamiento	Total
Banca			
Múltiple	Banco de		
México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos
Pesos			
Inmediato	-----		
Mediano	- 1,264	7,399	3,444 - 12,107
Largo	-- 16,000	6487	- 22,487
Total	- 1,264	23,399	9,931 - 34,594
Tasa Promedio	0.00%	5.45%	7.61% 6.29% 0.00%
Otros			
Inmediato	-----		
Mediano	-	23	280 4 307
Largo	4,977	-	69 1,989 7,035
Total	4,977	-	23 349 1,993 7,342
Tasa Promedio	0.31%	0.00%	2.01% 0.92% 1.03%
Total Préstamos Interbancarios	4,9771,	26423,	42210,2801,99341,936

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 2022.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 10 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

31 mar

2022

Depósitos a la Vista53.4%

Metropolitano21.8%

Noroeste - Centro11.4%

Norte8.3%

Bajío6.1%

Sur5.8%

Depósitos Ventanilla46.0%

Metropolitano18.7%

Noroeste - Centro6.9%

Norte9.2%

Bajío5.6%

Sur5.6%

Total de Captación del Público99.0%

Fondeo Profesional10.6%

Scotiabank-Impuestos y PTU Diferidos

(millones de pesos al 31 de marzo de 2022)

Perdida de arrastre fiscal 8

Provisión por perdidas de crédito4,410

Compensación diferida(1,150)

Ingresos diferidos566

Instalaciones y equipos / depreciación286

Beneficios a los empleados543

Provisiones1,360

Otros (408)

Efecto Neto en Diferido5,615

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

Scotiabank-Resultados por Intermediación

(millones de pesos) 31 mar

2022

Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable (306)

Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros(9)

Resultado por valuación de divisas(274)

Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados554

Resultado por compraventa de divisas415

Costos de transacción(1)

Total 379

Emisión de Certificados Bursátiles

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

Quinta*Primera***Segunda*** Primera*** Segunda***Tercera

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 11 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Clave de PizarraSCOTIAB 13-2SCOTIAB 19SCOTIAB 19DSCOTIAB 19 (reapertura)¹SCOTIAB 19D
(reapertura)¹SCOTIAB 19-2
Monto de la Emisión\$1,150 millones\$3,653 millones\$123 millones dólares\$2,352 millones
\$112 millones dólares\$6,000 millones
Fecha de Emisión y Colocación28 junio
201327 mayo
201928 mayo
201929 julio
201929 julio
20196 diciembre 2019
Plazo de Vigencia de la Emisión3,640 días, 20 períodos
182 días, aprox.
10 años1,263 días, aprox.
3.5 años1,260 días, aprox.
3.5 años1,200 días, aprox. 3.3 años1,198 días, aprox.
3.3 años1,207 días, aprox.
3.3 años
GarantíaQuirografariaQuirografariaQuirografariaQuirografariaQuirografariaQuirografaria
Tasa de interés7.30% FijoTIIE 28 + 0.18%LIBOR 3 MESES + 0.57%TIIE 28 + 0.18%LIBOR 3
MESES + 0.57%TIIE 28 + 0.15%
Pago de InteresesCada 182 días durante la vigencia de la emisiónCada 28 días Cada 90
díasCada 28 díasCada 90 díasCada 28 días
Calificaciones otorgadas Fitch/S&PAAA (mex) /"mxAAA"AAA (mex) /"mxAAA"AAA (mex) /"mxAAA"
AAA (mex) /"mxAAA"AAA (mex) /"mxAAA"AAA (mex) /"mxAAA"
Amortización del principalUn sólo pago al vencimientoUn sólo pago al vencimientoUn sólo
pago al vencimiento en dólaresUn sólo pago al vencimientoUn sólo pago al vencimiento en
dólaresUn sólo pago al vencimiento

* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

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

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

Emisión de Obligaciones Subordinadas

Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo (días)	Importe (\$)	Tasa (%)
18-diciembre-1405	diciembre-24	MX0QSC1N00163	6402,093,000	0007.4	
28-junio-1809	junio-33	MX0QSC1N00245	4603,360,000	00012.3	
11-septiembre-18	Perpetua	MX0QSC1N0032	-3,455,000	00011.3	
Total de Obligaciones Subordinadas					8,908,000,000

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
BONO SCOTIAB 13-19	658	2022-nov-19	22-nov-22	1,096	MSFDVTHY INDEX	65,820,000

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 12 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

BONO SCOTIAB	05-201,930,500	19-feb-2017-feb-231,094	MSFDVTIG	IDEX	193,050,000
BONO SCOTIAB	06-206,471,910	27-mar-2027-mar-231,095	MSFDVTIG	IDEX	647,191,000
BONO SCOTIAB	07-207,895,100	14-may-2012-may-231,093	SPXSRT5E	INDEX	789,510,000
BONO SCOTIAB	08-20415,850	11-jun-2009-jun-231,093	SPXSRT5E	INDEX	41,585,000
BONO SCOTIAB	01-21238,845	02-mar-2124-ago-22540	SPDR Fund (XLE)		23,884,500
BONO SCOTIAB	02-21212,845	02-mar-2124-ago-22540	SPDR Fund (XLF)		21,284,500
BONO SCOTIAB	03-211,845,220	08-mar-2130-ago-22540	SPDR Fund (XLE)		184,522,000
BONO SCOTIAB	04-21120,000	24-mar-2108-mar-241,080	Large-Cap ETF (FXI)		10,200,000
BONO SCOTIAB	05-214,926,500	29-abr-2126-abr-241,093	Index (IDBTVER)		492,650,000
BONO SCOTIAB	06-21572,300	03-jun-2131-may-241,093	Index (IDBTVER)		57,230,000
BONO SCOTIAB	07-211,526,000	11-ago-2104-ago-22358	MSFDVTHY	Index	152,600,000
BONO SCOTIAB	08-21809,300	12-ago-2110-ago-23728	Index (IDBTVER)		80,930,000
BONO SCOTIAB	09-213,950,200	25-nov-2122-nov-241,093	Index (BNPIUIL5)		395,020,000
BONO SCOTIAB	10-213,848,100	25-nov-2122-nov-241,093	Index (BNPIUIL5)		384,810,000
BONO SCOTIAB	11-211,105,530	07-dic-2101-jun-23541	MSCI ETF (EZU)		110,553,000
BONO SCOTIAB	01-22543,200	28-feb-2225-feb-251093	MSFDVTHY	Index	54,320,000
BONO SCOTIAB	02-22545,100	28-feb-2227-feb-241093	Invesco QQQ Series 1		54,510,000
BONO SCOTIAB	03-22369,750	08-mar-2205-sep-23541	iShares MSCI China	ETF	36,975,000
Total Bonos Bancarios al 31 de marzo de 2022					3,796,645,000

Capitalización

Scotiabank

Integración del Capital

Revelación de la integración del Capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios.

(millones de pesos al 31 de marzo de 2022)

Referencia Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas

1 Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente 11,575

2 Resultado de ejercicios anteriores 48,061

3 Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 10,954

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 70,590

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) 1,527

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 13 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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)230

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 financierasNo aplica

24 del cual: Derechos de servicios hipotecariosNo aplica

25 del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporalesNo aplica

26Ajustes regulatorios nacionales8,502

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 inversión2

H del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia-

I del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones-

J del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados 7,837

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 -

OSe Deroga -

P del cual: Inversiones en cámaras de compensación 663

27Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones -

28Ajustes regulatorios totales al capital común 10,029

29Capital común de nivel 1 (CET1) 60,561

Capital adicional de nivel 1: instrumentos

30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima 3,481

31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables 3,481

32 de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicablesNo 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 gradualNo aplica

36Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios3,481

Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios

37 conservadorInversiones en instrumentos propiosde capital adicional de nivel 1No aplica

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 14 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

38 conservadorInversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1No 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 emitidoNo aplica

41Ajustes regulatorios nacionales-

42Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deduccionesNo aplica

43Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1-

44Capital adicional de nivel 1 (AT1) 3,481

45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) 64,042

Capital de nivel 2: instrumentos y reservas

46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima4,330

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 nivel2)No aplica

49 de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradualNo aplica

50 conservadorReservas 1,855

51Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios 6,185

Capital de nivel 2: ajustes regulatorios

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

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

54 conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)No aplica

55 conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitidoNo aplica

56 Ajustes regulatorios nacionales-

57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2-

58Capital de nivel 2 (T2) 6,185

59Capital total (TC = T1 + T2) 70,227

60Activos ponderados por riesgo totales 425,818

Razones de capital y suplementos

61Capital Común de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)14.22%

62Capital de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)15.04%

63Capital Total
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.49%

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)17.32%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 15 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

65 del cual: Suplemento de conservación de capital 2.50%

66 del cual: Suplemento contracíclico bancario específico 0.00%

67 del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB) 0.60%

68 Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales) 7.22%

Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)

69 Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica

70 Razón mínima nacional de T1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica

71 Razón mínima nacional de TC (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica

Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)

72 Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras No aplica

73 Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras No aplica

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

75 Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -

Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2

76 Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite) 1,855

77 Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada 4,252

78 Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite) -

79 Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas -

Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)

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

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

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

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

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

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

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

Referencia Descripción

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

2 Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.

3 Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo, resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remediones por beneficios definidos a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 16 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

capital en el que se haya invertido.

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

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

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

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

19 conservador

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

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

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

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

21 El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 18 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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.

AA. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.

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

CC. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

DD. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

EE. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en fondos de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

FF. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

HH. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del Grupo Financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

JJ. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

KK. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.

LL. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

MM. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 19 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso s) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

OO. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.

PP. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.

27No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.

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

29Renglón 6 menos el renglón 28.

30El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.

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

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

33Obligaciones subordinadas computables como capital básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).

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

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 20 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 21 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 2022)

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

Activo

BG1Efectivo y equivalentes de Efectivo 38,881

BG2Cuentas de Margen 840

BG3Inversiones en Instrumentos Financieros 112,915

BG4Deudores por reporto 3,187

BG5Préstamo de valores -

BG6Instrumentos Financieros Derivados 30,073

BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros(938)

BG8Total de cartera de crédito (neto) 426,930

BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización -

BG10Otras cuentas por cobrar (neto) 20,679

BG11Bienes adjudicados (neto) 168

BG12Propiedades, mobiliario y equipo (neto) 2,054

BG13Inversiones permanentes 3,542

BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios 16

BG15Activo por impuestos a la utilidad diferidos 5,619

BG16Pagos Anticipados y Otros activos (neto) 5,442

Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)1,566

Activos Intangibles (neto)4,531

Pasivo

BG17Captación tradicional 429,211

BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos 41,936

Valores asignados por liquidar -

BG19Acreedores por reporto 40,339

BG20Préstamo de valores -

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 22 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

BG21Colaterales vendidos o dados en garantía 1,798
BG22Instrumentos Financieros Derivados 27,833
BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros 6
BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización -
BG25Otras cuentas por pagar 24,882
BG26Obligaciones subordinadas en circulación9,096
BG27Pasivo por impuesto a la utilidad 1,052
BG28Créditos diferidos y cobros anticipados 1,542
Pasivos por arrendamiento 1,623
Pasivos por Beneficio a los Empleados 5,597
Capital contable
BG29Capital contribuido 11,575
BG30Capital ganado 59,015
Cuentas de orden
BG31Avales otorgados -
BG32Activos y pasivos contingentes -
BG33Compromisos crediticios 3,501,297
BG34Bienes en fideicomisos o mandato 429,401
BG35Agente financiero del gobierno federal -
BG36Bienes en custodia o en administración 58,662
BG37Colaterales recibidos por la entidad 12,972
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad 1,674
BG39Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto) -
BG40Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida 1,065
BG41Otras cuentas de registro 1,503,848

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 2022)

IdentificadorConceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital NetoReferencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexoMonto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada

ACTIVO

1Crédito mercantil8-
2Otros Intangibles9-
3Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales 10 1,527 BG 15 Activo por impuestos a la utilidad diferidos \$1,527
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-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 23 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

crédito (neto) \$1,855

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 2BG 13 Inversiones Permanentes \$2

19Financiamiento para la adquisición de acciones propias26-H -

20Cargos diferidos y pagos anticipados26-J 7,837 BG 16 Activos Intangibles \$4,531 más
Gastos de Instalación \$3,306

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

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

23Inversiones en cámara de compensación26-P 633 BG 13 Inversiones Permanentes \$663

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 3,481 BG 26
Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,481

30Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No
Fundamental33 -

31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S46 4,330 BG 26
Obligaciones Subordinadas en circulación \$4,330

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 11,575 BG 29 Capital Social \$10,458
más Prima en Venta de Acciones \$1,117

35Resultado de ejercicios anteriores2 48,061 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores
\$48,061

36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas
registradas a valor razonable3 737 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de
Cobertura de Flujo de Efectivo \$737

37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores3 10,218 BG 30 Reservas
de Capital \$7,060 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta
(\$160) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$131) más Resultado
Neto \$3,449

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

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

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

41Efecto acumulado por conversión3, 26-A -

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

CUENTAS DE ORDEN

43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas26 - K -

CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERALIdentificador

44Reservas pendientes de constituir12 -

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

46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I -

47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M -

48Derogado

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

IdentificadorDescripción

1Crédito mercantil.

2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.

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

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.

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

6Cualquier acción propia que la Institución adquiriera 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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 25 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

-
- 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.
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 26 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 2022)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo

Importe de posiciones equivalentes Requerimiento de capital

Operaciones en moneda nacional con tasa nominal 36,397 2,912

Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable 1,892 151

Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's 1,334 107

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

Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC 56 4

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

Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal 2,912 233

Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio 2,409 193

Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones 83 7

Posiciones en Mercancía - -

Requerimiento de capital por impacto Gamma - -

Requerimiento de capital por impacto Vega 10 1

Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo Activos ponderados por riesgo

Requerimiento de capital

Grupo I-A (ponderados al 0%) - -

Grupo I-A (ponderados al 10%) - -

Grupo I-A (ponderados al 20%) - -

Grupo I-B (ponderados al 2%) 27 2

Grupo I-B (ponderados al 4%) - -

Grupo II (ponderados al 0%) - -

Grupo II (ponderados al 10%) - -

Grupo II (ponderados al 20%) - -

Grupo II (ponderados al 50%) - -

Grupo II (ponderados al 100%) - -

Grupo II (ponderados al 120%) - -

Grupo II (ponderados al 150%) - -

Grupo III (ponderados al 2.5%) - -

Grupo III (ponderados al 10%) 557 45

Grupo III (ponderados al 11.5%) - -

Grupo III (ponderados al 20%) 4,083 327

Grupo III (ponderados al 23%) - -

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 27 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Grupo III (ponderados al 25%)	2	-
Grupo III (ponderados al 50%)	351	28
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	-	-
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	3,553	284
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	335	27
Grupo V (ponderados al 50%)	50	4
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	2,029	162
Grupo VI (ponderados al 20%)	1,147	92
Grupo VI (ponderados al 25%)	809	65
Grupo VI (ponderados al 30%)	3,089	247
Grupo VI (ponderados al 40%)	3,263	261
Grupo VI (ponderados al 50%)	38,213	3,057
Grupo VI (ponderados al 70%)	39	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	18,934	1,515
Grupo VI (ponderados al 85%)	5,534	443
Grupo VI (ponderados al 100%)	74,063	5,925
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	146	12
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	13,033	1,043
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	342	27
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	7,073	566
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	61	5
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	148,641	11,891
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	1	0
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,550	124
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	--	--
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	5,674	454
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,122	250
Grupo IX (ponderados al 100%)	14,961	1,197
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 28 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5, 6 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	2,828	226
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	22	2

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional
Método empleado Activos ponderados por riesgo Requerimiento de capital
Estándar Alternativo 27,193 2,175
Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses
30,927

Categoría Capitalización

Al 31 de marzo de 2022, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 11.10%, por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

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

1 Emisor Scotiabank Inverlat, S.A. , Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat

2 Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg N.A.

3 Marco legal Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.

Tratamiento regulatorio

4 Nivel de capital con transitoriedad N.A.

5 Nivel de capital sin transitoriedad Fundamental

6 Nivel del instrumento Institución de crédito sin consolidar subsidiarias

7 Tipo de Instrumento Acción series "F" y "B"

8 Monto reconocido en el capital regulatorio 11,575,052,037

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 29 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

Referencia Descripción

- 1 Institución de crédito que emite el título que forma parte del Capital Neto.
- 2 Identificador o clave del título que forma parte del Capital Neto, (ISIN, CUSIP o número identificador de valor internacional).
- 3 Marco legal con el que el título deberá de cumplir, así como las leyes sobre a las cuales se sujetará.
- 4 Nivel de capital al que corresponde el título que está sujeto a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
- 5 Nivel de capital al que corresponde el título que cumple con el anexo 1-Q, 1-R, o 1-S de las presentes disposiciones.
- 6 Nivel dentro del grupo al cual se incluye el título.
- 7 Tipo de Instrumento de Capital o título representativo del capital social que se incluye como parte del Capital Neto. En caso de los títulos sujetos a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, establecido en la Resolución 50a, se refiere a las obligaciones subordinadas descritas en el Artículo 64 de la Ley de Instituciones de Crédito.
- 8 Monto del Instrumento de Capital o título representativo del capital social, que se reconoce en el Capital Neto conforme al Artículo 2 bis 6 de las presentes disposiciones, en caso de que la referencia 5 sea Fundamental o Básico no Fundamental; y conforme al Artículo 2 bis 7 de las presentes disposiciones en caso de que dicha referencia sea Complementario. En cualquier otro caso, será el monto que corresponda de
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 30 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 31 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

Suplemento de capital contracíclico de laInstitución

JurisdicciónPonderadorJurisdicciónPonderadorJurisdicciónPonderador

Alemania-Francia-Reino Unido-

Arabia Saudita-Holanda-Rusia-

Argentina-Hong Kong-Singapur-

Australia-India-Sudáfrica-

Bélgica-Indonesia-Suecia-

Brasil-Italia-Suiza-

Canadá-Japón-Turquía-

China-Corea-Otras jurisdicciones diferentes a las anteriores-

España-Luxemburgo-

Estados Unidos-México-

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 sobre los objetivos, lineamientos y políticas de administración de riesgos del Banco, asimismo aprueba periódicamente, los objetivos, lineamientos y políticas para la Administración Integral de Riesgos, así como la estructura de límites para los distintos tipos de riesgo.

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en la Dirección Corporativa de Riesgos, la cual a su vez está organizada en 8 áreas encaminadas a monitorear y mitigar los riesgos a los que está expuesto el Banco; lo anterior para garantizar una gestión adecuada de riesgos tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

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

Riesgo de mercado

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 33 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

las posiciones de negociación del Banco.

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre del 31 de marzo de 2022 fue de \$12.29 y su promedio durante el primer trimestre de 2022 fue de \$11.35 mismo que corresponde a un 0.016% del capital neto (\$69,148 a febrero 2022). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del primer trimestre de 2022 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos) Cierre marzo 2022 Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés

Derivados 785,444 818,255

Mercado de Dinero 52,080 51,146

Tipo de cambio

Cash 228 193

Derivados 22,478 17,341

Capitales

Derivados 22,776 23,345

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

Factor de Riesgo

Tasas de interés 12.72 11.89

Tipo de cambio 3.86 1.69

Capitales --

VaR Global 12.29 11.35

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 2022 muestra una pérdida máxima de \$4.410. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, Mexico 1994 por el denominado "Error de diciembre" y Mexico 1997 por el efecto de la "crisis del Rublo" y la crisis financiera asiática.

Asimismo, mensualmente se realizan pruebas de "backtesting" para comparar las pérdidas y ganancias teóricas y reales con el valor en riesgo observado y, en consecuencia, en su caso calibrar los modelos utilizados. El nivel de eficiencia del modelo se basa en el enfoque establecido por el BIS. Respecto de las pruebas de backtesting, durante el primer trimestre de 2022, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

El Banco administra su exposición al riesgo de liquidez y de tasa de interés conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado,

considerando las posiciones para el manejo estructural del balance.

Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se han establecido límites, los cuales son revisados al menos de manera anual y monitoreados de manera periódica a fin de que los mitigantes del riesgo estén actualizados y sean precisos. Entre los límites aplicables se encuentran aquellos relacionados a activos líquidos, brechas de liquidez, sensibilidad del margen y sensibilidad del valor económico, mismos que se encuentran alineados con el apetito de riesgo de la institución. La estructura de límites de riesgo de liquidez y tasas de interés contempla montos nominales, así como de plazo y concentración; de manera periódica se informa al Comité de Activos y Pasivos, Comité de Riesgos y al Consejo de Administración sobre el desempeño de dichos límites, así como de los indicadores en materia de riesgo de liquidez y tasas de interés.

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

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

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

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

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

Scotiabank Posición Posición
(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 49,01665,663
Liquidity Buffer
(bajo métrica CCL) 83,803110,172

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 35 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

incluyendo posiciones de derivados de cobertura. Adicionalmente, las exposiciones de riesgo de liquidez se encuentran dentro de los límites aprobados.

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez de frente a la contingencia sanitaria por COVID-19, con un CCL promedio durante el primer trimestre de 2022 de 149.53%, manteniéndose por arriba del 100%; así como una amplia reserva de activos líquidos. Se destaca que, a partir del 1 de marzo 2022 se implementaron las nuevas disposiciones de liquidez, las cuales contemplan cambios en el cálculo del CCL, Así mismo, se emiten las reglas definitivas para el cálculo del Coeficiente Estable Neto, el cual, al cierre de marzo 2022 se posicionó en 124%.

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

Para la medición del riesgo de tasas de interés se emplean indicadores tales como sensibilidad del valor económico y sensibilidad de margen. Para el cálculo de dichos indicadores se utilizan brechas de reprecio, construidas con base en las tasas de referencia de activos y pasivos; para el caso de posiciones a tasa fija son modeladas acorde a sus amortizaciones y vencimientos contractuales, mientras que aquellas posiciones referenciadas a una tasa flotante se modelan en función a su próxima fecha de reprecio. La metodología para el cálculo de los indicadores considera supuestos de estabilidad de depósitos de exigibilidad inmediata y de prepago de hipotecas. El primero consiste en un análisis de cosechas a fin de evaluar la permanencia de los depósitos mientras que el segundo considera un análisis histórico para estimar una tasa de prepago aplicable al portafolio de créditos.

Tanto la sensibilidad del valor económico como de la sensibilidad de margen contemplan un impacto de ± 100 puntos base en las tasas de interés y considera la máxima pérdida esperada por escenario. Esta medición se realiza de manera semanal y se reporta a los miembros del Comité de Activos y Pasivos, al Comité de Riesgos y Consejo de Administración en sus respectivas sesiones.

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

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de marzo 2022 y en promedio para el primer trimestre de 2022 es la siguiente:

Scotiabank	Posición	Posición
(millones de pesos)	Cierre	Promedio
Valor Económico (+100 pbs)	(601)	(403)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(415)	(499)

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

Scotiabank Posición Posición
(millones de pesos) Cierre Promedio
Instrumentos financieros para cobrar o vender 156,771 61,002
Derivados de Cobertura 52,729 55,019
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 2022 y el promedio del primer trimestre del 2022 fueron \$2,791 y \$2,894, respectivamente.

Riesgo de crédito

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 37 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

de manera trimestral al Consejo de Administración.

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

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

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

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

Estados y Municipios.

Admisibilidad de garantes que cuenten con calificación global a largo plazo grado de riesgo 1 y 2.

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 38 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del primer trimestre de 2022 corresponde a \$135; 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.

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

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

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

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

Condiciones del diferimiento.

El aplazamiento de pago es hasta un máximo de 6 meses.

No se marcarán a estos clientes como reestructurados para efectos de reporte a Buró de Crédito.

No se realizará capitalización de intereses.

Elegibilidad de clientes.

Cliente en la etapa "Vigentes Contables" con base en los oficios P285/2020 y P325/2020

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 39 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

de la CNBV.

Cobertura nacional.

Aplica para todos los productos de Consumo y Pequeñas Empresas

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

Durante 2020, el Banco constituyó reservas adicionales por \$3,750 para cubrir riesgos incrementales derivados de la emergencia sanitaria por COVID-19, es decir, riesgos no previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia.

Los riesgos incrementales antes mencionados tienen como base la afectación del cuadro macroeconómico y financiero del país, lo que impactó la calidad crediticia y capacidad de pago de los acreditados de los distintos portafolios del Banco.

Las reservas adicionales fueron constituidas sin asignación directa para algún portafolio, es decir, se establecieron como reservas genéricas y su aplicación es acorde con las necesidades particulares de cada portafolio. El consumo y la liberación de dichas reservas comenzó durante el primer trimestre de 2021 y continúa al cierre del primer trimestre de 2022; el monto total remanente de reservas adicionales por COVID-19 al cierre de marzo 2022 asciende a \$1,855.

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

Información metodológica

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

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito

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

Hipotecas 0.3% 3.2%

Consumo 4.3% 10.1%

Cartera Comercial 0.7% 4.3%

Total 0.8% 4.3%

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

Parámetros de Riesgo

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

Hipotecas 169,767 1.65% 18.50%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 40 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Consumo 52,1785.36% 72.04%

Cartera Comercial 261,0182.00% 44.17%

1/ EI (Exposición al Incumplimiento) calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en incumplimiento.

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

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de marzo de 2022.

Políticas para asegurar las garantías reales y establecer reservas de crédito

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

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

La garantía esté otorgada y constituida en la forma y términos establecidos en las disposiciones legales aplicables y las políticas internas del Banco.

Cuando un crédito esté cubierto por garantías del tipo real y personal; y están otorgadas simultáneamente por el mismo garante personal, sólo una de ellas puede mejorar la calificación.

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

Riesgo de crédito en instrumentos financieros

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

Al cierre de marzo 2022 y en promedio durante el primer trimestre de 2022, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.11% y 0.06% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo Operacional

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

Metodología general

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

Políticas para la gestión de riesgo operacional

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

administración de riesgos en todo el Banco.

Evaluación de riesgo operacional

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

Manual para la recolección y clasificación de datos de riesgo operacional

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

Niveles de tolerancia de riesgo Operacional

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

Indicadores clave de riesgo (KRI)

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

Riesgo Legal

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

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

Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 43 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de enero - marzo 2022, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$493.8, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de marzo 2022 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$294.1, donde \$14.7 corresponden a riesgo operacional y \$279.4 a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)
Periodo Reportado: diciembre 2021 - marzo 2022

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

(Cifras en millones de pesos) Importe sin ponderar (promedio) Importe ponderado (promedio)

ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES

1 Total de Activos Líquidos Computables No aplica 110,177.61

SALIDAS DE EFECTIVO

2 Financiamiento minorista no garantizado 165,030.13 12,249.16

3 Financiamiento estable 94,895.56 5,235.70

4 Financiamiento menos estable 70,134.57 7,013.46

5 Financiamiento mayorista no garantizado 218,277.04 80,412.04

6 Depósitos operacionales 88,964.87 21,507.38

7 Depósitos no operacionales 125,795.78 55,388.28

8 Deuda no garantizada 3,516.39 3,516.39

9 Financiamiento mayorista garantizado No aplica 412.49

10 Requerimientos adicionales: 286,558.59 23,420.38

11 Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías 5,953.19 4,949.49

12 Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda - -

13 Líneas de crédito y liquidez 280,605.39 18,470.89

14 Otras obligaciones de financiamiento contractuales 420.96 420.96

15 Otras obligaciones de financiamiento contingentes 518.43 518.43

16 TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO No aplica 117,433.46

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 44 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

ENTRADAS DE EFECTIVO

17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	10,641.72	212.23
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	40,943.47	30,244.19
19	Otras entradas de efectivo	12,836.33	12,836.33
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	64,421.52	43,292.75
	Importe ajustado		
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	110,177.61
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	74,140.72
23	COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ	No aplica	148.81

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

90 días naturales

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

Durante marzo 2022, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$47,033 y depósitos a plazo tradicionales por \$36,778, 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 \$1,701 y \$2,791 respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$16,497.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$13,932 y por operaciones de call money de \$16,640 y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$12,160.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$83,803 en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$62,195 en títulos de deuda de nivel 1, \$11,930 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 \$8,140 y \$1,537 en títulos de nivel 2.

Adicionalmente, cabe resaltar que estos cambios también fueron afectados por los cambios publicados el 1 de marzo dentro de las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, las cuales representaron cambios en la forma de calcular el CCL.

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

Cierre de diciembre 2021: 144% - cierre de marzo 2022: 132% (decremento: 1,200pb) El coeficiente de cobertura de liquidez decrementó 1,200pb respecto de diciembre 2021, esto debido principalmente a:

El fondeo tradicional del banco creció en \$1,345, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$17,611.

En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$2,775 y los depósitos en bancos decrementaron en MXN 3,619 MM.

Finalmente, los activos líquidos tuvieron un decremento de \$12,601.

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

Evolución de Activos Líquidos T1-2022

Efectivo 6%7%10%

Reservas en el Banco Central 22%16%14%

Nivel 1 71%76%74%

Nivel 2 1%1%2%

Nivel 2B 0%0%0%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 45 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Total de Activos Líquidos Ponderados 100%100%100%

La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento Enero Febrero Marzo

CAPTACION TRADICIONAL

Depósitos de exigibilidad inmediata 47%46%46%

Depósitos a plazo

Del público en general 37%37%40%

Mercado de dinero 1%1%1%

Títulos de crédito emitidos 6%6%5%

Cuenta global de captación sin movimientos 0%0%0%

PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS

De exigibilidad inmediata 0%0%0%

De corto plazo 3%4%3%

De largo plazo 6%6%5%

Total 100%100%100%

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

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

Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.

Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

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

Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

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

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

(Cifras en millones de pesos)

Exposición Potencial Futura (Marzo 2022)

Con contrato de compensación 3,403

Sin contrato de compensación 5,330

Posibles llamadas de margen (Marzo 2022)

Colateral en Tránsito 24

Downgrade (Marzo 2022)

Baja calificación 3 niveles 2,791

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

Posición Cierre

Scotiabank-Exposición en Derivados

(cifras en millones de pesos)

Factor de Riesgo

Tasas de interés 785,443.50

Tipo de cambio 22,478.32

Capitales 22,775.89

Total 830,697.71

El descalce en divisas;

La política general es fondear los activos con la misma moneda en que se otorguen. Una descripción del grado de centralización de la administración de la liquidez y la interacción entre las unidades del grupo;

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo marzo 2022, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -3.26% al cierre de marzo del 2022 y en promedio durante marzo 2022 fue de -3.16%

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

I. Información cuantitativa:

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

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

En adición, también se establece la calidad crediticia mínima de las garantías

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 47 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

recibidas. Estas garantías no podrán ser inferiores a una calificación de crédito nivel A.

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

Concentración de Depósitos

Concepto Límite MM

Concentración de Depósitos (MXN) 7,000 MXN

Concentración de Depósitos (USD) 100 USD

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

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

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

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

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

Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con los siguientes exposiciones a finales de marzo 2022.

Descripción Promedio T1 2022 Marzo 2022

Cash GAP 30 d - Grupo - estresado (MXN MM)	8,779		578
Cash GAP 90 d - Grupo - estresado (MXN MM)	34,665	39,696	
Horizonte de Supervivencia - Banco (días)	42		40
Horizonte de Supervivencia - Banco - estresado (días)		37	
34			
Horizonte de Supervivencia - Grupo (días)	42		40
Horizonte de Supervivencia - Grupo - estresado (días)		37	
34			

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 2022 y el promedio del primer trimestre de 2022 son:

Scotiabank Posición Posición

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 49,01665,663

Liquidity Buffer

(bajo métrica CCL) 83,803110,172

Scotiabank Posición Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 49,01665,663

Liquidity Buffer

(bajo métrica CCL) 83,803110,172

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

II. Información cualitativa

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

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

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

Asegurar un gobierno y supervisión del Riesgo de liquidez, incluyendo lineamientos claros de roles y responsabilidades para asegurar que el monitoreo, valuación, contabilización, medición de riesgo, y procesos de gestión de riesgo, sean conducidos y reportados independientemente.

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

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

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

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

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

Las técnicas de mitigación del riesgo de liquidez utilizadas por la Institución;
La institución monitorea el riesgo de liquidez a través de distintas métricas e informes alineados con el apetito del riesgo las cuales contemplan:
Cálculo de CCL (Coeficiente de Cobertura de Liquidez)
Cálculo de CFEN (Coeficiente de Financiamiento Estable Neto)
Cómputo de Activos Líquidos
Cálculo de LDR (Loan to Deposit Ratio)
Monitoreo de la concentración de fondeo profesional
Monitoreo de Brechas de Liquidez
Monitoreo de Concentración de Depósitos
Monitoreo de Depósitos con Bancos
Monitoreo del Portafolio de Inversión
Monitoreo de créditos cedidos como garantía de fondeo
Pruebas de Estrés de Liquidez
Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez
Reportes periódicos al Comité de Activos y Pasivos de la Institución
Reportes periódicos al Comité de Riesgos
Reportes al Consejo de Administración
Políticas y Manuales alusivos a la Administración del Riesgo de Liquidez
Plan de Contingencia para Riesgos de Solvencia y Liquidez
A efectos de mitigar el riesgo de liquidez, el Banco ha establecido lineamientos, políticas y procedimientos prudentes, poniendo particular atención en:
Medición, supervisión y pronóstico de compromisos que involucren flujos de efectivo para las principales monedas manejadas por el Banco (MXP+UDIs y USD).
Procurar una distribución uniforme de los flujos de efectivo, minimizando las brechas de liquidez entre activos y pasivos, considerando el impacto potencial de renovaciones, prepagos, retiros de depósitos, otorgamiento de crédito y el incumplimiento en pago de créditos.
Mantener fuentes diversificadas de fondeo.
Establecer programas de corresponsalías y préstamos interbancarios para ayudar a mantener el acceso a mercado.
Instrumentar y mantener disponibles programas para la emisión de pasivos, y descuento de cartera con fondos especializados.
Mantener la capacidad operativa en los sistemas de liquidación establecidos por Banco de México, considerando para esto los requerimientos de garantía y límites establecidos para tal efecto.
Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.
El Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez incorpora las acciones correctivas que la institución tendría que poner en marcha en caso de contingencia.
Una explicación de cómo se utilizan las pruebas de estrés; y
De acuerdo con la norma vigente estipulada en el anexo 12-B de la Circular Única para Bancos, que requiere la realización de ejercicios de liquidez en escenarios de estrés, el banco realiza pruebas de forma periódica esto con la finalidad de cerciorarse de su capacidad para afrontar escenarios adversos y ser capaz de honrar sus obligaciones de corto plazo basados en un horizonte de supervivencia de 30 días.
Estos escenarios de estrés contemplan entre otros, los siguientes supuestos:
Aumento en la pérdida esperada de las carteras de crédito
Aumento en retiro de los depósitos
Disposición de líneas de crédito
Aumento en las obligaciones del Banco por degradación de la calificación de la institución.
Salida de los principales depositantes del Banco
Pérdida de Valor de Mercado de los Activos Líquidos de la Institución
Las pruebas de estrés de liquidez de la institución contemplan distintos escenarios (i.e. idiosincrático, sistémico y combinado) con 3 niveles de severidad cada uno. Los

resultados de las pruebas de estrés son presentados de manera periódica a los órganos colegiados de la institución.

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

Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.

Apegarse a los sistemas de alertas tempranos, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.

Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.

Plantear acciones que aseguren que el riesgo de liquidez global del Grupo este dentro de los límites de tolerancia aprobados por el Consejo de Administración.

Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.

Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital de manera oportuna.

En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de éstas:

(i) operaciones de crédito simple garantizado con depósitos de regulación monetaria o depósitos en Dólares que el Grupo Financiero mantenga en el Banco de México, o (ii) reportos sobre títulos elegibles. Dicho financiamiento está sujeto al procedimiento que señala la circular 10/2015 de Banxico.

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el primer trimestre de 2022, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del primer trimestre 2022, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)
Periodo Reportado: marzo 2022

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 51 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$159,268 y depósitos a plazo tradicionales por \$127,832, Capital (fundamental y complementario) por \$78,402, fondeo Interbancario por \$32,859 y Fondeo profesional por \$16,434.

Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$320,514 y por operaciones mercado de dinero de \$11,958, compromisos crediticios por \$13,574 y deducciones de capital por \$10,029.

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

Derivado de que las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple entraron en vigor el 1 de marzo del 2022, y éstas son las que establecen las reglas definitivas para el cálculo de este indicador, solo se tiene una observación dentro del trimestre, la cual fue el cierre de marzo del 2022.

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

Derivado de que las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple entraron en vigor el 1 de marzo del 2022, y éstas son las que establecen las reglas definitivas para el cálculo de este indicador, solo se tiene una observación dentro del trimestre, la cual fue el cierre de marzo del 2022.

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 2022 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$22.55 millones de pesos, con una plusvalía de \$0.39 millones de pesos.

InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosImporte ValuadoCostoPlusvalía/
Minusvalía

ScotiabankPública	1KIMBERA	160,000	4.48	4.18	0.30
ScotiabankPública	1BACHOCOB	5,000	0.39	0.33	0.06
ScotiabankPública	1EFRES*	1,250	0.26	0.30	(0.04)
ScotiabankPública	1ISHV*	900	1.98	1.99	(0.01)
ScotiabankPública	41BSMXB	182,911	3.86	3.88	(0.02)
ScotiabankPública	1FEMSAUBD	28,000	4.63	4.59	0.04
ScotiabankPública	1KOFUBL	32,000	3.50	3.42	0.08
ScotiabankPública	1IIB01N	1,700	3.45	3.47	(0.02)
Total		411,761	22.55	22.16	0.39

Al cierre del primer trimestre del año 2022, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$0.18 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
ScotiabankPública	1GCARSOA1	1	-	-	-	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 52 / 82
CONSOLIDADO
Impresión Final

ScotiabankPública1KIMBERA	376,262	0.11	(0.25)	(0.14)
ScotiabankPública1IEWG*	16,911	0.25	(0.12)	0.13
ScotiabankPública1BACHOCOB	102,317	0.08	(0.09)	(0.01)
ScotiabankPública1PE&OLES*	35,519	0.04	(0.23)	(0.19)
ScotiabankPública1ATX*	4,400	0.33	-	0.33
ScotiabankPública1EFRES*	5,914	-	(0.11)	(0.11)
ScotiabankPública1CHDRAUIB	10,980	-	-	-
ScotiabankPública1IMCHI*	2,810	0.07	(0.06)	0.01
ScotiabankPública1AFB*	600	0.05	(0.03)	0.02
ScotiabankPública1NEMAKA	607,728	0.07	(0.11)	(0.04)
ScotiabankPública41BSMXB	155,262	-	(0.14)	(0.14)
ScotiabankPública1FEMSAUBD	27,362	0.03	(0.02)	0.01
ScotiabankPública1KOFUBL	4,446	-	-	-
ScotiabankPública1IIB01N	1,046	-	(0.01)	(0.01)
ScotiabankPública1ALFAA	2,034	-	-	-
ScotiabankPública1AMXL	494,432	0.04	(0.12)	(0.08)
ScotiabankPública1CEMEXCPO	512,277	0.07	(0.03)	0.04
Total	2,360,301	1.14	(1.32)	(0.18)

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
ScotiabankSin cotización		EMPRESAS FRISCO, S.A. DE C.V.	1,222	---			
ScotiabankSin cotización		BLADEX COM8,095	---				
Total			9,317	---			

Al 31 de marzo, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$6.65 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$4.89 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.76 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización

Por Riesgo General de Mercado	P O S I C I O N E S	Coefficiente de Riesgo de mercado
Requerimiento de capital		
Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición
21.99-21.99	22.23%	4.89
Por riesgo específico		
Canasta de acciones, 21.99-21.99	8.00%	1.76
Índices accionarios	---	4.00%
Requerimiento por riesgos	---	4.00%
Total Requerimiento de capital		6.65

Anexo 1-0 Bis Revelación de Información relativa a la Razón de Apalancamiento
TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO
REFERENCIARUBROmar-22

Exposiciones dentro del balance

1Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance) 622,247
2(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) (10,029)
3Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 53 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

y SFT, suma de las líneas 1 y 2) 612,217

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) 5,839

5Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados 3,789

6Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo

7(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados) (1,741)

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 nocial efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos

10(Compensaciones realizadas al nocial 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) 7,887

Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores

12Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas 3,187

13(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) (1,513)

14Exposición Riesgo de Contraparte por SFT -

15Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros -

16Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) 1,674

Otras exposiciones fuera de balance

17Exposición fuera de balance (importe nocial bruto)276,825

18(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) (177,660)

19Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) 99,164

Capital y exposiciones totales

20Capital de Nivel 1 64,042

21Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) 720,944

Coeficiente de apalancamiento

22Coeficiente de apalancamiento de Basilea III8.88%

Cifras en millones de pesos

TABLA II.1

COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

REFERENCIADESCRIPCIONMar-22

1Activos totales 655,507

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(665)

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(22,186)

5Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores(1,513)

6Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden 99,164

7Otros ajustes(9,364)

8Exposición del coeficiente de apalancamiento 720,944

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 54 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

TABLA III.1

CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIADESCRIPCIONMar-22

1Activos totales 655,507

2Operaciones en instrumentos financieros derivados(30,073)

3Operaciones en reporto y prestamos de valores(3,187)

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 622,247

TABLA IV.1

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

CONCEPTO/PERIODOMar-22

Capital Básico 1/ 64,042

Activos Ajustados 2/ 720,944

Razón de Apalancamiento 3/8.88%

Cifras previas a la réplica de Banxico

Elementos de la Razón de Apalancamiento al 31 de marzo de 2022.

El indicador de la razón de apalancamiento se ubicó en 8.88%, debido principalmente a los buenos resultados que han incrementado el capital del grupo.

TABLA I.2

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

REFERENCIAEXPLICACIÓN

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico

(menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.

2Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.

3Suma de las líneas 1 y 2

4Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:

Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución.

La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.

El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.

El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente.

El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 55 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.

En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.

5Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.

En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.

6No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.

7Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.

8No aplica.

9No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

10No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

11Suma de las líneas 4 a 10

12Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)

de operaciones de reporto y préstamo de valores. El importe no deberá considerar ninguna compensación conforme a los Criterios Contables.

13Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:

Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.

Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.

Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.

Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.

El monto se debe registrar con signo negativo.

14Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.

15Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 56 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 DESCRIPCIÓN

1 Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2 Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos b), d), e), f), g), h), i), j) y l) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

El monto se debe registrar con signo negativo.

3 No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

4 Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 11 de la Tabla I.1 y la cifra presentada en operaciones con instrumentos financieros derivados contenidos en el balance de la Institución.

El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.

5 Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 16 de la Tabla I.1 y la cifra presentada por operaciones de reporto y préstamo de valores contenidos en el balance de la Institución.

El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.

6 Importe registrado en la fila 19 de la Tabla I.1. El monto se debe registrar con signo positivo.

7 Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos c), k), m), n), p), q) y r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

El monto se debe registrar con signo negativo.

8 Suma de las líneas 1 a 7, la cual debe coincidir con la línea 21 de la Tabla I.1.

TABLA III.2

NOTAS A LA CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIA DESCRIPCIÓN

1 Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2 El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 57 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

presentadas en el activo de los últimos estados financieros.

El monto se debe registrar con signo negativo.

3El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores presentadas en el activo de los últimos estados financieros.

El monto se debe registrar con signo negativo.

4No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

5Suma de las líneas 1 a 4, la cual debe coincidir con la línea 1 de la Tabla I.1

Agencias Calificadoras

Scotiabank-Calificaciones Escala NacionalLargo plazoCorto plazoPerspectiva

Fitch RatingsAAA(mex)F1+(mex)Estable

Standard & Poor'ssmxAAAmxA-1+Estable

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

Dividendos

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

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

Fecha de pago Importe

23 de abril de 2013 \$ 165 millones

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

Mediante Asamblea General ordinaria de Accionistas de fecha 24 de mayo del 2013, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo por la cantidad de \$299'944,566.00 (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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 58 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6'200,000,000 (Seis mil doscientas millones) de acciones de las series "F" y "B, que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank, mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta "Resultados Ejercicios Anteriores"

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

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

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

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

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

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

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de marzo del 2022, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$60,764 millones de pesos.
Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$44,771 millones de pesos.

Adicionalmente:

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

Inversiones relevantes en capital

Al 31 de marzo de 2022, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.

Instrumentos Financieros Derivados

I. Información Cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.

Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

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

Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.

Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

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

Manual de Operación de Derivados.

Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

Política de Riesgo de Contraparte

Política de Sobregiros

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados. Durante el primer trimestre de 2022, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

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

Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 62 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles movimientos de las tasas de interés y de tipo de cambio. Las condiciones de mercado bajo las cuales se realizan coberturas son las siguientes:

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

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

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

Subyacente*FuturosOpcionesSwaps

MRMEMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

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

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

El Modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo

El Modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.

El Modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados.)

El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.

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

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

Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 64 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 2022 y en promedio para el primer trimestre de 2022 es de:

Scotiabank Posición Posición
(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 49,01665,663
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 83,803110,172

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

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

Clase de activo Derivado Tipo Breve descripción
Tasas de interés Opciones Europea Caps, Floors:
Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets.
 $Cap = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$
Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet.
 $Floor = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$
Binaria La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:
Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 65 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap).
Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).

IRSEL intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).

CCIRS Intercambio de intereses en moneda

nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.

Tipo de cambio Opciones Europea En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.

Americana El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)

Binaria Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción.

A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.

Barrera Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento S_T , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{(t < T)}$, son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria.

Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente S_T alcance un umbral preestablecido H llamado barrera de la opción.

Forward Forward OTCCompra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

Instrumentos a Valor Razonable

Clase de activo Derivado Tipo Breve descripción

Índices, capitales y metales Opciones

Europea Opción Europea Call / Put: Este tipo de contratos utiliza la fórmula de Black-Scholes.

Opción Europea Quanto: Una opción tipo Quanto es un derivado en el cual el subyacente se denomina en una moneda, pero el instrumento en sí se liquida en otra moneda a una tasa determinada. Tales productos son atractivos para los inversionistas que desean estar expuestos a un activo extranjero, pero sin el riesgo de tipo de cambio equivalente.

Binaria Tipo de opción la cual al vencimiento solo tiene dos eventos pagar o no pagar un monto previamente definido.

Derivados listados Mexder Futures IRLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre Contrato de Intercambio de Flujos de Tasas son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

FXLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre el tipo de cambio son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

Instrumentos valuados a costo

Clase de activo Nombre de producto Metodología Notas

FI Security Bonos Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

EQ Cash Acciones Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 66 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

datos del mercado.

Fondos de inversiónETFsLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Notas Estructuradas listadasBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Políticas Líneas de Crédito

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

Tipos de Operación que son ofrecidos en función al tipo de acreditado

a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

Necesidades de tesorería del Banco

Relación de corresponsalía

Límites recíprocos

b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c)Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:

Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

Tesorería: Call Money

Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

Cambios: FOREX

Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

Metales

Sujetos de Crédito

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

Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat

Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.

Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)

Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público

Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure".

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

Idoneidad del Cliente

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

El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar

Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

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

Políticas de VaR

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

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

b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

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

realizan diariamente en forma automática, con procedimientos desarrollados por la Dirección de TFRM.

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

Bonos de Tasa Flotante

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

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

Bonos Cupón Cero

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

Riesgo de Crédito

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

Sensibilidad del Pasivo

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

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

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

En el caso de Swaps sobre otro tipo de tasas de interés, lo cual puede incluir CETES y/o Libor, los cálculos se realizan directamente haciendo un shock de 1 y 100 puntos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 69 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

base sobre la curva cupón cero. Todas las transacciones realizadas sobre subyacentes distintos de TIIE están autorizados sólo en una base back to back

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con los requerimientos del B5 para concluir cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2022 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son cobertura eficiente.

Durante el primer trimestre de 2022 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 70 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

la fecha de actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos del B5 aplicables a Instituciones de Crédito.

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

En adición a lo arriba descrito, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base 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 2022 y promedio del primer trimestre 2022 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank Posición Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 83,803,110,172

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.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 71 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

Parámetro Descripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

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

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

Scotiabank Normal Escenario Posible Escenario Probable Escenario de Estrés
(millones de pesos)

Gap 30d Gap Acum 49,01646,22546,22546,225

Cambios en el Gap respecto al escenario normal (2,791) (2,791) (2,791)

d. Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

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

Vega

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

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

Rho

Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portafolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 73 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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

II. Información Cuantitativa

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa.

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a marzo 31, 2022:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total	Today
Swaps	1,443.00	(2,731.00)	22,543.00	(5,785.00)	(25,478.00)	646.00	(9,362.00)	
CCS	1.00	12.00	(2.00)	(22.00)	10.00	(1.00)	(2.00)	
Caps&Floors	(44.00)	135.00	6.00	9.00	--	106.00		
Binary Caps&Floors	-----							
TIIE Futures	-----							
Mbonds Futures	-----							
Total DERIVATIVES	1,400.00	(2,584.00)	22,547.00	(5,798.00)	(25,468.00)	645.00	(9,258.00)	

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 74 / 82
 CONSOLIDADO
 Impresión Final

Los impactos en los estados de resultados son:

- a) Bajo el escenario probable una pérdida de (10.02) Millones de pesos.
- b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (20.04) Millones de pesos.
- c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (49.63) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad Instrumento Sensibilidad MTM Probable

Shock (+/-) P&L Stress 1

Shock (+/-) P&L Stress 2

Shock (+/-) P&L

- 1pb a la tasa Futuros de TIIIE y Bono M--50.00-100.00-200.00-

- 1pb a la tasa IRS & CCS & Delta Caps (0.01) (109.84) 50.00 (0.46) 100.00 (0.93) 200.00 (1.85)

Volatilidad al 1% Caps & Floors (0.01) (0.23) 0.10 (0.00) 0.40 (0.00) 1.00 (0.01)

a FX %Forwards 4.8095.540.10 (9.56) 0.20 (19.11) 0.50 (47.77)

a FX %Opciones Divisa--0.100.000.20-0.500.00

Total (10.02) (20.04) (49.63)

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 31 marzo de 2022 (la sensibilidad de las opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Delta Vega Gamma

Options IDBTVR.INDX---

Options MEXEZU.USM---

Options MEXFXI.USM---

Options MEXIL5.INDX---

Options MEXIXM.INDX---

Options MEXMCH.USM---

Options MEXMSF.INDX---

Options MEXMSI.INDX---

Options MEXQQQ.USM---

Options MEXSR5.INDX---

Options MEXXLE.USM---

TOTAL---

Análisis de Stress

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

Escenarios a la Baja

(0.1) (0.3) (0.5)

Options IDBTVR.INDX---

Options MEXEZU.USM---

Options MEXFXI.USM---

Options MEXIL5.INDX---

Options MEXIXM.INDX---

Options MEXMCH.USM---

Options MEXMSF.INDX---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 75 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Options MEXMSI.INDX---
Options MEXQQQ.USM---
Options MEXIBX.INDX---
Options MXSXAE.INDX---
TOTAL---

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

Escenarios a la Alza

0.050.150.2

Options IDBTVR.INDX---
Options MEZEZU.USM---
Options MEXFXI.USM---
Options MEXIL5.INDX---
Options MEXIXM.INDX---
Options MEXMCH.USM---
Options MEXMSF.INDX---
Options MEXMSI.INDX---
Options MEXQQQ.USM---
Options MEXIBX.INDX---
Options MXSXAE.INDX---
TOTAL---

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del EscenarioMonto

Probable(0.00)

Poco Probable(0.00)

Muy poco Probable(0.00)

Describir y numerar las llamadas de margen que se hayan presentado durante el trimestre Respecto a las llamadas de margen, al 31 de marzo de 2022 se tienen los siguientes saldos:

Cifras expresadas en pesos

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado

CLIENTE 1MXN	86,100,000.00	(39,500,000)	
CLIENTE 2MXN		31,000,000	(31,000,000)
CLIENTE 3MXN	9,300,000.00		(26,600,000)
CLIENTE 4MXN		85,900,000	(109,100,000)
CLIENTE 5MXN		154,400,000	(58,200,000)
CLIENTE 6MXN		807,200,583	(428,300,000)
CLIENTE 7USD		6,700,000	(20,290,000)
CLIENTE 8USD		83,880,000	(6,070,000)
CLIENTE 9USD		209,170,000	(65,300,000)
CLIENTE 10USD			- (980,000)
CLIENTE 11USD		3,430,000	(5,960,000)
CLIENTE 12USD		300,000	
-			
CLIENTE 13USD		26,960,000	(28,440,000)
CLIENTE 14USD		260,000	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 76 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

-		
CLIENTE 15USD	9,760,000	(22,640,000)
CLIENTE 16MXN	312,600,000	(266,500,000)
CLIENTE 17MXN	146,300,000	(181,200,000)
CLIENTE 18MXN	23,400,000	(13,400,000)
CLIENTE 19MXN	-	(29,700,000)
CLIENTE 20MXN	342,400,000	(684,100,000)
CLIENTE 21USD	16,010,000	
-		
CLIENTE 22MXN	89,000,000	
-		
CLIENTE 23MXN	52,872,686	(8,061,341,000)
CLIENTE 24MXN	25,000,000	(12,400,000)
CLIENTE 25MXN	-	(127,700,000)
CLIENTE 26USD	5,130,000	(7,580,000)
CLIENTE 27USD	-	(4,715,000)
CLIENTE 28USD	2,780,000	(9,800,000)
TOTAL	2,529,853,269.30	(10,240,816,000)

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 77 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 78 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 79 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 80 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 81 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Liquidados anticipadamente

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

Cifras expresadas en pesos

Deal	Producto	Fecha de evento	Contraparte/
SAK055	Interest Rate Swap	ene-22	Ciudad de México
SX6539	Interest Rate Swap	ene-22	Ciudad de México
SAK055	Interest Rate Swap	feb-22	Ciudad de México
SX6539	Interest Rate Swap	feb-22	Ciudad de México
C67387	Cross Currency Swaps	feb-22	Ciudad de México
C67387	Cross Currency Swaps	feb-22	Ciudad de México
C67390	Cross Currency Swaps	mar-22	Ciudad de México
C67390	Cross Currency Swaps	mar-22	Ciudad de México
SDT815	Interest Rate Swap	mar-22	Ciudad de México
LLAMADA DE MARGEN		mar-22	Ciudad de México
SDT175	Interest Rate Swap	mar-22	Ciudad de México

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 82 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

SDS941Interest Rate Swapmar-22Cliente 12MXN71,913NO FONDEO SU CUENTA
SDT297Interest Rate Swapmar-22Cliente 13MXN6,025NO FONDEO SU CUENTA
2022022403316 Forwards FXmar-22Cliente 14USD122,000NO FONDEO SU CUENTA
SDW519Interest Rate Swapmar-22Cliente 15MXN4,958NO ENVIO LOS FONDOS
SAK055Interest Rate Swapmar-22Cliente 16MXN666,296NO FONDEO SU CUENTA
SDS115Interest Rate Swapmar-22Cliente 17MXN2,556NO FONDEO SU CUENTA
SX6539Interest Rate Swapmar-22Cliente 18MXN692,591NO FONDEO SU CUENTA
SDT314Interest Rate Swapmar-22Cliente 19MXN52,869NO FONDEO SU CUNETA
C67387Cross Currency Swapsmar-22Cliente 20MXN2,172,412NO FONDEO SU CUNETA
C67387Cross Currency Swapsmar-22Cliente 21MXN275,738NO FONDEO SU CUNETA

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte
Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados
Cifras expresadas en pesos

"Ver archivo completo en pdf"

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

(1) Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 29 de Abril de 2022, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y H. Valerio Bustos Quiroz (Director Contabilidad Grupo) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

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

La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2021 y 2020.

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

Bases de presentación

a) Declaración de cumplimiento

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

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

b) Uso de juicios y estimaciones

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Juicios

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

Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

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

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

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

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

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

- Reconocimiento de activos por impuestos y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU) diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables y la materialización de los impuestos y PTU diferidos.

c) Moneda funcional y de informe

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

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

d) Reconocimiento de activos y pasivos por instrumentos financieros

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

(2) Resumen de las principales políticas contables-

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en la preparación de los estados financieros consolidados que se presentan, y han sido aplicados consistentemente por el Banco.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 3 / 88
CONSOLIDADO
Impresión Final

(a) Reconocimiento de los efectos de la inflación-

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

Los ejercicios terminados el 31 de diciembre de 2021 y 2020, son considerados como entorno económico no inflacionario (inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores menor que el 26%), conforme a lo establecido en la NIF B-10 "Efectos de la inflación"; consecuentemente no se reconocen los efectos de la inflación en la información financiera del Banco. En caso de que se vuelva a estar en un entorno inflacionario, se deberán registrar de manera retrospectiva los efectos acumulados de la inflación no reconocidos en los periodos en los que el entorno fue calificado como no inflacionario. El porcentaje de inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores se muestra a continuación:

Inflación	31 de diciembre de	UDI	Del año	Acumulada
2021	7.1082337.61%			14.16%
2020	6.6055973.23%			11.31%
2019	6.3990182.77%			15.03%

(b) Compensación de activos financieros y pasivos financieros-

Los activos y pasivos financieros reconocidos son objeto de compensación de manera que se presente en el balance general consolidado el saldo deudor o acreedor, según corresponda, si y sólo si, se tiene el derecho contractual de compensar los importes reconocidos, y la intención de liquidar la cantidad neta, o de realizar el activo y cancelar el pasivo, simultáneamente.

(c) Bases de consolidación-

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

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2021 y 2020, se detallan a continuación:

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

(d) Disponibilidades-

Este rubro se compone de efectivo, saldos bancarios en moneda nacional y dólares, así como operaciones de compraventa de divisas que no se consideren derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable. Adicionalmente, incluye disponibilidades restringidas conformadas por préstamos interbancarios pactados a un

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 4 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

plazo menor o igual a tres días (operaciones de "Call Money") y depósitos en el Banco Central, estos últimos incluyen los depósitos de regulación monetaria que el Banco está obligado a mantener conforme a las disposiciones emitidas por el Banco Central con el propósito de regular la liquidez en el mercado de dinero; dichos depósitos carecen de plazo, y generan intereses a la tasa promedio de la captación bancaria, mismos que son reconocidos en resultados conforme se devengan.

Las disponibilidades se reconocen a su valor nominal. En el caso de cuentas bancarias denominadas en dólares, el tipo de cambio utilizado para la conversión es el publicado por el Banco Central. El efecto de valorización y los intereses ganados se registran en resultados, como ingreso o gasto por intereses, según corresponda, conforme se devengan.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

operaciones", respectivamente.

(e) Cuentas de margen-

Los activos financieros otorgados en efectivo requeridos al Banco con motivo de la celebración de operaciones con derivados realizados en mercados o bolsas reconocidos se reconocen a su valor nominal y se presentan en el rubro de "Cuentas de margen". El valor de la cuenta de margen otorgada en efectivo se modifica por las liquidaciones parciales o totales que la cámara de compensación deposita o retira y por las aportaciones adicionales o retiros efectuados por el Banco.

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

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

(f) Inversiones en valores-

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

Títulos para negociar-

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

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

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

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio neto a favor provenientes de inversiones en valores se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 6 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de "Ingresos por intereses".

Títulos disponibles para la venta-

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

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

Los intereses devengados se determinan conforme al método de interés efectivo y se reconocen en los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses".

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de "Ingresos por intereses".

La utilidad o pérdida en cambios proviene de los títulos clasificados como disponibles para la venta denominados en moneda extranjera y se reconoce dentro de los resultados del ejercicio.

Títulos conservados al vencimiento-

Son aquellos títulos de deuda, con pagos fijos o determinables y con vencimiento fijo, respecto a los cuales se tiene tanto la intención como la capacidad de conservarlos hasta su vencimiento. Los títulos se reconocen inicialmente a su valor razonable que es presumiblemente el precio pagado y posteriormente se valúan a su costo amortizado, lo cual implica que la amortización del premio o descuento, así como de los costos de transacción, forman parte de los intereses devengados que se reconocen en resultados dentro del rubro "Ingresos por intereses". Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan y una vez que se enajenan los títulos, se reconoce el resultado por compraventa por la diferencia entre el valor neto de realización y el valor en libros de los títulos, dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Deterioro del valor de un título-

Cuando se tiene evidencia objetiva de que un título disponible para la venta o conservado a vencimiento presenta un deterioro como resultado de uno o más eventos que ocurrieron posteriormente al reconocimiento inicial del título, el valor en libros del título se modifica y el monto del deterioro se reconoce en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Resultado por intermediación". Para los títulos disponibles para la venta, el monto de la pérdida reconocida en el capital contable se reclasifica a los resultados del ejercicio.

Si en un período posterior, el valor razonable del título se incrementa, y dicho efecto está relacionado objetivamente con un evento que ocurra después de que el deterioro fue reconocido en los resultados del ejercicio, el deterioro se revierte en los resultados

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

del ejercicio, excepto si se trata de un instrumento de patrimonio.

Al 31 de diciembre de 2021 y 2020, la Administración del Banco no ha identificado que exista evidencia objetiva del deterioro de algún título.

Operaciones fecha valor-

Los títulos adquiridos que se pacte liquidar en fecha posterior hasta un plazo máximo de cuatro días hábiles siguientes a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como títulos restringidos, en tanto que, los títulos vendidos se reconocen como títulos por entregar disminuyendo las inversiones en valores. La contrapartida deberá ser una cuenta liquidadora, acreedora o deudora, según corresponda. Cuando el monto de títulos por entregar excede el saldo de títulos en posición propia de la misma naturaleza (gubernamentales, bancarios, accionarios y otros títulos de deuda), se presenta en el pasivo dentro del rubro de "Valores asignados por liquidar".

Reclasificación entre categorías-

Los Criterios Contables permiten efectuar reclasificaciones de la categoría de títulos conservados al vencimiento hacia títulos disponibles para la venta, siempre y cuando no se tenga la intención o capacidad de mantenerlos hasta el vencimiento. El resultado por valuación correspondiente a la fecha de reclasificación se reconoce en el capital contable. En caso de reclasificaciones hacia la categoría de títulos conservados a vencimiento, o de títulos para negociar hacia disponibles para la venta, se podría efectuar únicamente con autorización expresa de la Comisión Bancaria. Asimismo, en caso de ventas de títulos conservados a vencimiento deberá informarse a la Comisión Bancaria. Durante los años terminados el 31 de diciembre de 2021 y 2020, el Banco no llevó a cabo transferencias entre categorías, ni ventas de títulos conservados a vencimiento.

(g) Préstamo de valores-

En la fecha de contratación de las operaciones de préstamo de valores actuando el Banco como prestamista, en lo que se refiere a los valores objeto del préstamo, se reclasifican como restringidos en el balance general consolidado dentro del rubro de "Inversiones en valores"; mientras que actuando como prestatario se reconocen en cuentas de orden en el rubro de "Colaterales recibidos por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes".

El importe del premio devengado actuando el Banco como prestamista o prestatario se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio, a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación en el rubro de "Ingresos por intereses" o "Gastos por intereses", respectivamente, contra el rubro de "Préstamo de valores" dentro del activo o pasivo, según corresponda.

En el caso de que el Banco, previo al vencimiento de la operación de préstamo de valores, venda el colateral recibido como prestamista o el valor objeto de la operación como prestatario, reconoce la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como la obligación de restituir dicho colateral al prestatario o el valor objeto de la operación al prestamista dentro del rubro de "Colaterales vendidos o dados en garantía", dicha obligación es medida inicialmente al precio pactado y posteriormente se valúa a valor razonable, el efecto por valuación se presenta en resultados dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

La diferencia entre el precio recibido y el valor razonable del valor objeto de la operación o de los colaterales recibidos, que en su caso exista en el momento de

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 8 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

vender, se presenta en el rubro de "Resultado por intermediación".

(h) Operaciones de reporto-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco actuando como reportada reconoce la entrada del efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar; mientras que actuando como reportadora reconoce la salida de disponibilidades o bien una cuenta liquidadora acreedora, así como una cuenta por cobrar. Tanto la cuenta por pagar como la cuenta por cobrar son medidas inicialmente al precio pactado, lo cual representa la obligación de restituir o el derecho a recuperar el efectivo, respectivamente.

A lo largo de la vigencia del reporto la cuenta por cobrar y por pagar se valúan a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devengue, de acuerdo al método de interés efectivo; dicho interés se reconoce dentro del rubro de "Ingresos por intereses" o "Gastos por intereses", según corresponda. La cuenta por cobrar y por pagar, así como los intereses devengados se presentan en el rubro de "Deudores por reporto" y "Acreedores por reporto", respectivamente.

El Banco actuando como reportadora reconoce el colateral recibido en cuentas de orden en el rubro "Colaterales recibidos por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes". Los activos financieros otorgados como colateral, actuando el Banco como reportada se reclasifican en el balance general consolidado dentro del rubro de "Inversiones en valores", presentándolos como restringidos.

En caso de que el Banco, actuando como reportadora venda el colateral o lo otorgue en garantía, reconoce los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral a la reportada, la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. Dicha cuenta por pagar se compensa con la cuenta por cobrar que es reconocida cuando el Banco actuando como reportadora se convierte a su vez en reportada y, se presenta el saldo deudor o acreedor en el rubro de "Deudores por reporto" o en el rubro de "Colaterales vendidos o dados en garantía", según corresponda.

Adicionalmente, el colateral recibido, entregado o vendido se reconoce en cuentas de orden dentro del rubro de "Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes".

(i) Derivados-

Las operaciones con instrumentos financieros derivados comprenden aquellas con fines de negociación y de cobertura; los derivados sin consideración de su intencionalidad se reconocen a valor razonable.

El efecto por valuación de los derivados con fines de negociación se presenta en el balance general consolidado y en el estado consolidado de resultados dentro de los rubros "Derivados", en el activo o pasivo, según corresponda, y "Resultado por intermediación", respectivamente. El efecto por el riesgo de crédito (contraparte) de los derivados, debe determinarse de acuerdo a la metodología del área de riesgos, y debe reconocerse en los resultados en el periodo en que ocurra contra la cuenta complementaria.

La porción efectiva del resultado por valuación de las coberturas designadas como de

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 9 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

flujo de efectivo se reconoce en el capital contable dentro del rubro "Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo", en tanto que la porción inefectiva del cambio en el valor razonable se reconoce de manera inmediata en resultados dentro del rubro "Resultado por intermediación" y la contracuenta con dicho efecto se presenta en el balance general consolidado dentro del rubro de "Derivados". La ganancia o pérdida asociada a la cobertura de la transacción pronosticada que haya sido reconocida en el capital contable, se reclasifica al estado consolidado de resultados dentro del mismo rubro donde se presenta el resultado por valuación de la partida cubierta atribuible al riesgo cubierto, en el mismo periodo durante el cual los flujos de efectivo pronosticados cubiertos afecten los resultados del ejercicio.

En el caso de que el derivado de cobertura de flujo de efectivo expire, sea ejercido, terminado o la cobertura no cumpla con los requisitos para ser considerada como tal, se revoca la designación de cobertura a la vez que la valuación del derivado de cobertura de flujo de efectivo que se encuentra dentro de capital contable permanece en dicho rubro y se reconoce cuando la transacción pronosticada ocurre en los resultados dentro del mismo rubro donde se presenta el resultado por valuación atribuible al riesgo cubierto.

La ganancia o pérdida que resulte de valorar el derivado de cobertura de valor razonable se reconoce en el balance general consolidado en el rubro de "Derivados" y en el estado consolidado de resultados en los rubros de "Ingresos por intereses" y "Resultado por intermediación", dado que corresponden a coberturas de tasa de interés de cartera de crédito e inversiones en valores clasificadas como disponibles para la venta, respectivamente. El resultado por valuación de la partida atribuible al riesgo cubierto, se reconoce en el balance general consolidado en el rubro de "Ajustes de valuación por cobertura de activos financieros" y se reconoce en los resultados del ejercicio, tratándose de cartera de crédito, en el rubro de "Ingresos por intereses", mientras que por las inversiones en valores clasificadas como disponibles para la venta se reconocen dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

Derivados implícitos y estructurados

El Banco mantiene derivados implícitos que no se utilizan para cubrir posiciones, sino como estrategia de negociación; dichos derivados se encuentran relacionados a estructuras y/o notas emitidas bajo las siguientes características:

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que, por medio de opciones implícitas, se puede ofrecer un rendimiento garantizado y/o se mejora la tasa de rendimiento del cliente.

El valor razonable del componente derivado se registra dentro de los rubros de "Derivados" y "Resultado por intermediación, neto". Los intereses devengados se reconocen en el rubro de "Gastos por intereses". Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de derivados no realizadas en mercados o bolsas reconocidos-

El colateral es una garantía constituida para asegurar el pago de las contraprestaciones pactadas en contratos con instrumentos financieros derivados en operaciones no realizadas en mercados o bolsas reconocidos.

El otorgamiento de colaterales entregados en efectivo en operaciones de derivados no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se registran como una cuenta por cobrar que se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que los colaterales recibidos en efectivo se registran en el rubro de "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Los colaterales entregados en títulos se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

(j)Compensación de cuentas liquidadoras-

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reporto y/o de operaciones con derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados se registran en cuentas liquidadoras, incluyendo los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día.

Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y la intención de liquidar la cantidad neta, o de realizar el activo y cancelar el pasivo, simultáneamente.

Las cuentas liquidadoras se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" o "Acreedores por liquidación de operaciones", según corresponda.

(k)Cartera de crédito-

Representa el saldo de la disposición total o parcial de las líneas de crédito otorgadas a los acreditados más los intereses devengados no cobrados, menos los intereses cobrados por anticipado. La estimación preventiva para riesgos crediticios se presenta deduciendo los saldos de la cartera de crédito.

Las líneas de crédito no dispuestas se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios". El monto que es dispuesto por el acreditado se considerará dentro de la cartera de crédito conforme a la categoría de cartera que le corresponda.

Al momento de su contratación, las operaciones con cartas de crédito se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios", las cuales, al ser ejercidas por el cliente o por su contraparte se traspasan a la cartera de créditos.

Los créditos otorgados en garantía, se reconocen como créditos restringidos.

Cartera INFONAVIT-

La cartera en prórroga se integra por todos aquellos créditos a la vivienda originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT) adquiridos por las entidades financieras, y que en términos de la Ley del INFONAVIT, cuenten con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios, al concluir la prórroga la cartera recibirá el tratamiento que le corresponda de: Régimen Ordinario de Amortización (ROA) o Régimen Especial de Amortización (REA). Lo anterior, siempre y cuando la entidad financiera esté contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos del organismo de referencia.

REA es la modalidad de pago de los créditos cuyos derechos fueron adquiridos por el Banco al INFONAVIT, prevista por las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del INFONAVIT" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

ROA es la modalidad de pago de los créditos cuyos derechos fueron adquiridos por el

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 11 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Banco al INFONAVIT, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

Créditos e intereses vencidos-

Los saldos insolutos de los créditos e intereses se clasifican como vencidos de acuerdo con los siguientes criterios:

1. Se tenga conocimiento de que el acreditado es declarado en concurso mercantil, conforme a la Ley de Concursos Mercantiles.

Se exceptúa de la regla anterior aquellos créditos que continúen recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles, así como los créditos otorgados al amparo del artículo 75 en relación con las fracciones II y III del artículo 224 de la citada Ley; sin embargo, cuando incurran en los supuestos previstos en el punto 2 siguiente, serán traspasados a cartera vencida.

2. Sus amortizaciones no hayan sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, considerando lo siguiente:

a) si los adeudos consisten en créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento y presentan 30 o más días naturales de vencidos;

b) si los adeudos se refieren a créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses y presentan 90 o más días naturales de vencido el pago de intereses respectivo, o bien 30 o más días naturales de vencido el principal;

c) si los adeudos consisten en créditos con pagos periódicos parciales de principal e intereses, incluyendo los créditos a la vivienda, presentan 90 o más días naturales de vencidos;

d) si los adeudos consisten en créditos revolventes y presentan dos periodos mensuales de facturación vencidos o, en caso de que el periodo de facturación sea distinto al mensual, cuando corresponda a 60 o más días naturales de vencidos, y

e) los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes que cuentan con línea de crédito, así como los documentos de cobro inmediato, al momento en el cual se presente dicho evento.

3. Para el caso de cartera en prórroga y créditos a la vivienda, cuando las amortizaciones no hayan sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presenten 90 o más días de vencidos:

a) los pagos correspondientes a los créditos que el Banco haya adquirido al INFONAVIT o el Fondo de la Vivienda del Instituto de Seguridad y Servicios Sociales de los Trabajadores del Estado (FOVISSSTE), conforme a la modalidad de pago correspondiente (REA o ROA), así como

b) los créditos otorgados a personas físicas destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial que estén respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado.

El traspaso al rubro de "Cartera de crédito vencida" de los créditos a que se refiere el numeral 3 del párrafo anterior se sujetará al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 12 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

a) los recursos del crédito sean dispuestos para el fin con que fueron otorgados;
b) el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o
c) el Banco haya recibido el pago parcial de la amortización correspondiente. La excepción contenida en el presente inciso será aplicable siempre y cuando se trate de créditos bajo el esquema ROA, y cada uno de los pagos realizados durante dicho periodo representen, al menos, el 5% de la amortización pactada.

Las excepciones contenidas en los incisos a), b) y c) anteriores, no serán excluyentes entre sí.

Cuando un crédito es traspasado a cartera vencida, se suspende la acumulación de intereses devengados y se lleva el registro de los mismos en cuentas de orden. Asimismo, se suspende la amortización en resultados del ejercicio de los ingresos financieros devengados. Cuando dichos intereses son cobrados se reconocen directamente en resultados en el rubro de "Ingresos por intereses". El reconocimiento en resultados de los ingresos por intereses se reanuda cuando la cartera deja de considerarse como vencida.

Por los intereses devengados no cobrados correspondientes a créditos considerados como cartera vencida, se constituye una estimación por el equivalente al total de éstos al momento del traspaso del crédito como cartera vencida. Para los créditos vencidos en los que en su reestructuración se acuerde la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, se constituye una estimación por el total de dichos intereses. La estimación se cancela cuando se cuenta con evidencia de pago sostenido.

El traspaso de créditos de cartera vencida a vigente se realiza cuando los acreditados liquidan la totalidad de los saldos pendientes de pago (principal e intereses, entre otros), excepto los créditos reestructurados o renovados, que se traspasan a cartera vigente cuando éstos cumplen oportunamente con el pago sostenido.

Pago sostenido

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado presenta cumplimiento de pago sin retraso por el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito, o en caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 60 días naturales, el pago de una exhibición.

En los casos de los créditos que el Banco adquiera al INFONAVIT, en los que esté obligada a respetar los términos que los organismos de referencia contrataron con los acreditados, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado haya cubierto sin retraso el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de una amortización en los créditos bajo el esquema de ROA y tres amortizaciones para los créditos bajo el esquema de REA.

En los créditos con pagos periódicos de principal e intereses cuyas amortizaciones sean menores o iguales a 60 días en los que se modifique la periodicidad del pago a periodos menores derivado de la aplicación de una reestructura, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado presenta cumplimiento de pago de amortizaciones equivalentes a tres amortizaciones consecutivas del esquema original del crédito.

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan la reclasificación al rubro de "Cartera de crédito vencida", para determinar las tres

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 13 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

amortizaciones consecutivas requeridas para la existencia de pago sostenido, se deberá considerar el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalga al plazo más extenso.

Tratándose de créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, se considera que existe pago sostenido del crédito cuando, ocurra alguno de los siguientes supuestos:

a) el acreditado haya cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,

b) se hubiere cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días.

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados (amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito, o en caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 60 días naturales, el pago de una exhibición), distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido.

En cualquier caso, para que el Banco demuestre que existe pago sostenido, además de asegurarse que el acreditado cumpla con los lineamientos de pago sostenido indicados en los párrafos anteriores, debe tener a disposición de la Comisión Bancaria evidencia que justifique que el acreditado cuenta con capacidad de pago en el momento que se lleve a cabo la reestructura o renovación para responder a las nuevas condiciones del crédito. La evidencia mínima que deberá obtener lo que se señala a continuación:

- i. probabilidad de incumplimiento intrínseca al acreditado,
- ii. las garantías otorgadas al crédito reestructurado o renovado,
- iii. la prelación de pago frente a otros acreedores y,
- iv. la liquidez del acreditado ante la nueva estructura financiera del financiamiento.

Reestructuras y renovaciones

Un crédito se considera reestructurado cuando el acreditado solicita al Banco cualquiera de las siguientes situaciones:

- 1) Ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate, o bien,
- 2) Modificaciones a las condiciones originales del crédito o al esquema de pagos, entre las que se encuentran:
 - a) Cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;
 - b) Cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, VSM o UDI);
 - c) Concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito, excepto por los que forman parte de los programas de apoyo COVID, o
 - d) Prórroga del plazo del crédito.

Los créditos vencidos que se reestructuren o se renueven permanecerán dentro de la cartera vencida, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Los créditos con pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento que se reestructuren durante el plazo del crédito o se renueven en cualquier momento serán considerados como cartera vencida en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos vigentes que se reestructuren o se renueven, sin que haya transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se considerará que continúan siendo vigentes, únicamente cuando el acreditado hubiere:

- i) cubierto la totalidad de los intereses devengados, y
- ii) cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto.

Los créditos vigentes que se reestructuren o renueven durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, se considerarán vigentes únicamente cuando el acreditado hubiere:

- i) liquidado la totalidad de los intereses devengados;
- ii) cubierto la totalidad del monto original del crédito que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto, y
- iii) cubierto el 60% del monto original del crédito.

En caso de no cumplirse todas las condiciones descritas anteriormente serán considerados como vencidos desde el momento en que se reestructuren o renueven y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Aquellos créditos catalogados como revolventes, que se reestructuren o renueven, en cualquier momento se considerarán vigentes únicamente cuando el acreditado hubiere liquidado la totalidad de los intereses devengados, el crédito no presente periodos de facturación vencidos y se cuente con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor.

No se considerarán como tales a aquéllas que a la fecha de la reestructura presenten cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las siguientes condiciones originales del crédito:

- i) Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.
- ii) Tasa de interés: cuando se mejore la tasa de interés pactada.
- iii) Moneda: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda.
- iv) Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago deberá permitir la omisión de pago en periodo alguno.

Las reestructuras o renovaciones de créditos de cartera se efectúan en apego a lo establecido en las "Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito" y la viabilidad de las mismas es analizada de forma particular.

El Banco evalúa periódicamente si un crédito vencido debe permanecer en el balance general consolidado, o bien, ser castigado, siempre y cuando estén provisionados al 100%. Dicho castigo se realiza cancelando el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios creada con anterioridad para cada crédito. Cualquier recuperación derivada de créditos previamente castigados o

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 15/ 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

eliminados, deberá reconocerse en los resultados del ejercicio.

Durante el primer trimestre de 2021, la Administración del Banco Actualizó los criterios sobre castigos financieros para créditos hipotecarios, quedando estos a partir de 60 mensualidades vencidas.

Las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos, es decir, el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total, se registran con cargo a la estimación preventiva para riesgos crediticios. En caso de que el importe de éstas exceda el saldo de la estimación asociada al crédito, previamente se constituyen estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

Comisiones

Las comisiones cobradas por el otorgamiento del crédito se registrarán como un crédito diferido, el cual se amortizará contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses, bajo el método de línea recta durante la vida del crédito, excepto las que se originen por créditos revolventes que deberán ser amortizadas por un periodo de 12 meses.

Tratándose de las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos, estas deberán adicionarse a las comisiones que se hubieran originado conforme al párrafo anterior reconociéndose como un crédito diferido, el cual se amortizará contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses, bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito.

No entrarán en esta categoría las comisiones que se reconozcan con posterioridad al otorgamiento del crédito, aquellas que se generen como parte del mantenimiento de dichos créditos, ni las que se cobren con motivo de créditos que no hayan sido colocados. En el caso de comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito, ya sea la primera anualidad o subsecuentes por concepto de renovación, se reconocerán como un crédito diferido y serán amortizadas en un periodo de 12 meses contra los resultados del ejercicio en el citado rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Las comisiones cobradas que se originen por el otorgamiento de una línea de crédito que no haya sido dispuesta, en ese momento se reconocerán como un crédito diferido, el cual se amortizará contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta por un periodo de 12 meses. En el caso de que la línea de crédito se cancele antes de que concluya el periodo de 12 meses, el saldo pendiente por amortizar deberá reconocerse directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de comisiones y tarifas cobradas, en la fecha en que ocurra la cancelación de la línea.

Las comisiones y tarifas distintas a las cobradas por el otorgamiento del crédito, se reconocerán contra los resultados de ejercicio en el rubro de comisiones y tarifas cobradas, en la fecha en que se devenguen. En el caso de que una parte o la totalidad de la contraprestación recibida por el cobro de la comisión o tarifa correspondiente se reciban anticipadamente al devengamiento del ingreso relativo, dicho anticipo deberá reconocerse como un pasivo.

Costos y gastos relacionados al otorgamiento inicial del crédito

Los costos y gastos relacionados con el otorgamiento del crédito se reconocen como un cargo diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses", durante el plazo promedio de la vida de los créditos, excepto para las que se originen por créditos revolventes, las cuales son amortizadas

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 16 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

en un periodo de 12 meses contra el rubro del gasto que le corresponda de acuerdo a su naturaleza.

Para efectos del párrafo anterior, se entenderán como costos o gastos asociados con el otorgamiento del crédito, únicamente a aquellos que sean incrementales y relacionados directamente con actividades realizadas por las entidades para otorgar el crédito, por ejemplo la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades.

Adquisición de cartera de crédito

En la fecha de adquisición de la cartera se deberá reconocer el valor contractual de la cartera adquirida en el rubro de cartera de crédito, conforme al tipo de cartera que el originador hubiere clasificado; la diferencia que se origine respecto del precio de adquisición se registrará como se muestran a continuación:.

a) cuando el precio de adquisición sea menor al valor contractual de la misma, en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", hasta por el importe de la estimación preventiva para riesgos crediticios que, en su caso, se constituya conforme a lo indicado en el párrafo siguiente y el excedente como un crédito diferido, el cual se amortizará conforme se realicen los cobros respectivos, de acuerdo a la proporción que estos representen del valor contractual del crédito;

b) cuando el precio de adquisición de la cartera sea mayor a su valor contractual, como un cargo diferido el cual se amortizará conforme se realicen los cobros respectivos, de acuerdo a la proporción que estos representen del valor contractual del crédito;

c) cuando provenga de la adquisición de créditos revolventes, se llevará dicha diferencia directamente a los resultados del ejercicio en la fecha de adquisición.

Criterios Contables Especiales (CCE), derivado de la contingencia sanitaria por COVID-19

Mediante oficios número P-285/2020 y 026/2020 de fecha 26 de marzo y 15 de abril de 2020, respectivamente, la Comisión Bancaria determinó emitir con carácter temporal, los CCE aplicables a los programas de apoyo otorgados por el Banco. Posteriormente, mediante oficio número P-325/2020 de fecha 23 de junio de 2020, la Comisión Bancaria indicó lo siguiente:

- Los CCE serán aplicados de manera general a los clientes que se hayan visto afectados y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo 2020.
- El plazo para realizar los trámites de reestructuración o renovación deberán concluir a más tardar el 31 de julio de 2020.

Los programas de apoyo consisten en otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 4 meses y con posibilidad de extenderlo a 2 meses adicionales, otorgando un periodo de gracia total hasta de 6 meses. Será de 18 meses tratándose de créditos otorgados a los sectores primarios agrícola, ganadero, forestal y pesquero; y a los sectores industrial, comercial y servicios que estén integrados los citados sectores primarios.

Lo anterior será aplicable a los siguientes tipos de crédito y para clientes que se

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 17 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

encuentren clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo de 2020:

- a. Créditos para la construcción de vivienda.
- b. Créditos individuales con garantía hipotecaria.
- c. Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).
- d. Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial.
- e. Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.
- f. Microcréditos individuales o grupales.

Para los CCE no se consideran como reestructuras y/o renovaciones y serán consideradas como cartera vigente los siguientes:

1. Créditos con "pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento", que sean reestructurados o renovados, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 79 del Criterio Contable B-6 "Cartera de Crédito" (el "Criterio Contable B-6") contenido en el Anexo 33 de la Circular única de Bancos, siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

2. Para créditos con "pagos periódicos de principal e intereses", que se reestructuren o renueven, podrán considerarse como vigentes al momento en que se lleve a cabo dicho acto, sin que sea aplicable lo que establecen los párrafos 82 y 84 del Criterio Contable B-6, siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

3. Los créditos que desde su inicio se estipule su carácter revolvente, que se reestructuren o renueven, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 80 y 81 del Criterio Contable B-6. Esto siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

En relación con los créditos citados en los numerales anteriores, estos no se considerarán como reestructurados conforme lo que establece el párrafo 40 del Criterio Contable B-6.

4. En caso de incluir quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, el Banco podrá diferir la constitución de Estimaciones Preventivas de Riesgos Crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una reserva por la diferencia en un período que no exceda el ejercicio de 2020.

Mediante oficio número 141-5/2263/2020 de fecha 2 de septiembre de 2020, la Comisión Bancaria extendió el plazo hasta el 30 de septiembre de 2020 para que el Banco pudiera aplicar los planes de reestructura o renovación para aquellos clientes ya inscritos en el programa de apoyo al 31 de julio de 2020, y que requieren dos meses adicionales de diferimiento para que de esta forma cuenten con los 6 meses de diferimiento al amparo de los CCE, establecidos en los oficios de fechas 26 de marzo, 15 de abril y 23 de junio de 2020.

(1) Estimación preventiva para riesgos crediticios-

Se mantiene una estimación para riesgos crediticios, la cual, a juicio de la

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 18 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

administración del Banco, es suficiente para cubrir cualquier pérdida que pudiera surgir tanto de los préstamos incluidos en su cartera de créditos, como otros riesgos crediticios de avales y compromisos irrevocables de conceder préstamos.

Cartera comercial - Las estimaciones para la cartera comercial se basan en la evaluación individual del riesgo crediticio de los acreditados y su clasificación, en apego a las "Disposiciones de carácter general aplicables a la metodología de calificación de la cartera crediticia de las instituciones de crédito" (las "Disposiciones"), establecidas por la Comisión Bancaria. La cartera crediticia estará sujeta a calificación, sin incluir aquellos créditos con garantía otorgada por Entidades de la Administración Pública Federal bajo control presupuestario directo, empresas productivas del Estado o aquellas señaladas en la fracción VI del artículo 112 de las Disposiciones, en los cuales el porcentaje de reserva será igual a 0.5%.

Las Disposiciones utilizan una metodología en la cual se clasifica a la cartera en diferentes grupos: en entidades federativas y municipios, proyectos de inversión con fuente de pago propia, fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, entidades financieras y personas morales y físicas con actividad empresarial no incluidas en los grupos anteriores, a su vez, este último grupo deberá dividirse en dos subgrupos: personas morales y físicas con actividad empresarial con ingresos o ventas netas anuales mayores a 14 millones de UDIS y menores a 14 millones de UDIS. Para efectos de la calificación de proyectos con fuente de pago propia establece que la calificación se calculará mediante al análisis del riesgo del proyecto de inversión de acuerdo a su etapa de construcción u operación y mediante el sobrecosto de obra y los flujos de efectivo del proyecto. Para los demás grupos se establece una metodología de pérdida esperada por riesgo de crédito, considerando la probabilidad de incumplimiento, severidad de la pérdida y exposición al incumplimiento.

Para la cartera de crédito con personas morales y físicas con actividad empresarial, con ingresos o ventas netas anuales iguales o mayores a 14 millones de UDIS, el Banco utiliza la metodología descrita en el Anexo 22 de las Disposiciones de la Comisión Bancaria.

La cartera de crédito con personas morales y físicas con actividad empresarial, con ingresos o ventas netas anuales menores a 14 millones de UDIS es calificada mediante la aplicación de la metodología descrita en el Anexo 21 de las Disposiciones, y para el caso de créditos con entidades financieras se utiliza la metodología descrita en el Anexo 20 de las mismas, en donde establece el concepto de probabilidad de incumplimiento, severidad de la pérdida y exposición al incumplimiento.

Las estimaciones realizadas al 31 de diciembre de 2021 y 2020 se determinaron conforme al grado de riesgo y los porcentajes de estimación preventiva siguientes:

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

A10.0000.90%
A20.9011.50%
B11.5012.00%
B22.0012.50%
B32.5015.00%
C15.00110.00%
C210.00115.50%
D15.50145.00%
EMayor a 45.00%

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 19 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Cartera hipotecaria incluyendo la originada y adquirida al INFONAVIT-

La reserva para créditos a la vivienda, se determina utilizando los saldos correspondientes al último día de cada mes. Asimismo, se consideran factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) días de atraso, vi) denominación del crédito e vii) integración del expediente. Adicionalmente, para los créditos adquiridos al INFONAVIT se consideran factores tales como: viii) ROA, ix) REA y x) prórroga. El monto total a constituir de cada crédito evaluado, es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento.

Para la determinación de la severidad de la pérdida es utilizado el componente de tasa de recuperación del crédito, la cual se ve afectada si el crédito cuenta con un fideicomiso de garantía o convenio judicial clasificando por regiones a las entidades federativas a las que pertenezcan dichos tribunales.

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2021 y 2020, se muestran a continuación:

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

A10.0000.50%
A20.5010.75%
B10.7511.00%
B21.0011.50%
B31.5012.00%
C12.0015.00%
C25.00110.00%
D10.00140.00%
E40.001100.00%

Cartera de consumo-

Para determinar la reserva de la cartera de consumo, ésta es separada en dos grupos: a) tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, y b) créditos no revolventes descritas en los Artículos 91 y 92 de las Disposiciones. Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, así como viii) antigüedad del acreditado en el Banco.

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a créditos no revolventes considera lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) días de atraso, (iv) plazo total, (v) plazo remanente, (vi) importe original del crédito, (vii) valor original del bien, (viii) el saldo del crédito y (ix) tipo de crédito.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 20 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2021 y 2020, se muestran a continuación:

Rango de porcentaje de estimación preventiva

Tarjeta de crédito

y otros créditos

Grado de riesgo No revolventes / revolventes

A10.002.0% / 0.003.00%

A22.013.0% / 3.015.00%

B13.014.0% / 5.016.50%

B24.015.0% / 6.518.00%

B35.016.0% / 8.0110.00%

C16.018.0% / 10.0115.00%

C28.0115.0% / 15.0135.00%

D15.0135.0% / 35.0175.00%

E35.01100.0% / Mayores a 75.01%

Cartera emproblemada - El Banco para propósitos de las revelaciones en los estados financieros consolidados, considera emproblemados aquellos créditos comerciales respecto de los cuales determina que existe una probabilidad considerable de que no se podrían recuperar en su totalidad, sin excluir las mejoras en los grados de riesgo derivadas de la parte del crédito cubierto por garantías, así como créditos que aún y cuando se encuentren vigentes provengan de una negociación en la cual se autorizó una condonación, quita o bonificación al final del plazo pactado, o son a cargo de personas a las cuales se les ha clasificado como clientela indeseable.

Reservas adicionales identificadas - Son establecidas para aquellos créditos que, en la opinión de la administración, podrían verse emproblemados en el futuro dada la situación del cliente, la industria o la economía. Además, incluye estimaciones para partidas como intereses ordinarios devengados no cobrados y otras partidas cuya realización se estima podrían resultar en una pérdida para el Banco, así como reservas mantenidas por regulación normativa.

Castigos- El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo a plazos establecidos (6 y 35 meses, respectivamente) que determinan la imposibilidad práctica de recuperación; los castigos cancelan el saldo del crédito contra la estimación preventiva previamente constituida. Cuando el crédito a castigar excede el saldo de su estimación asociada, antes de efectuar el castigo, dicha estimación se incrementa hasta por el monto de la diferencia. Cualquier recuperación derivada de los créditos previamente castigados, se reconoce en los resultados del ejercicio dentro del rubro de estimación preventiva para riesgos crediticios.

(m) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

Con base al párrafo 3 del criterio A-4 "Aplicación Supletoria a los Criterios de Contabilidad" emitido por la Comisión Bancaria, el Banco había adoptado la NIIF 15 "Ingresos provenientes de contratos con clientes" el cual incorpora el reconocimiento de ingresos derivados de programas de fidelización con clientes, y por lo tanto la IFRIC 13 "Programa de fidelidad de clientes" queda sin efecto. De acuerdo con la NIIF 15, una porción de los ingresos por cuota de intercambio se difiere en el momento en que se identifican las obligaciones de cumplir, es decir, de entregar los premios a los

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 21 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

que los clientes tienen derecho y se amortizan contra resultados una vez que se satisface dicha obligación de cumplir.

(n)Otras cuentas por cobrar-

Los derechos de cobro y las cuentas por cobrar relativas a deudores identificados cuyo vencimiento se pacte desde su origen a un plazo mayor a 90 días naturales, son evaluados por la Administración del Banco para determinar su valor de recuperación estimado, y en su caso constituir las reservas correspondientes. Los saldos de las demás partidas deudoras se reservan con cargo a los resultados del ejercicio a los 90 días siguientes a su registro inicial cuando correspondan a saldos identificados y a los 60 días si corresponden a saldos no identificados, independientemente de su posibilidad de recuperación, con excepción de los relativos a saldos por recuperar de impuestos e impuesto al valor agregado acreditable.

Tratándose de cuentas liquidadoras, en los casos en que el monto por cobrar no se realice a los 90 días naturales siguientes a partir de la fecha en que se haya registrado en cuentas liquidadoras, se registra como adeudo vencido y se constituye una estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro por el importe total del mismo.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes, que no cuenten con una línea de crédito para tales efectos, se clasificarán como adeudos vencidos y las instituciones deberán constituir simultáneamente a dicha clasificación una estimación por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

(o)Bienes adjudicados o recibidos como dación en pago-

Los bienes adquiridos mediante adjudicación judicial se registran en la fecha en que cause ejecutoria el auto aprobatorio del remate mediante el cual se decretó la adjudicación.

Los bienes recibidos en dación en pago se registran en la fecha en que se firmó la escritura de dación, o en la que se haya dado formalidad a la transmisión de la propiedad del bien.

El reconocimiento contable de un bien adjudicado considera el valor del bien (costo o valor razonable deducido de los costos y gastos estrictamente indispensables que se eroguen en su adjudicación, el que sea menor) así como el valor neto del activo que da origen a la adjudicación. Cuando el valor neto del activo que dio origen a la adjudicación es superior al valor del bien adjudicado, la pérdida se reconoce en los resultados del ejercicio, en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto"; en caso contrario, el valor del bien adjudicado se ajusta al valor neto del activo.

El valor del activo que dio origen a la misma y la estimación preventiva que se tenga constituida a esa fecha, se dan de baja del balance general consolidado.

Los bienes adjudicados prometidos en venta se reconocen como restringidos a valor en libros, los cobros que se reciben a cuenta del bien se registran como un pasivo; en la fecha de enajenación se reconoce en resultados la utilidad o pérdida generada dentro del rubro "Otros ingresos de la operación, neto".

Los bienes adjudicados se valúan de acuerdo al tipo de bien de que se trate, registrando dicha valuación (bajas de valor) contra resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El Banco constituye provisiones adicionales que reconocen los indicios de deterioro por las potenciales pérdidas de valor por el paso del tiempo en los bienes adjudicados, contra los resultados del ejercicio en el rubro

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

de "Otros ingresos de la operación, neto", las cuales se determinan multiplicando el porcentaje de reserva que corresponda por el valor de los bienes adjudicados, con base en las disposiciones por tenencia de bienes adjudicados o recibidos en dación de pago de la Comisión Bancaria, conforme se muestra a continuación:

Porcentaje de reserva
Bienes muebles,
Meses transcurridos a partir de laderechos de cobro e
adjudicación o dación en pagoBienes inmueblesinversiones en valores

Hasta 6 0%0%
Más de 6 y hasta 120%10%
Más de 12 y hasta 1810%20%
Más de 18 y hasta 2410%45%
Más de 24 y hasta 3015%60%
Más de 30 y hasta 3625%100%
Más de 36 y hasta 4230%100%
Más de 42 y hasta 4835%100%
Más de 48 y hasta 5440%100%
Más de 54 y hasta 6050%100%
Más de 60 100%100%

(p) Inmuebles, mobiliario y equipo-

Los inmuebles, mobiliario y equipo son registrados a su costo de adquisición. Los saldos que provienen de adquisiciones realizadas hasta el 31 de diciembre 2007, se actualizaron mediante factores derivados del valor de la UDI de su fecha de adquisición hasta esa fecha, que fue cuando se suspendió el reconocimiento de la inflación en la información financiera de acuerdo a las NIF. Los componentes adquiridos en moneda extranjera se registran al tipo de cambio histórico, es decir, a aquellos vigentes en la fecha de adquisición del bien.

La depreciación se calcula usando el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del Banco de los activos correspondientes.

El monto a depreciar de los inmuebles, mobiliario y equipo se determina después de deducir a su costo de adquisición su valor residual y, en su caso menos las pérdidas por deterioro acumuladas. El Banco evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichos inmuebles, mobiliario y equipo.

El Banco evalúa periódicamente los valores netos en libros de los inmuebles, mobiliario y equipo, para determinar la existencia de indicios de que dichos valores exceden su monto recuperable. El monto recuperable es aquel que resulte mayor entre el precio neto de venta y el valor de uso. Si se determina que los valores netos en libros exceden su monto recuperable, el Banco reconoce el deterioro con cargo a los resultados del ejercicio para reducirlos a este último monto. Los gastos de mantenimiento y reparaciones menores se registran en los resultados cuando se incurren.

(q) Activos de larga duración disponibles para su venta-

Los activos de larga duración se clasifican como disponibles para su venta si cumplen

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 23 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

todos los requisitos que se muestran a continuación:

- a) El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.
- b) Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.
- c) Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.
- d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que el Banco celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del periodo de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control del Banco y existen evidencias suficientes de que el Banco se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.
- e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.
- f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores, se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

(r) Inversiones permanentes-

Las inversiones permanentes en las que el Banco tiene influencia significativa o control se valúan utilizando el método de participación, a través del cual se reconoce la participación en los resultados y en el capital contable de estas entidades utilizando los estados financieros a la misma fecha y por el mismo periodo que el Banco. Se considera que una empresa es subsidiaria del Banco, cuando se tiene el poder de dirigir sus actividades relevantes, está expuesta o tiene derecho, a rendimientos variables procedentes de esa participación y tiene la capacidad presente de afectar esos rendimientos a través de su poder sobre ésta.

Las otras inversiones permanentes en donde no se tiene el control, control conjunto, ni influencia significativa son clasificadas como otras inversiones, las cuales se reconocen inicialmente y se mantienen valuadas a su costo de adquisición. En caso de que haya dividendos provenientes de dichas inversiones se reconocen en resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de periodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

(s) Otros activos-

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 24 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la administración del Banco.

Ante la presencia de algún indicio de deterioro del valor de un activo, se determina la posible pérdida por deterioro, y en caso de que el valor de recuperación sea menor al valor neto en libros se reduce el valor del activo y se reconoce la pérdida por deterioro en los resultados del ejercicio.

(t) Impuestos a la utilidad y Participación de los Trabajadores en la Utilidad (PTU)-

Los impuestos a la utilidad y PTU causados en el año se determinan conforme a las disposiciones fiscales y en su caso, laborales vigentes.

El impuesto causado se presenta dentro del balance general consolidado como un pasivo; cuando los anticipos realizados exceden el impuesto determinado del ejercicio, el exceso generado constituye una cuenta por cobrar.

Los impuestos a la utilidad y PTU diferidos se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas y por pérdidas fiscales por recuperar. Los activos y pasivos por impuestos a la utilidad y PTU diferidos se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas 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 impuesto a la utilidad y PTU diferidos se evalúan periódicamente creando, en su caso, reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos, incluyendo PTU diferida se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los "Otros Resultados Integrales" (ORI) o directamente en un rubro del capital contable.

La PTU causada y diferida se presenta dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción", en el estado consolidado de resultados.

(u) Arrendamientos capitalizables (actuando como arrendatario)-

Las operaciones de arrendamiento capitalizable se registran como un activo y una obligación correlativa por el equivalente al valor menor entre el valor presente de los pagos mínimos y el valor de mercado del activo arrendado. La diferencia entre el valor nominal de los pagos mínimos y la obligación mencionada anteriormente, se registra durante el periodo de arrendamiento en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El activo se deprecia de la misma manera que los otros activos que se tienen en propiedad cuando se tiene la certeza de que al término del contrato se transferirá la propiedad del activo arrendado, caso contrario se deprecia durante la duración del contrato.

(v) Captación tradicional-

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

público en general, los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses". Por aquellos títulos colocados a un precio diferente al valor nominal, la diferencia entre el valor nominal del título y el monto de efectivo recibido por el mismo, se reconoce como un cargo o crédito diferido y se amortiza bajo el método de línea recta contra resultados durante el plazo del título que le dio origen.

Los depósitos e inversiones y sus intereses de los instrumentos de captación que no tengan una fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven de forma automática, así como las transacciones o las inversiones vencidas y no reclamadas se registrarán en el rubro de "Cuenta global de captación sin movimientos". Los depósitos e inversiones y sus intereses sin movimiento en el transcurso de 3 años contados a partir de que estos últimos se depositen en la cuenta global, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública. El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto en este.

(w) Provisiones-

El Banco reconoce con base en estimaciones de la administración, provisiones por aquellas obligaciones presentes en las que es probable la transferencia de activos o la prestación de servicios y surge como consecuencia de eventos pasados.

(x) Préstamos interbancarios y de otros organismos-

En este rubro se registran los préstamos de exigibilidad inmediata, de corto plazo y de largo plazo de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento; asimismo, este rubro incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

(y) Beneficios a los empleados-

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que se devengan los servicios prestados, se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Banco en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida ver nota 17) y que se espera que el Banco pague después de los doce meses de la fecha del balance general más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que los empleados han obtenido a cambio de su servicio en el ejercicio actual y en los anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las remediones se reconocen en resultados en el período en que se devengan.

Beneficios por terminación

Se reconoce un pasivo por beneficios por terminación y un costo o gasto 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 descuenta.

Beneficios Post-Empleo

Plan de contribución definida

A partir del 1° de julio de 2021, fecha de la Fusión con SECOSA, 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. Hasta el 30 de junio de 2021, el Banco solo mantenía un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocían directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción". Las contribuciones pagadas por anticipado se reconocen como un activo en la medida en que el pago por anticipado de lugar a una reducción en los pagos a efectuar en el futuro o a un reembolso en efectivo.

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 certificados en pasivos laborales contingentes, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 27 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 generadas 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.

(z) Obligaciones subordinadas-

Las obligaciones subordinadas se reconocen a su valor contractual y los intereses se reconocen conforme se devengan en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Gastos por intereses".

(aa) Reconocimiento de ingresos-

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan. Los intereses sobre cartera de crédito vencida, se reconocen en resultados hasta el momento en que efectivamente se cobran.

Los cobros anticipados por concepto de intereses y las comisiones por originación del crédito se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas cobradas" respectivamente, conforme se devenguen o en el plazo del crédito, según aplique.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes, así como comisiones por servicios relacionados a operaciones derivadas se reconocen en los resultados cuando se proporciona el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

Las comisiones por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devenga el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas". En el momento en que el adeudo de dichas comisiones presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, se suspende la acumulación de dichos ingresos devengados y se lleva el control de éstos en cuentas de orden; en caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

Las comisiones por reestructuraciones o renovaciones de créditos se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses", bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito.

Los cobros anticipados por concepto de intereses y las comisiones por originación del crédito se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas cobradas" respectivamente, conforme se devenguen o en el plazo del crédito, según aplique.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes, así como comisiones por servicios relacionados a operaciones derivadas se reconocen en los resultados cuando se proporciona el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 28 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Las comisiones por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devenga el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas". En el momento en que el adeudo de dichas comisiones presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, se suspende la acumulación de dichos ingresos devengados y se lleva el control de éstos en cuentas de orden; en caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

(bb) Transacciones en moneda extranjera-

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio de cierre de jornada de operación determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el periodo en que se originan.

(ab) Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)-

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que es un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regular los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo.

De acuerdo a dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400 mil UDIS por persona, física o moral, y por institución bancaria. Las aportaciones al IPAB se reconocen en resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción".

(ac) Cuentas de orden-

Las cuentas de orden corresponden principalmente a los bienes en custodia o de administración y operaciones de fideicomisos.

Los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración, se reconocen en las cuentas de orden respectivas de acuerdo con los Criterios Contables establecidos por la Comisión Bancaria, representando así el monto máximo esperado por el que estaría obligado el Banco a responder ante sus clientes.

Los montos de los bienes en custodia o en administración se presentan en el rubro "Bienes en custodia o en administración", en tanto que las operaciones de fideicomiso se presentan en el rubro de "Bienes en fideicomiso o mandato".

(ae) Contingencias-

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos,

utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

(4) Cambios contables-

Utilización del tipo de cambio de cierre de jornada de operación para transacciones en moneda extranjera y operaciones extranjeras, en sustitución del tipo de cambio FIX.

El 15 de diciembre de 2021, fue publicada en el DOF la "Resolución que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito" de aplicación inmediata a su publicación, en el cual se establecen cambios en el criterio contable A-2 "Aplicación de normas particulares" del Anexo 33 "Criterios contables", referentes a la aplicación del tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central en su página de internet www.banxico.org.mx para la aplicación de la NIF B-15 "Conversión de monedas extranjeras".

Asimismo, se modifica el criterio contable B-4 "Estado de flujos de efectivo", que establece el uso del tipo de cambio de cierre de jornada a la fecha de cierre para la determinación de la utilidad o pérdida en cambios originadas por cambios en el tipo de cambio que no son flujos de efectivo, así como para la conversión de los flujos de efectivo de una operación extranjera y la conversión de saldos o flujos de efectivo en moneda extranjera.

La aplicación del tipo de cambio de cierre de jornada de operación no generó cambios contables importantes en los estados financieros consolidados.

Cambios en las Disposiciones de la Comisión Bancaria

Mediante publicación en Diario Oficial de fecha 4 de diciembre de 2020, la Comisión Bancaria dió a conocer la obligatoriedad a partir del 1 de enero de 2022, para la adopción de las siguientes Normas de información financiera (NIF) emitidas por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera (CINIF):

- B-5, Información financiera por segmentos
 - B-12, Compensación de activos y pasivos financieros
 - B-17, Determinación del valor razonable
 - C-2, Inversión en instrumentos financieros
 - C-3, Cuentas por cobrar
 - C-9, Provisiones, contingencias y compromisos
 - C-13, Partes relacionadas
 - C-14, Transferencia y baja de activos financieros
 - C-10, Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura
 - C-16, Deterioro de instrumentos financieros por cobrar
 - C-19, Instrumentos financieros por pagar
 - C-20, Instrumentos financieros para cobrar principal e interés
 - D-1, Ingresos por contratos con clientes
 - D-2, Costos por contratos con clientes y
 - D-5, Arrendamientos
-

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 30 / 88
CONSOLIDADO
Impresión Final

La Administración reconoció el efecto inicial por la entrada en vigor de esta norma, el cual considera inmaterial para efectos de los estados financieros consolidados en su conjunto.

Entre otros cambios relevantes y que entraron en vigor el 1 de enero de 2022 fueron a los Criterios Contables del Anexo 33 de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito:

- Criterio Contable B-1 Efectivo y equivalentes de efectivo (antes Disponibilidades).
- Criterio Contable B-3 Reportos
- Criterio Contable B-6 Cartera de Crédito
- Criterio Contable B-7 Bienes adjudicados
- Se derogan los criterios contables B-2 Inversiones en valores, B-5 Derivados y operaciones de cobertura, B-11 Derechos de cobro, C-1 Reconocimiento y baja de activos financieros, C-3 Partes relacionadas y C-4 Información por segmentos.

De acuerdo a los artículos transitorios mencionados en las Disposiciones, y como una solución práctica, las instituciones de crédito en la aplicación de los criterios de contabilidad contenidos en el Anexo 33 que se modifican, podrán reconocer en la fecha de aplicación inicial, es decir, el 1 de enero de 2022, el efecto acumulado de los cambios contables.

Asimismo, los estados financieros básicos (consolidados) trimestrales y anuales que sean requeridos a las instituciones, de conformidad con las Disposiciones correspondientes al periodo concluido el 31 de diciembre de 2022, no deberán presentarse comparativos con cada trimestre del ejercicio 2021 y por el año terminado el 31 de diciembre de 2021.

ANEXO 1

Anexo - Desglose de créditos	Moneda nacional [miembro]	Moneda nacional [miembro]	Moneda nacional [miembro]	Moneda extranjera [miembro]	Moneda extranjera [miembro]	Moneda extranjera [miembro]	Moneda extranjera [miembro]	Moneda extranjera [miembro]	Moneda extranjera [miembro]
Acumulado Actual									
Institución Extranjera (Si/No)	Fecha de firma/contrato	Fecha de vencimiento	Tasa de interés y/o sobretasa	Denominación [eje]					
Moneda nacional [miembro]	Moneda extranjera [miembro]								
Intervalo de tiempo [eje]	Intervalo de tiempo [eje]								
Tipo de Crédito / Institución	Año actual [miembro]	Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]	Año actual [miembro]	Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]
	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]				Hasta 1 año [miembro]	Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]
	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]					Hasta 2 años [miembro]	Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]
	Hasta 5 años o más [miembro]						Hasta 3 años [miembro]	Hasta 4 años [miembro]	Hasta 5 años o más [miembro]
Desglose de créditos [partidas]									
Bancarios [sinopsis]									
BANCO DE MEXICO	No	05/02/2021	26/01/2023	4.82	Variable	MXN TOB CMP	1,161,856,666.67		
BANCO DE MEXICO	No	17/02/2022	18/08/2022	6.54	Tasa Fija		101,669,824.33		
TOTAL		101,669,824.33	1,161,856,666.67	-	-	-	-	-	-
Con garantía (bancarios)									

TOTAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Banca comercial									
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit)	(SCTL)	Si	22/11/2021	23/05/2022	0.25938				
Tasa Fija			2,986,459,636.53						
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit)	(SCTL)	Si	21/12/2021	21/06/2022	0.35663				

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 31 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Fija 1,991,100,194.62
Export Development Canada (EDC) Si08/07/202006/08/20230.36657 + 0.66 Spred / USD LIBOR
6M 1,993,704,411.47

TOTAL - - - - - 4,977,559,831.15 1,993,704,411.47 - - -

Otros bancarios

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/07/201830/07/20226.7265 + 0.4 Spred / MXN TIIE 28D EOM
1,500,296,937.50

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo19/03/202003/03/20236.2912 +
0.14 Spred / MXN TIIE 28D EOM 2,502,233,055.56

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo19/03/202002/02/20236.2912 +
0.14 Spred / MXN TIIE 28D EOM 2,502,233,055.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202020/02/20246.7265 + 0.43 Spred / MXN TIIE 28D EOM
2,500,496,979.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202020/03/20246.7265 + 0.43 Spred / MXN TIIE 28D EOM
2,500,496,979.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/11/20246.7265 + 0.35 Spred / MXN TIIE 28D EOM
2,500,491,423.61

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/09/20246.7265 + 0.35 Spred / MXN TIIE 28D EOM
2,500,491,423.61

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/201925/07/20246.7265 + 0.35 Spred / MXN TIIE 28D EOM
2,500,491,423.61

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo14/12/201702/12/20278.48 Tasa
fija 1,026,617,777.78

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo23/04/201814/04/20258.41 Tasa
fija 1,038,545,833.33

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo29/08/201823/08/20238.89 Tasa
fija 1,513,705,416.67

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/01/202228/04/20226.8265
Tasa Fija 1,005,643.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/201828/12/20235.814 Tasa
Fija 16,010,335.93

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201817/02/20235.8 Tasa
Fija 24,844,299.89

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201817/02/20235.8 Tasa
Fija 10,834,093.62

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/11/202118/11/20226.36 Tasa
Fija 10,024,733.32

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/10/202106/04/20226.3315
Tasa Fija 2,510,986.48

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202105/07/20245.33 Tasa
Fija 8,671,261.71

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/10/202106/04/20226.3315
Tasa Fija 2,510,986.48

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202106/04/20226.3315
Tasa Fija 2,510,987.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202103/11/20226.341 Tasa
Fija 2,010,176.90

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202105/07/20226.3315
Tasa Fija 3,013,184.67

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202120/09/20226.3625
Tasa Fija 3,005,302.06

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202106/04/20226.3315
Tasa Fija 2,510,986.84

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 32 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202026/03/20256.76 Tasa Fija 4,140,153.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/01/202105/01/20246.3315 Tasa Fija 3,069,977.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202029/11/20226.8265 Tasa Fija 1,000,633.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/11/20226.8265 Tasa Fija 926,512.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202015/11/20236.3425 Tasa Fija 1,523,606.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/04/202128/04/20266.8175 Tasa Fija 2,196,119.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa Fija 229,257.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa Fija 1,774,693.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202109/09/20266.33 Tasa Fija 142,525,651.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202126/05/20266.8175 Tasa Fija 9,159,860.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/01/202126/01/20246.8175 Tasa Fija 9,176,816.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202130/04/20245.87 Tasa Fija 163,417,582.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202021/08/20235.69 Tasa Fija 4,258,376.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202029/09/20235.78 Tasa Fija 2,164,061.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202029/09/20235.78 Tasa Fija 7,988,867.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202029/09/20235.59 Tasa Fija 9,420,267.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/201830/11/20228.09 Tasa Fija 284,494.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202128/02/20256.665 Tasa Fija 3,018,976.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.8175 Tasa Fija 12,153,082.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/201930/09/20236.8265 Tasa Fija 6,658,486.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202107/04/20256.3315 Tasa Fija 14,768,984.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/201715/03/20226.3256 Tasa Fija 2,359.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/07/201911/07/20226.3375 Tasa Fija 1,852,603.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/201826/06/20236.8175 Tasa Fija 366,751.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/201720/05/20226.3625 Tasa Fija 52,122.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202021/04/20236.3315 Tasa Fija 4,689,001.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202014/03/20236.3375 Tasa Fija 2,724,301.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202014/03/20236.3375 Tasa Fija 302,799.32

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 33 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202008/01/20246.33 Tasa Fija 3,515,576.19

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/201730/11/20228.07 Tasa Fija 101,303.86

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201817/10/20236.8265 Tasa Fija 11,461,279.96

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/201926/06/20236.8175 Tasa Fija 535,900.73

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/201826/06/20236.8175 Tasa Fija 674,633.90

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/201817/08/20236.4875 Tasa Fija 1,209,783.15

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202106/04/20226.3315 Tasa Fija 2,510,992.19

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202106/04/20226.3315 Tasa Fija 2,510,992.19

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/12/202106/04/20226.3315 Tasa Fija 2,511,010.53

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202105/04/20226.8265 Tasa Fija 1,000,189.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202106/04/20226.8265 Tasa Fija 1,000,189.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202106/04/20226.3315 Tasa Fija 2,510,992.19

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202108/04/20226.8265 Tasa Fija 1,000,189.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202113/12/20226.3375 Tasa Fija 10,031,687.50

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202112/04/20226.8265 Tasa Fija 1,000,189.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202113/04/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202119/04/20226.8265 Tasa Fija 1,000,189.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/202120/04/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202121/04/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202126/04/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202203/05/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202205/05/20226.3315 Tasa Fija 1,004,396.88

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202204/05/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202126/04/20227.651 Tasa Fija 28,755.35

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202109/06/20227.6706 Tasa Fija 512,882.57

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202106/04/20226.7 Tasa Fija 118,433.43

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/12/202129/04/20226.8237 Tasa Fija 1,000,568.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202106/04/20226.3315 Tasa Fija 5,021,984.40

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202104/04/20226.7 Tasa Fija 973.04

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202006/09/20246.3315 Tasa Fija 564,171.94

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 34 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202102/06/20227.6898 Tasa Fija 4,071,707.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202108/04/20227.6642 Tasa Fija 33,676.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202111/04/20226.716 Tasa Fija 1,689,668.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202102/06/20227.6898 Tasa Fija 3,656,139.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202106/04/20226.716 Tasa Fija 56,458.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202103/05/20227.651 Tasa Fija 50,290.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/11/202119/05/20226.3625 Tasa Fija 15,026,510.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202125/04/20227.5069 Tasa Fija 60,307.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202108/04/20226.716 Tasa Fija 652,852.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202129/06/20227.9977 Tasa Fija 102,745.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202030/05/20235.38 Tasa Fija 2,618,574.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202128/04/20227.651 Tasa Fija 298,386.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202030/05/20235.38 Tasa Fija 3,428,828.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/202121/06/20226.3625 Tasa Fija 5,509,720.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202104/04/20226.7 Tasa Fija 2,503.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202103/06/20227.9977 Tasa Fija 110,692.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202129/04/20227.651 Tasa Fija 931,407.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202106/05/20227.6642 Tasa Fija 760,213.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202102/06/20226.3395 Tasa Fija 5,026,414.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202129/04/20227.105 Tasa Fija 368,100.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/202122/04/20226.3625 Tasa Fija 5,008,836.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202123/06/20227.9977 Tasa Fija 155,502.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202007/05/20256.3315 Tasa Fija 4,770,885.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202125/04/20227.105 Tasa Fija 42,154.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202109/05/20226.8265 Tasa Fija 7,501,422.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/202122/04/20226.3625 Tasa Fija 20,035,347.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202114/09/20267.17 Tasa Fija 6,525,257.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202113/04/20226.3375 Tasa Fija 1,755,545.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201830/01/20230.91943 Tasa Fija 16,103,145.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201830/01/20230.91943 Tasa Fija 24,154,708.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202112/04/20226.3375 Tasa Fija 5,015,843.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/02/201830/01/20230.95943 Tasa Fija 56,361,123.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/202114/06/20226.3375 Tasa Fija 40,126,750.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54 Tasa Fija 16,673,154.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/07/202109/07/20267.04 Tasa Fija 4,245,839.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/202125/04/20226.3912 Tasa Fija 1,504,721.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202106/04/20226.8265

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 35 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Fija 20,003,792.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202107/04/20226.3375
Tasa Fija 351,109.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/11/202103/06/20226.341 Tasa
Fija 2,010,216.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202103/06/20220.38457
Tasa Fija 23,876,715.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/11/202110/05/20220.44114
Tasa Fija 39,792,924.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202025/09/20246.3912
Tasa Fija 2,157,878.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202125/09/20246.3912
Tasa Fija 3,918,318.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/06/201728/06/20227.64 Tasa
Fija 1,251,060.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202112/04/20226.3375
Tasa Fija 20,063,374.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202105/04/20226.3315
Tasa Fija 20,087,937.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202102/06/20227.6898 Tasa Fija 217,715.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201809/02/20236.33 Tasa
Fija 1,299,370.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202104/05/20236.8265
Tasa Fija 10,001,896.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/202115/06/20220.56657
Tasa Fija 59,689,272.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/202115/06/20226.3425
Tasa Fija 3,209,584.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202112/04/20226.3375
Tasa Fija 10,031,687.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202117/05/20226.3523
Tasa Fija 1,913,050.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202107/06/20227.6898 Tasa Fija 33,643.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202115/05/20256.3425
Tasa Fija 756,718.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/11/201731/10/20226.8265
Tasa Fija 3,713,854.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202107/07/20236.8265
Tasa Fija 11,002,085.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202107/06/20227.6898 Tasa Fija 19,529.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202113/04/20226.3375
Tasa Fija 1,755,545.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202106/04/20226.3315
Tasa Fija 12,554,960.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa
Fija 13,864,466.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/11/202104/05/20226.3362
Tasa Fija 5,024,640.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/11/202104/05/20226.3362
Tasa Fija 5,024,640.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/11/202104/05/20226.3362
Tasa Fija 5,024,640.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202103/06/20226.341 Tasa
Fija 5,025,540.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202114/09/20266.57 Tasa
Fija 12,357,260.70

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 36 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202103/06/20226.341 Tasa Fija 5,020,514.62

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/11/202129/07/20226.515 Tasa Fija 980,646.40

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202103/06/20226.341 Tasa Fija 5,025,540.17

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/11/202129/07/20226.515 Tasa Fija 2,222,798.41

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202103/06/20226.341 Tasa Fija 5,025,540.17

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202113/04/20226.3375 Tasa Fija 20,063,375.03

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/11/202129/07/20226.515 Tasa Fija 3,265,803.76

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/202113/04/20226.8265 Tasa Fija 5,000,948.14

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202104/04/20227.1387 Tasa Fija 315,915.40

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/04/201928/04/20236.8237 Tasa Fija 3,061,886.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202224/06/20228.0085 Tasa Fija 194,580.55

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202126/04/20227.5296 Tasa Fija 382,646.68

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202129/06/20266.8265 Tasa Fija 115,643,841.30

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202108/04/20226.33 Tasa Fija 2,510,550.00

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202107/04/20226.3315 Tasa Fija 12,554,960.93

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202225/04/20227.105 Tasa Fija 34,490.85

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202111/07/20226.3375 Tasa Fija 903,327.19

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202105/04/20227.4855 Tasa Fija 6,178.07

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202117/05/20227.4855 Tasa Fija 449,907.15

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201927/09/20246.8265 Tasa Fija 6,001,137.72

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202115/07/20266.3425 Tasa Fija 278,990,851.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202103/05/20227.5777 Tasa Fija 17,523.27

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202106/09/20246.3315 Tasa Fija 868,784.04

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202105/04/20227.1387 Tasa Fija 67,934.23

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202103/05/20227.5777 Tasa Fija 13,822.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202105/04/20227.1387 Tasa Fija 31,778.35

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202118/02/20266.36 Tasa Fija 45,545,705.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202105/04/20226.6675 Tasa Fija 205,870.36

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202205/04/20227.105 Tasa Fija 158,505.79

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202105/04/20227.1387 Tasa Fija 12,223.10

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202122/04/20227.4627 Tasa Fija 90,473.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202120/05/20227.4855 Tasa Fija 135,465.81

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202119/05/20227.4855 Tasa Fija 70,700.72

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202101/04/20227.5777 Tasa Fija 184,116.46

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202120/05/20226.3625 Tasa Fija 15,026,510.35

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202113/05/20227.5296 Tasa Fija 152,526.64

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202108/04/20226.33 Tasa Fija 20,084,400.00

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 37 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202117/05/20227.4855 Tasa Fija 217,032.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/01/202230/06/20226.8265
Tasa Fija 8,003,034.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202112/04/20227.4855 Tasa Fija 28,547.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202113/05/20226.3375
Tasa Fija 391,235.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202109/09/20226.8265
Tasa Fija 18,753,555.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202111/04/20227.0835 Tasa Fija 766,572.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202119/04/20227.4044 Tasa Fija 229,504.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202111/04/20227.0835 Tasa Fija 422.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202105/05/20227.4044 Tasa Fija 234,572.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202119/04/20227.4627 Tasa Fija 87,133.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202120/05/20226.3625
Tasa Fija 3,726,574.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202110/05/20227.7871 Tasa Fija 160,155.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202122/09/20226.3625
Tasa Fija 5,008,836.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202105/09/20256.3425
Tasa Fija 936,567.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202113/04/20227.1025 Tasa Fija 26,702.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201928/06/20246.8265
Tasa Fija 2,858,970.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202118/04/20227.1025 Tasa Fija 614,655.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/10/201930/09/20226.8265
Tasa Fija 3,333,965.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202120/04/20227.1025 Tasa Fija 145,308.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202026/11/20246.8175
Tasa Fija 2,212,583.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/10/202113/04/20226.3375
Tasa Fija 5,015,843.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/11/201815/11/20226.3425
Tasa Fija 84,426.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202127/05/20226.8175
Tasa Fija 5,003,787.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/02/202125/02/20266.3912
Tasa Fija 78,430,680.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202121/06/20227.9315 Tasa Fija 207,733.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202127/05/20226.8175
Tasa Fija 4,998,783.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/10/202118/04/20226.36 Tasa
Fija 1,754,328.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202121/06/20227.9315 Tasa Fija 5,435,479.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202111/04/20227.0835 Tasa Fija 1,538,846.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202116/06/20227.9315 Tasa Fija 27,767.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202113/05/20226.3375
Tasa Fija 10,031,687.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202108/07/20226.8265
Tasa Fija 18,753,555.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202120/05/20266.3625
Tasa Fija 250,441,840.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202027/03/20255.66 Tasa
Fija 4,059,221.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202104/04/20221.68825 Tasa Fija 8,175.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202126/05/20227.6369 Tasa Fija 145,120.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202113/04/20227.1025 Tasa Fija 162,167.54

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 38 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202106/04/20227.1402 Tasa Fija	164,813.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/10/202118/04/20227.3934 Tasa Fija	248,737.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202121/06/20227.9315 Tasa Fija	54,077.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/10/202118/04/20226.36 Tasa Fija	1,754,328.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202118/04/20227.1025 Tasa Fija	150,167.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202129/07/20227.0265 Tasa Fija	2,587,504.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202109/06/20227.7871 Tasa Fija	322,797.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202104/04/20227.1402 Tasa Fija	276,375.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202129/07/20227.0265 Tasa Fija	1,586,309.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202108/04/20227.1402 Tasa Fija	820,653.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202108/04/20227.0835 Tasa Fija	267,845.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202126/04/20227.4044 Tasa Fija	56,870.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202113/05/20226.3375 Tasa Fija	30,095,062.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/10/202105/04/20227.1402 Tasa Fija	38,338.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202118/07/20226.36 Tasa Fija	902,226.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202104/04/20226.7 Tasa Fija	955,276.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202104/04/20226.7 Tasa Fija	702,275.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202103/06/20226.341 Tasa Fija	5,025,540.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202021/03/20236.3625 Tasa Fija	15,676,917.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202021/03/20236.3625 Tasa Fija	1,563,192.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202123/05/20227.6687 Tasa Fija	87,193.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/202106/05/20226.3315 Tasa Fija	2,008,793.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202101/04/20226.7 Tasa Fija	725,824.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202117/06/20226.3523 Tasa Fija	7,001,235.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202104/04/20226.7 Tasa Fija	641,837.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202107/06/20227.6687 Tasa Fija	231,858.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/20266.8265 Tasa Fija	12,754,835.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/20266.8265 Tasa Fija	8,503,223.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202104/04/20226.7 Tasa Fija	1,379,388.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/20266.8265 Tasa Fija	8,503,223.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202108/04/20226.33 Tasa Fija	13,054,860.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202118/04/20227.1025 Tasa Fija	17,075.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/20266.8265 Tasa Fija	69,243,897.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202121/06/20227.9315 Tasa Fija	77,124.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/201917/10/20246.3523 Tasa Fija	6,843,504.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/08/201729/07/20227.45 Tasa Fija	155,438.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202116/06/20227.9315 Tasa Fija	396,042.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202111/04/20227.1025 Tasa Fija	340.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202120/04/20227.1025 Tasa Fija	4,351.05

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 39 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202119/04/20226.8265	
Tasa Fija 5,000,948.14	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/11/202106/05/20226.3315	
Tasa Fija 5,021,984.40	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/11/202106/05/20226.3315	
Tasa Fija 5,021,984.40	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/11/202106/05/20226.3315	
Tasa Fija 4,879,360.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/10/202108/04/20226.33	Tasa
Fija 12,552,750.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/11/202106/05/20226.3315	
Tasa Fija 20,087,937.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/10/202106/05/20226.3315	
Tasa Fija 2,547,840.28	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/10/202107/04/20226.3315	
Tasa Fija 2,498,939.42	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/10/202030/10/20256.8265	
Tasa Fija 79,792,154.49	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/10/202110/05/20226.335	Tasa
Fija 2,546,507.30	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202108/04/20226.7	Tasa Fija 490,035.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202225/04/20227.1075	Tasa Fija 797,540.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202110/05/20227.6687	Tasa Fija 142,191.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202218/04/20227.1075	Tasa Fija 350,223.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202225/04/20227.1075	Tasa Fija 728,135.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202128/04/20227.5418	Tasa Fija 177,008.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202206/04/20227.1075	Tasa Fija 488,769.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202121/04/20227.5618	Tasa Fija 87,532.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202225/04/20227.1075	Tasa Fija 1,951,001.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202206/04/20227.1075	Tasa Fija 149,360.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202118/04/20227.3953	Tasa Fija 400,290.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202118/04/20227.1025	Tasa Fija 194,291.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202126/04/20227.5727	Tasa Fija 62,186.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202220/04/20227.1075	Tasa Fija 438,079.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/12/202118/04/20227.1025	Tasa Fija 1,726.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202127/04/20226.8175	
Tasa Fija 13,317,080.04	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202122/04/20227.5727	Tasa Fija 284,780.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202108/04/20227.1402	Tasa Fija 104,099.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202104/04/20226.7	Tasa Fija 1,536,488.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202103/05/20227.5727	Tasa Fija 45,209.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/10/202126/04/20227.5215	Tasa Fija 307,532.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/08/202105/08/20226.8265	
Tasa Fija 18,753,555.51	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202222/04/20227.1075	Tasa Fija 96,421.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/10/202121/04/20227.5215	Tasa Fija 2,631,562.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/05/202130/04/20266.28	Tasa
Fija 8,952,751.98	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202108/04/20227.5418	Tasa Fija 365,667.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202211/04/20227.1075	Tasa Fija 222,980.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202121/06/20227.942	Tasa Fija 16,060.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/11/201830/11/20236.8265	
Tasa Fija 50,609,595.15	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202218/04/20227.1075	Tasa Fija 1,690,180.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/01/202201/07/20226.3367	
Tasa Fija 15,081,849.03	

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN FINANCIERA

PAGINA 40 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/10/202126/04/20227.5215 Tasa Fija	27,293.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202108/04/20227.1402 Tasa Fija	350,736.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/10/202121/04/20227.5215 Tasa Fija	4,033,257.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/10/202126/04/20227.5215 Tasa Fija	1,801.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202117/06/20226.3523	
Tasa Fija	3,509,263.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202117/06/20226.3523	
Tasa Fija	3,007,940.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202131/05/20227.942 Tasa Fija	212,153.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/10/202118/04/20226.36 Tasa	
Fija	5,012,366.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202113/04/20227.104 Tasa Fija	45,111.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202129/06/20226.8237	
Tasa Fija	300,170.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/10/202111/04/20226.8265	
Tasa Fija	11,002,085.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/10/202119/04/20226.3625	
Tasa Fija	1,753,092.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202118/04/20227.104 Tasa Fija	1,435,675.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202004/11/20256.3362	
Tasa Fija	66,064,664.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202127/04/20226.8265	
Tasa Fija	11,502,180.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa	
Fija	14,494,017.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202103/06/20226.341 Tasa	
Fija	80,408,642.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa	
Fija	38,948,324.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/07/202115/07/20256.3425	
Tasa Fija	3,343,316.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202126/04/20227.4138 Tasa Fija	11,496.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa	
Fija	1,577,920.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202124/06/20226.3825	
Tasa Fija	2,002,836.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202116/05/20227.4138 Tasa Fija	201,839.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/10/202119/04/20226.3625	
Tasa Fija	1,753,092.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa	
Fija	2,432,719.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/10/202125/04/20227.5215 Tasa Fija	45,246.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202116/05/20226.3487	
Tasa Fija	2,807,900.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202110/05/20227.8895 Tasa Fija	176,551.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/10/202126/04/20227.5215 Tasa Fija	302,369.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija	395,857.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/10/202107/04/20227.5215 Tasa Fija	10,676.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202115/06/20226.3425	
Tasa Fija	451,347.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202126/04/20226.8175	
Tasa Fija	20,015,150.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202101/04/20226.6885 Tasa Fija	330,072.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202113/04/20227.1 Tasa Fija	125,533.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202112/04/20227.1441 Tasa Fija	7,771.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202102/09/20266.3395	

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 41 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Fija 16,285,583.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 510,787.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202112/04/20227.1441 Tasa Fija 30,864.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202131/05/20227.6435 Tasa Fija 7,036.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202122/04/20227.104 Tasa Fija 345,384.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202116/06/20227.942 Tasa Fija 520,959.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/01/202204/05/20226.3362
Tasa Fija 1,004,928.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202130/05/20226.8265
Tasa Fija 3,501,327.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/01/202201/04/20225.9575
Tasa Fija 1,498,070.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/201823/05/20236.8265
Tasa Fija 26,046,620.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202123/05/20226.375 Tasa
Fija 5,007,968.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202130/05/20226.8265
Tasa Fija 5,502,085.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/10/202111/04/20226.3375
Tasa Fija 20,073,937.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 951,225.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 995,967.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 972,967.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/10/202127/04/20227.5215 Tasa Fija 217,679.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 1,651,469.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202129/07/20226.515 Tasa
Fija 2,021,639.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202101/04/20226.6885 Tasa Fija 16,291.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 1,119,555.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/10/202119/04/20227.399 Tasa Fija 373,446.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202105/04/20226.6885 Tasa Fija 142,178.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202113/04/20227.6435 Tasa Fija 5,004.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/201824/05/20236.3825
Tasa Fija 3,320,492.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 266,157.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/201913/10/20236.3425
Tasa Fija 541,136.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 633,313.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/10/202113/04/20227.399 Tasa Fija 3,378,819.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 1,297,512.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 807,457.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 516,514.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202110/05/20227.6435 Tasa Fija 76,272.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 327,844.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/10/202119/04/20227.399 Tasa Fija 9,482.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/10/202119/04/20227.399 Tasa Fija 141,841.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/10/202119/04/20227.399 Tasa Fija 2,243.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202131/05/20227.6435 Tasa Fija 203,445.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202124/06/20227.942 Tasa Fija 9,275,571.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 80,574.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202105/04/20227.1045 Tasa Fija 11,597.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202120/04/20227.1045 Tasa Fija 45,659.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202122/04/20227.1045 Tasa Fija 1,609,867.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202104/04/20226.7 Tasa Fija 448,691.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 1,465,159.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202126/04/20227.5418 Tasa Fija 311,014.87

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 42 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 550,771.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/01/202201/07/20226.3367
Tasa Fija 17,092,762.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 1,574,336.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202123/05/20226.375 Tasa
Fija 20,031,875.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202107/04/20227.5855 Tasa Fija 333,160.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 1,192,866.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 456,110.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 91,410.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/03/202107/02/20286.33 Tasa
Fija 145,752,189.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/11/202119/11/20257.8265
Tasa Fija 102,044,350.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/10/202119/04/20226.3625
Tasa Fija 5,008,836.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 1,389,670.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 489,979.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 1,815,981.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 883,813.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/10/202120/04/20227.399 Tasa Fija 35,758.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 2,118,798.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202117/06/20227.8895 Tasa Fija 287,196.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/10/202119/04/20227.399 Tasa Fija 1,219.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/12/202107/04/20226.3315
Tasa Fija 401,758.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/12/202106/06/20226.3315
Tasa Fija 7,030,778.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/03/202107/02/20286.33 Tasa
Fija 55,713,302.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202218/04/20221.73875 Tasa Fija 792,257.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202127/04/20226.8175
Tasa Fija 57,754,716.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202129/10/20267.39 Tasa
Fija 50,010,263.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202225/04/20227.1067 Tasa Fija 61,913.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/10/202112/04/20226.3375
Tasa Fija 1,504,753.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202129/10/20267.39 Tasa
Fija 50,010,263.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202119/05/20227.6164 Tasa Fija 157,219.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/10/202112/04/20226.3375
Tasa Fija 1,329,198.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202110/05/20227.4073 Tasa Fija 252,403.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202109/05/20227.5855 Tasa Fija 43,561.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 111,748.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/12/202131/05/20226.8265
Tasa Fija 15,002,844.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202126/04/20227.6164 Tasa Fija 7,235.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/12/202131/05/20226.8265
Tasa Fija 5,000,948.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202104/04/20226.7 Tasa Fija 60,404.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202122/04/20227.6164 Tasa Fija 145,627.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202110/05/20227.4073 Tasa Fija 20,901.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/12/202131/05/20226.8265
Tasa Fija 3,500,663.72

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 43 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/09/202101/04/20226.3367
Tasa Fija 1,806,796.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/12/202131/05/20226.8265
Tasa Fija 5,000,948.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202107/04/20227.1045 Tasa Fija 744,569.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202118/04/20227.1045 Tasa Fija 53,675.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/12/202131/05/20226.8265
Tasa Fija 5,000,948.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202126/04/20227.625 Tasa Fija 5,093.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202218/04/20227.1067 Tasa Fija 166,937.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/11/202024/11/20256.8175
Tasa Fija 160,538,182.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202104/04/20226.7 Tasa Fija 73,609.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/03/202030/11/20226.515 Tasa
Fija 1,140,599.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202119/04/20227.625 Tasa Fija 138,195.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202116/05/20227.4073 Tasa Fija 707,879.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/12/201829/09/20236.8265
Tasa Fija 5,385,636.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/04/202031/10/20225.9798
Tasa Fija 128,378.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/12/201809/02/20236.33 Tasa
Fija 1,310,611.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/11/202024/11/20256.8175
Tasa Fija 6,254,734.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202103/05/20227.6164 Tasa Fija 182,099.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/11/202024/11/20256.8175
Tasa Fija 125,094,687.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/05/202031/05/20236.8265
Tasa Fija 190,236.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202129/04/20227.5855 Tasa Fija 693,807.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202101/04/20226.686 Tasa Fija 1,454,065.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/03/202028/02/20236.515 Tasa
Fija 209,683.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/10/202112/04/20227.1578 Tasa Fija 39,951.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/11/202129/04/20226.8237
Tasa Fija 13,352,588.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/04/202029/02/20246.8265
Tasa Fija 488,503.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/11/202129/07/20266.8237
Tasa Fija 16,430,390.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202106/06/20227.6529 Tasa Fija 467,757.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/03/202030/12/20227.0265
Tasa Fija 143,341.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202130/04/20266.28 Tasa
Fija 8,431,232.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202106/05/20227.5855 Tasa Fija 439,525.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202126/04/20227.625 Tasa Fija 54,422.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/12/202108/04/20226.8175
Tasa Fija 200,151.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/04/202031/01/20235.9798
Tasa Fija 130,229.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/03/202029/12/20237.0265
Tasa Fija 209,495.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/11/202126/04/20227.625 Tasa Fija 95,269.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/12/202129/04/20227.6107 Tasa Fija 280,374.09

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 44 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/11/202015/11/20246.3425
Tasa Fija 668,663.34

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202204/07/20226.3362
Tasa Fija 5,024,640.77

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202113/06/20226.3375
Tasa Fija 20,063,375.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/12/202126/05/20227.6107 Tasa Fija 3,412,510.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/12/202131/05/20227.6107 Tasa Fija 862,670.55

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/11/202129/04/20226.8237
Tasa Fija 4,352,473.64

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202030/06/20236.8265
Tasa Fija 24,547,002.28

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/20246.515 Tasa
Fija 648,590.97

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202119/04/20227.6164 Tasa Fija 129,032.71

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202208/04/20226.3315
Tasa Fija 351,538.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202028/02/20236.515 Tasa
Fija 292,958.44

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202030/06/20236.8265
Tasa Fija 13,704,521.30

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/20246.515 Tasa
Fija 926,504.33

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/09/20237.0265
Tasa Fija 1,455,113.29

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/10/202107/04/20227.1578 Tasa Fija 1,728,781.72

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202225/04/20227.1067 Tasa Fija 6,613.87

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202113/07/20226.3375
Tasa Fija 902,851.88

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201928/06/20246.8265
Tasa Fija 29,858,602.13

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/11/202129/04/20226.8265
Tasa Fija 18,394,487.41

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202204/07/20226.3362
Tasa Fija 5,024,640.77

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202124/06/20226.3825
Tasa Fija 26,036,876.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/10/202112/04/20227.1578 Tasa Fija 152,421.40

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/10/202120/04/20226.3625
Tasa Fija 1,753,092.87

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202001/12/20236.3367
Tasa Fija 2,346,065.42

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202031/05/20246.515 Tasa
Fija 791,262.22

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202205/04/20226.3315
Tasa Fija 2,510,992.19

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/10/202107/04/20227.1578 Tasa Fija 2,721,268.31

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202204/07/20226.3362
Tasa Fija 3,014,784.48

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202117/06/20226.3523
Tasa Fija 15,039,701.88

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/11/202129/04/20226.8237
Tasa Fija 20,011,372.89

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202108/04/20226.33 Tasa
Fija 1,004,220.00

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201830/01/20236.8265

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 45 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Fija 4,595,465.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202113/06/20226.3375
Tasa Fija 1,299,103.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202109/05/20226.33 Tasa
Fija 2,304,281.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202202/06/20228.1036 Tasa Fija 209,809.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202211/04/20227.1085 Tasa Fija 237,245.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/12/202126/05/20227.6107 Tasa Fija 495,512.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202030/11/20236.8265
Tasa Fija 8,867,937.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/20236.3375
Tasa Fija 865,132.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202107/06/20227.6586 Tasa Fija 10,759.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202203/05/20227.1085 Tasa Fija 589,657.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/09/202104/04/20226.3362
Tasa Fija 1,780,665.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202225/04/20227.1085 Tasa Fija 1,446.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202107/06/20227.6586 Tasa Fija 35,785.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202006/09/20246.3315
Tasa Fija 356,715.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/10/202101/04/20226.3367
Tasa Fija 20,109,132.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202117/06/20226.3523
Tasa Fija 5,514,557.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202108/04/20226.3625
Tasa Fija 490,866.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202201/04/20227.1085 Tasa Fija 209,518.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/20236.3375
Tasa Fija 3,136,438.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/10/202113/04/20226.3375
Tasa Fija 1,504,753.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202101/06/20226.3367
Tasa Fija 5,027,283.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202110/03/20256.335 Tasa
Fija 32,854,119.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202109/05/20227.5945 Tasa Fija 1,105,384.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202117/06/20226.3523
Tasa Fija 15,039,701.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202107/06/20226.3315
Tasa Fija 20,087,937.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202108/04/20227.5945 Tasa Fija 42,690.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202129/04/20227.5945 Tasa Fija 1,306,677.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202119/04/20227.6529 Tasa Fija 284.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/10/202120/04/20226.3625
Tasa Fija 933,099.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202110/05/20226.335 Tasa
Fija 16,061,942.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/202112/05/20227.3885 Tasa Fija 2,098,794.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202124/05/20227.6529 Tasa Fija 121,766.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/10/202101/04/20226.3367
Tasa Fija 5,848,188.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202125/04/20227.6251 Tasa Fija 361,094.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/202113/04/20227.3885 Tasa Fija 13,776.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/10/202113/04/20227.1578 Tasa Fija 36,424.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/11/201931/05/20246.8265
Tasa Fija 11,322,979.92

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 46 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/01/202206/04/20226.3315
Tasa Fija 2,510,992.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/202103/05/20227.3885 Tasa Fija 83,292.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/10/202107/04/20227.1578 Tasa Fija 1,452,375.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202112/04/20227.5945 Tasa Fija 422,238.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/202117/05/20227.3885 Tasa Fija 11,909.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202218/04/20227.1085 Tasa Fija 32,210.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/202112/05/20227.3885 Tasa Fija 1,411,144.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202126/04/20227.6251 Tasa Fija 1,336,556.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202126/04/20227.107 Tasa Fija 175,989.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202221/04/20227.1085 Tasa Fija 295,762.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/202112/05/20227.3885 Tasa Fija 259,099.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 188,819,910.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/01/202208/04/20226.3315
Tasa Fija 443,943.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 207,283,469.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202204/04/20227.1085 Tasa Fija 107,920.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/201820/05/20258.26 Tasa
Fija 4,583,177.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202118/04/20227.107 Tasa Fija 668,681.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 233,492,518.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202124/06/20227.974 Tasa Fija 4,207.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/202117/05/20227.3885 Tasa Fija 301,121.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202112/04/20226.7175 Tasa Fija 143,398.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202120/04/20227.107 Tasa Fija 97,974.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/01/202204/04/20225.9585
Tasa Fija 1,996,299.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202112/05/20227.6737 Tasa Fija 11,765.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/202112/05/20227.3885 Tasa Fija 584,374.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202113/04/20226.7175 Tasa Fija 284,215.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202112/05/20227.6737 Tasa Fija 350,489.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/10/202113/04/20226.3375
Tasa Fija 3,511,090.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/10/202113/04/20226.3375
Tasa Fija 12,539,609.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/09/202105/04/20226.3315
Tasa Fija 349,572.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202104/04/20226.7175 Tasa Fija 58,233.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202112/04/20227.6251 Tasa Fija 18,157.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/10/202113/04/20226.3375
Tasa Fija 1,755,545.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202129/05/20266.8265
Tasa Fija 38,425,364.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202104/05/20227.5945 Tasa Fija 18,752.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202105/05/20227.5945 Tasa Fija 2,837,587.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/06/202006/03/20256.07 Tasa
Fija 7,771,956.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/12/202131/05/20227.6107 Tasa Fija 9,882.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/06/202006/12/20226.3315
Tasa Fija 40,231,674.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202111/04/20221.71663 Tasa Fija 185,072.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202113/06/20227.9035 Tasa Fija 102,919.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/12/202008/12/20236.33 Tasa

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 47 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Fija 284,698.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202110/05/20226.335 Tasa Fija 2,303,884.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202008/12/20236.33 Tasa Fija 87,869.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202030/09/20227.0265 Tasa Fija 213,613.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202108/04/20227.1 Tasa Fija 340,840.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202030/06/20237.0265 Tasa Fija 1,028,018.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202205/07/20226.3315 Tasa Fija 3,013,190.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202015/12/20227.0265 Tasa Fija 3,516,424.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202205/07/20226.3315 Tasa Fija 2,008,793.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202205/07/20226.3315 Tasa Fija 3,314,509.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202113/04/20227.1 Tasa Fija 34,012.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202225/09/20246.3912 Tasa Fija 6,287,920.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/01/202206/05/20226.3315 Tasa Fija 1,004,396.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 635,915.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202228/06/20228.1372 Tasa Fija 56,764.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202104/04/20227.1 Tasa Fija 447,573.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202030/11/20236.8265 Tasa Fija 8,867,937.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202112/04/20227.2145 Tasa Fija 9,047.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202104/04/20227.107 Tasa Fija 1,350,392.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202204/05/20227.11 Tasa Fija 7,720,169.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202131/05/20227.974 Tasa Fija 398,726.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/202112/05/20227.3885 Tasa Fija 593,439.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202225/04/20227.11 Tasa Fija 611,311.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202131/05/20227.6737 Tasa Fija 460,069.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202128/04/20226.8175 Tasa Fija 20,015,150.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202211/04/20227.11 Tasa Fija 66,247.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202124/05/20227.6168 Tasa Fija 273,383.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202205/07/20228.1372 Tasa Fija 78,451.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202127/06/20226.8175 Tasa Fija 27,020,452.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202229/04/20227.11 Tasa Fija 803,598.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202119/05/20227.6168 Tasa Fija 1,122,474.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202204/05/20227.11 Tasa Fija 960,125.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/06/202019/11/20246.3625 Tasa Fija 3,005,302.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/12/202102/06/20226.3395 Tasa Fija 5,327,999.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202119/05/20227.6168 Tasa Fija 4,958,005.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202205/07/20228.1372 Tasa Fija 33,745.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202211/04/20227.11 Tasa Fija 46,265.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202118/04/20227.107 Tasa Fija 273,686.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202124/05/20227.6168 Tasa Fija 42,435.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202120/04/20227.107 Tasa Fija 44,250.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/11/202118/05/20220.58757

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 48 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Fija 59,686,934.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202118/04/20227.107 Tasa Fija 44,008.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202124/05/20227.6168 Tasa Fija 12,224.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202102/05/20226.3395
Tasa Fija 13,418,516.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/10/202104/05/20226.3362
Tasa Fija 5,782,603.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202020/06/20256.3625
Tasa Fija 6,511,487.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202028/11/20256.8265
Tasa Fija 15,164,690.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202225/04/20227.11 Tasa Fija 220,555.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202103/06/20227.9035 Tasa Fija 20,584.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202112/04/20227.2145 Tasa Fija 45,514.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202204/05/20227.11 Tasa Fija 21,958.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 564,295.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202025/09/20246.3912
Tasa Fija 5,239,666.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202107/06/20227.9035 Tasa Fija 317,077.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202106/05/20227.6642 Tasa Fija 363,588.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202101/04/20226.3367
Tasa Fija 1,005,456.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202104/05/20227.6642 Tasa Fija 732,205.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202107/04/20227.1 Tasa Fija 75,028.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202108/04/20227.6642 Tasa Fija 89,720.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202110/05/20227.6642 Tasa Fija 32,810.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202120/04/20226.3625
Tasa Fija 1,995,306.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202105/05/20227.6642 Tasa Fija 1,885,187.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202110/05/20227.6642 Tasa Fija 27,541.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202120/06/20226.3625
Tasa Fija 4,307,599.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/06/202023/01/20256.375 Tasa
Fija 6,356,781.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202113/04/20227.6686 Tasa Fija 124,915.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/10/202122/04/20226.3625
Tasa Fija 20,035,347.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202110/05/20227.6642 Tasa Fija 17,620.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202120/06/20226.3625
Tasa Fija 1,101,944.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/10/202119/04/20227.411 Tasa Fija 162,233.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202113/04/20227.2145 Tasa Fija 1,741,997.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202130/06/20266.8265
Tasa Fija 8,503,223.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/10/202119/04/20227.411 Tasa Fija 41,311.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202107/04/20226.3625
Tasa Fija 651,148.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202103/05/20227.6168 Tasa Fija 235,992.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202128/04/20226.8175
Tasa Fija 1,000,757.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202130/06/20266.8265
Tasa Fija 8,503,223.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202120/07/20226.3625
Tasa Fija 901,590.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202119/05/20227.6168 Tasa Fija 1,718,006.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202108/04/20226.8237

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 49 / 88
CONSOLIDADO
Impresión Final

Tasa Fija 550,312.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202117/05/20227.6168 Tasa Fija 17,645.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202111/04/20227.1 Tasa Fija 125,260.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/10/202120/04/20226.3625
Tasa Fija 5,008,836.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202101/06/20226.3367
Tasa Fija 5,027,283.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202101/06/20226.3367
Tasa Fija 5,027,283.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/20256.8265
Tasa Fija 386,811,710.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/11/202125/05/20226.3912
Tasa Fija 1,401,739.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202103/05/20227.6686 Tasa Fija 190,096.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/10/202105/04/20226.3315
Tasa Fija 20,087,937.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202118/04/20221.74325 Tasa Fija 49,740.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202129/12/20236.8265
Tasa Fija 128,067,755.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/11/201902/06/20236.3395
Tasa Fija 385,748.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20251.83743
Tasa Fija 8,970,251.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/10/202105/05/20226.3315
Tasa Fija 5,826,800.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/20256.8265
Tasa Fija 130,385,969.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202105/05/20227.6642 Tasa Fija 270,336.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20251.83743
Tasa Fija 1,719,670.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/10/202112/04/20226.3375
Tasa Fija 1,755,545.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/01/202208/04/20226.3315
Tasa Fija 502,198.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202107/06/20227.6644 Tasa Fija 335,776.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201920/11/20236.3625
Tasa Fija 10,435,076.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202127/05/20227.9816 Tasa Fija 146,457.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20251.83743
Tasa Fija 836,158.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202106/04/20226.7032 Tasa Fija 905,758.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/10/202121/04/20226.3625
Tasa Fija 1,753,092.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202126/04/20227.105 Tasa Fija 47,376.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201931/10/20246.8265
Tasa Fija 3,100,587.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20251.02743
Tasa Fija 808,196.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202206/07/20228.1372 Tasa Fija 102,621.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202124/06/20227.9816 Tasa Fija 495,545.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202121/04/20226.3625
Tasa Fija 1,001,767.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20251.35743
Tasa Fija 732,616.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202107/04/20226.3315
Tasa Fija 2,108,055.46

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 50 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/10/202105/05/20226.3315
Tasa Fija 2,008,793.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202203/06/20228.1372 Tasa Fija 81,903.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202118/04/20227.105 Tasa Fija 681,595.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202026/06/20256.8175
Tasa Fija 13,009,847.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202110/05/20227.6642 Tasa Fija 15,570.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202127/06/20227.9816 Tasa Fija 1,736,518.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202126/04/20227.6686 Tasa Fija 1,019,158.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/10/202112/04/20226.3375
Tasa Fija 1,755,545.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202123/06/20227.9816 Tasa Fija 266,280.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202023/06/20236.3912
Tasa Fija 25,031,068.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202124/06/20227.9816 Tasa Fija 212,908.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202107/06/20227.6644 Tasa Fija 39,773.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202105/04/20227.1543 Tasa Fija 36,197.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202029/09/20236.8265
Tasa Fija 3,677,872.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202204/05/20227.11 Tasa Fija 8,904.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202029/09/20236.8265
Tasa Fija 17,307,529.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202105/04/20227.1543 Tasa Fija 1,222.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202206/05/20227.11 Tasa Fija 125,461.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/11/202103/05/20226.341 Tasa
Fija 8,198,666.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202029/09/20236.8265
Tasa Fija 2,249,451.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202107/06/20227.6644 Tasa Fija 39,401.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202124/05/20227.6127 Tasa Fija 326,835.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202029/09/20236.8265
Tasa Fija 1,317,772.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202126/04/20227.4059 Tasa Fija 324,823.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202105/04/20227.1543 Tasa Fija 23,665.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202205/07/20228.1372 Tasa Fija 10,104.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202120/04/20227.6686 Tasa Fija 55,379.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202131/05/20227.9816 Tasa Fija 118,456.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202029/09/20236.8265
Tasa Fija 482,175.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202103/05/20227.6127 Tasa Fija 215,903.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202225/04/20227.11 Tasa Fija 739,333.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202029/09/20236.8265
Tasa Fija 4,638,131.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202101/04/20226.6455 Tasa Fija 1,543,087.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202211/04/20227.11 Tasa Fija 552,269.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202029/09/20236.8265
Tasa Fija 13,327,117.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/12/202114/06/20226.3375
Tasa Fija 1,003,168.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202111/04/20221.7255 Tasa Fija 195,156.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202124/06/20227.9816 Tasa Fija 788,099.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202110/06/20227.9155 Tasa Fija 164,544.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/01/202205/08/20226.3315
Tasa Fija 1,011,427.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202107/06/20227.6644 Tasa Fija 328,322.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202104/04/20227.1025 Tasa Fija 13,103.87

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 51 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/11/202111/05/20226.3375
Tasa Fija 898,308.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202204/05/20227.11 Tasa Fija 75,711.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202225/04/20227.11 Tasa Fija 160,620.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/11/201926/11/20246.8175
Tasa Fija 8,006,060.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202223/06/20228.1372 Tasa Fija 1,010,309.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/11/202109/05/20226.33 Tasa
Fija 2,806,303.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/12/202113/04/20226.3375
Tasa Fija 15,047,531.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202113/04/20227.1025 Tasa Fija 175,669.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202127/05/20227.6644 Tasa Fija 819,590.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202122/04/20227.1025 Tasa Fija 709,162.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/12/202108/04/20226.8265
Tasa Fija 500,189.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202216/06/20228.1372 Tasa Fija 663,182.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202105/05/20227.6168 Tasa Fija 218,642.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/11/202120/05/20226.3625
Tasa Fija 4,007,069.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202112/05/20227.6168 Tasa Fija 63,939.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/06/202029/09/20236.8265
Tasa Fija 28,537,644.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202107/06/20227.6644 Tasa Fija 665,841.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/11/202102/06/20226.3395
Tasa Fija 3,015,848.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/12/202106/06/20226.3315
Tasa Fija 10,043,968.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202125/05/20227.6127 Tasa Fija 28,569.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202211/04/20227.11 Tasa Fija 114,280.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/12/202108/04/20226.33 Tasa
Fija 1,004,220.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/12/202128/04/20226.8175
Tasa Fija 1,000,757.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/10/202122/04/20226.8265
Tasa Fija 8,501,611.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/11/202124/05/20227.6168 Tasa Fija 50,572.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202103/06/20227.6127 Tasa Fija 215,641.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/10/202105/04/20227.1663 Tasa Fija 224,966.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/12/202019/12/20256.3625
Tasa Fija 70,123,715.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202117/05/20227.4059 Tasa Fija 16,122.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202103/05/20227.651 Tasa Fija 945,911.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/10/202122/04/20226.3625
Tasa Fija 2,476,171.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202104/04/20226.7032 Tasa Fija 4,680,453.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/10/202106/04/20226.3315
Tasa Fija 2,390,464.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202111/04/20227.1025 Tasa Fija 804,832.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202111/04/20227.3323 Tasa Fija 1,394,256.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/01/201929/09/20236.8265
Tasa Fija 2,692,818.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202104/04/20226.7032 Tasa Fija 914,883.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/11/202109/05/20227.6642 Tasa Fija 28,715.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202131/05/20227.6127 Tasa Fija 26,677.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202103/05/20227.651 Tasa Fija 1,437.31

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 52 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202108/04/20226.335 Tasa Fija 240,929.13

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202108/04/20226.716 Tasa Fija 259,056.65

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202103/05/20227.651 Tasa Fija 15,790.36

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202104/04/20226.7032 Tasa Fija 523,559.85

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202113/04/20226.716 Tasa Fija 182,214.68

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/20256.8175 Tasa Fija 35,426,815.65

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202105/08/20226.3315 Tasa Fija 70,307,781.27

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/20256.8265 Tasa Fija 36,013,652.96

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202104/04/20226.716 Tasa Fija 5,994.43

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/20256.8175 Tasa Fija 36,027,270.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202114/06/20227.6706 Tasa Fija 59,606.92

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202129/04/20227.105 Tasa Fija 134,095.38

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/20256.8175 Tasa Fija 36,027,270.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202109/06/20227.6706 Tasa Fija 2,616,763.62

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202104/04/20227.105 Tasa Fija 9,771.40

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202114/06/20227.6706 Tasa Fija 353,645.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202122/04/20227.54 Tasa Fija 1,279,963.93

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202105/04/20227.105 Tasa Fija 633,932.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202113/05/20227.6706 Tasa Fija 60,672.60

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202124/06/20227.9816 Tasa Fija 1,243,826.30

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202108/07/20226.33 Tasa Fija 903,798.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202113/04/20227.54 Tasa Fija 382,367.23

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202128/04/20227.651 Tasa Fija 953,862.96

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202105/04/20226.6455 Tasa Fija 184,816.99

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/10/202106/04/20227.1663 Tasa Fija 209,824.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202128/04/20227.651 Tasa Fija 3,733,806.86

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202131/05/20227.6127 Tasa Fija 16,283.47

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202108/04/20226.33 Tasa Fija 15,063,300.00

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/202121/07/20226.3625 Tasa Fija 300,530.22

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/08/202113/04/20226.3375 Tasa Fija 56,177,450.03

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/202122/04/20226.3625 Tasa Fija 1,001,767.36

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/201827/04/20236.8175 Tasa Fija 11,970,794.44

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202104/04/20226.7032 Tasa Fija 135,956.99

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202115/05/20256.3425 Tasa Fija 1,588,075.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202107/04/20226.7032 Tasa Fija 1,545,753.75

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/12/202101/04/20226.7032 Tasa Fija 64,501.68

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54 Tasa Fija 6,041,253.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202117/05/20227.6706 Tasa Fija 206,071.64

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/201720/12/20237.62 Tasa Fija 5,583,712.29

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/09/202108/04/20226.33 Tasa Fija 2,788,444.68

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 53 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/12/202127/06/20226.8175
Tasa Fija 5,594,234.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202126/04/20227.6261 Tasa Fija 262,767.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202120/04/20227.54 Tasa Fija 148,469.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202029/12/20226.8265
Tasa Fija 2,041,752.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202118/04/20221.75438 Tasa Fija 169,237.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/12/202105/04/20226.3315
Tasa Fija 1,004,396.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202109/06/20227.6706 Tasa Fija 2,141,162.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202106/04/20226.716 Tasa Fija 528,926.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/201928/06/20246.8265
Tasa Fija 17,062,058.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202111/04/20227.1025 Tasa Fija 284,587.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202116/06/20227.9155 Tasa Fija 319,715.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/202122/04/20226.3625
Tasa Fija 1,753,092.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/202106/04/20226.375 Tasa
Fija 400,637.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202113/05/20227.6261 Tasa Fija 58,098.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/202115/07/20226.3425
Tasa Fija 902,695.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/202113/04/20226.3375
Tasa Fija 20,063,375.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202112/04/20227.54 Tasa Fija 110,996.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202111/04/20226.716 Tasa Fija 3,472,830.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202108/06/20226.8265
Tasa Fija 11,252,133.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202129/04/20227.105 Tasa Fija 320,457.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/201714/09/20226.3375
Tasa Fija 10,182,413.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202103/06/20227.9977 Tasa Fija 976,986.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202113/05/20227.6706 Tasa Fija 94,872.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/201714/09/20226.3375
Tasa Fija 7,914,750.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/12/202114/06/20227.6706 Tasa Fija 7,394.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/201714/09/20226.3375
Tasa Fija 42,233,153.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202131/05/20227.9977 Tasa Fija 351,464.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/201714/09/20226.3375
Tasa Fija 22,431,103.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/11/202108/04/20227.651 Tasa Fija 4,579.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202124/06/20227.9977 Tasa Fija 165,291.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202121/06/20227.9977 Tasa Fija 20,388.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202111/04/20227.105 Tasa Fija 191,106.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/12/202123/06/20227.9977 Tasa Fija 1,496,272.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202123/05/20227.6261 Tasa Fija 483,783.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202102/06/20236.8265
Tasa Fija 14,002,654.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/10/202125/04/20226.8265
Tasa Fija 15,002,844.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202006/09/20246.3315
Tasa Fija 587,752.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202124/05/20227.6261 Tasa Fija 251,803.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202113/04/20227.5069 Tasa Fija 1,685,373.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/07/202130/06/20266.8265

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 54 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Fija 6,802,578.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202117/05/20227.6898 Tasa Fija 171,822.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202113/01/20256.3375
Tasa Fija 178,255,370.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/08/202123/04/20266.375 Tasa
Fija 2,085,818.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/201928/06/20246.8265
Tasa Fija 17,062,058.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/06/201830/11/20226.8265
Tasa Fija 15,873,773.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201915/12/20236.3425
Tasa Fija 797,757.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202110/06/20256.335 Tasa
Fija 5,905,852.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202129/07/20266.8237
Tasa Fija 15,608,870.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202130/06/20266.8265
Tasa Fija 1,700,643.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201928/06/20246.8265
Tasa Fija 6,785,741.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/201530/06/20225.22 Tasa
Fija 120,694.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/07/201530/06/20225.2 Tasa
Fija 63,105.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/07/201530/06/20225.2 Tasa
Fija 46,834.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/07/201530/06/20225.18 Tasa
Fija 179,968.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201917/10/20246.3523
Tasa Fija 4,727,248.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/07/201530/06/20225.32 Tasa
Fija 110,191.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201928/06/20246.8265
Tasa Fija 4,692,065.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/08/201530/06/20225.35 Tasa
Fija 327,155.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/202110/06/20226.8265
Tasa Fija 18,753,555.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/04/201715/04/20227.64 Tasa
Fija 501,591.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/04/201715/04/20227.64 Tasa
Fija 133,758.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/04/201715/04/20227.64 Tasa
Fija 33,439.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202020/08/20255.77 Tasa
Fija 27,377,142.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202025/08/20256.3912
Tasa Fija 7,747,711.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/08/202026/08/20256.8265
Tasa Fija 22,754,530.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/05/201711/05/20227.64 Tasa
Fija 1,338,407.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202131/03/20257.8265
Tasa Fija 31,499,463.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/201929/11/20246.8265
Tasa Fija 8,001,517.02

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 55 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/01/201915/11/20226.3425	Tasa Fija 89,529.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/03/202131/03/20266.8265	Tasa Fija 8,401,592.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/201930/05/20226.8265	Tasa Fija 833,491.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/02/202130/01/20266.3395	Tasa Fija 15,749,432.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/09/202006/03/20255.51	Tasa Fija 5,615,404.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/06/202109/06/20236.8265	Tasa Fija 10,001,896.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/04/202101/04/20266.3315	Tasa Fija 114,836,042.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/06/201815/06/20236.3425	Tasa Fija 40,089,954.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/201929/01/20246.8237	Tasa Fija 127,874,162.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/06/202117/06/20266.29	Tasa Fija 19,146,715.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/09/202029/08/20236.8237	Tasa Fija 11,315,954.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202016/04/20255.39	Tasa Fija 2,622,031.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202016/04/20255.39	Tasa Fija 3,374,056.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202019/09/20256.3625	Tasa Fija 7,012,371.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/10/201729/07/20227.55	Tasa Fija 184,100.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/01/202012/01/20246.3375	Tasa Fija 22,423,361.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202016/04/20255.39	Tasa Fija 1,371,478.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202019/09/20256.3625	Tasa Fija 7,012,371.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/06/201902/06/20236.3395	Tasa Fija 1,570,754.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/06/201902/06/20236.3395	Tasa Fija 345,565.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/09/202024/09/20256.3825	Tasa Fija 20,041,651.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/01/202016/01/20256.3487	Tasa Fija 40,409,998.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/09/202024/09/20251.48486	Tasa Fija 21,448,219.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202006/12/20246.3315	Tasa Fija 11,048,365.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202015/03/20236.3425	Tasa Fija 10,746,375.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/06/201902/06/20236.3395	Tasa Fija 1,256,603.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/09/201714/09/20227.54	Tasa Fija 528,299.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/01/202026/01/20246.8175	Tasa Fija 3,210,763.70

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 56 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa Fija 1,678,730.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa Fija 13,752,463.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202118/02/20266.36 Tasa Fija 40,376,267.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201829/12/20236.8265 Tasa Fija 20,653,915.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/201829/12/20236.8265 Tasa Fija 35,006,636.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202017/10/20246.3523 Tasa Fija 4,277,777.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202115/04/20256.3425 Tasa Fija 1,739,569.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/07/201809/02/20236.33 Tasa Fija 1,004,058.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/06/202103/03/20236.8265 Tasa Fija 10,001,896.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202026/11/20246.8175 Tasa Fija 9,101,626.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/201730/11/20227.62 Tasa Fija 23,666,240.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/201730/11/20227.62 Tasa Fija 20,844,081.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202103/03/20236.8265 Tasa Fija 10,001,896.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202006/09/20246.3315 Tasa Fija 719,423.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/06/202130/06/20266.8265 Tasa Fija 8,503,223.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/201830/11/20226.8265 Tasa Fija 24,489,919.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/06/202130/06/20266.8265 Tasa Fija 9,778,707.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201919/02/20241.31657 Tasa Fija 22,883,131.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202010/01/20250.886 Tasa Fija 11,360,250.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202123/04/20266.375 Tasa Fija 14,412,600.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/07/201530/06/20225.25 Tasa Fija 73,354.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/201530/06/20225.23 Tasa Fija 186,390.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/201530/06/20225.4 Tasa Fija 422,174.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/201931/05/20246.8265 Tasa Fija 3,140,844.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/08/201831/07/20238.39 Tasa Fija 2,560,596.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202028/06/20246.8265 Tasa Fija 9,581,305.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202031/03/20256.8265 Tasa Fija 76,308,816.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201831/01/20236.8265 Tasa Fija 47,925,736.14

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 57 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202004/04/20256.3315 Tasa Fija 9,290,671.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202014/11/20236.3375 Tasa Fija 5,990,798.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/20256.3487 Tasa Fija 9,949,544.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/20256.3487 Tasa Fija 8,783,786.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202025/10/20246.8175 Tasa Fija 5,798,138.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 1,293,310.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 3,755,817.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 3,036,449.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/201931/05/20246.8265 Tasa Fija 64,253,848.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/07/202101/03/20236.8265 Tasa Fija 14,002,654.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/201809/02/20236.33 Tasa Fija 1,840,774.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/201809/02/20236.33 Tasa Fija 1,145,371.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/201809/02/20236.33 Tasa Fija 1,022,652.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/07/202103/07/20236.8265 Tasa Fija 18,003,413.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/201829/12/20236.8265 Tasa Fija 83,597,099.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202107/05/20266.3315 Tasa Fija 41,849,869.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202115/04/20256.3425 Tasa Fija 4,252,281.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/06/201914/12/20236.3375 Tasa Fija 4,766,412.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/201828/02/20236.8265 Tasa Fija 11,002,085.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/05/202106/05/20226.8265 Tasa Fija 18,753,555.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/07/201901/07/20226.341 Tasa Fija 6,700,720.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/201830/11/20226.8265 Tasa Fija 6,625,774.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/201830/11/20226.8265 Tasa Fija 7,100,819.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/07/201928/06/20246.8265 Tasa Fija 53,701,465.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/201809/02/20236.33 Tasa Fija 1,871,973.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/20246.8265 Tasa Fija 7,432,304.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/20246.8265 Tasa Fija 6,255,415.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/20246.8265 Tasa Fija 1,365,260.00

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 58 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/20246.8265	Tasa Fija 24,104,443.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201831/08/20236.8265	Tasa Fija 302,317.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201831/08/20236.8265	Tasa Fija 201,658.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/201928/06/20246.8265	Tasa Fija 5,046,361.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/201831/08/20238.54	Tasa Fija 314,914.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/201928/06/20246.8265	Tasa Fija 5,715,551.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201829/12/20236.8265	Tasa Fija 19,253,650.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/10/201815/09/20229.39	Tasa Fija 121,749.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/10/201815/09/20229.39	Tasa Fija 121,749.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/10/201815/09/20229.39	Tasa Fija 121,749.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/201829/09/20236.8265	Tasa Fija 13,464,091.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/201931/07/20246.8265	Tasa Fija 933,510.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201809/02/20236.33	Tasa Fija 1,115,084.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/08/201929/08/20236.8265	Tasa Fija 57,344,932.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/09/201915/09/20236.3425	Tasa Fija 1,367,583.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20246.3425	Tasa Fija 601,797.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20246.3425	Tasa Fija 13,903,586.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20246.3425	Tasa Fija 14,526,135.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20246.3425	Tasa Fija 4,150,324.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20246.3425	Tasa Fija 4,150,324.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20246.3425	Tasa Fija 4,150,324.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/201931/05/20246.8265	Tasa Fija 32,777,047.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201828/04/20239.29	Tasa Fija 13,203,406.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201828/04/20239.29	Tasa Fija 2,800,722.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202230/06/20228.1012	Tasa Fija 65,702.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202208/07/20226.33	Tasa Fija 15,063,300.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202205/08/20226.3315	Tasa Fija 19,585,739.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202204/08/20226.3362	Tasa Fija 20,098,563.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202208/08/20226.33	Tasa

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 59 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Fija 11,059,577.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202203/08/20226.341 Tasa Fija 10,051,080.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202201/07/20228.0907 Tasa Fija 14,680.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/01/202211/04/20226.3375 Tasa Fija 2,509,242.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/01/202211/04/20226.3375 Tasa Fija 501,848.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/01/202205/05/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/01/202206/05/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/01/202209/05/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/01/202210/05/20226.8265 Tasa Fija 1,005,643.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202223/06/20228.101 Tasa Fija 17,594.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202212/04/20226.3375 Tasa Fija 501,584.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202202/06/20228.101 Tasa Fija 16,173.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202204/05/20227.114 Tasa Fija 86,294.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202207/04/20227.114 Tasa Fija 790,492.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202229/04/20227.114 Tasa Fija 520,327.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202211/07/20226.3375 Tasa Fija 5,721,072.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202208/04/20225.964 Tasa Fija 4,962,537.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202230/06/20228.0626 Tasa Fija 733,719.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202211/07/20228.0626 Tasa Fija 3,514,629.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202206/05/20227.1165 Tasa Fija 886,746.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202213/04/20226.3425 Tasa Fija 2,507,928.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202213/05/20226.3375 Tasa Fija 1,003,168.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202213/04/20226.3375 Tasa Fija 501,584.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202211/04/20226.3375 Tasa Fija 2,509,242.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202211/04/20226.3375 Tasa Fija 2,509,242.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202212/07/20226.3375 Tasa Fija 3,511,090.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202212/07/20226.3375 Tasa Fija 4,514,259.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202222/03/20227.1142 Tasa Fija 4,276.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202212/07/20228.0626 Tasa Fija 717,261.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202207/07/20228.0626 Tasa Fija 1,956,668.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202207/07/20228.0626 Tasa Fija 2,512,896.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/01/202212/04/20226.3375 Tasa Fija 2,507,921.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202211/04/20227.1142 Tasa Fija 90,029.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202213/05/20227.1142 Tasa Fija 247,063.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202207/07/20228.0626 Tasa Fija 1,399,260.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202212/04/20227.1142 Tasa Fija 627,496.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/01/202213/04/20226.3375 Tasa Fija 451,425.94

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 60 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/01/202213/05/20226.3375
Tasa Fija 1,003,168.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202225/03/20227.1142 Tasa Fija 119,166.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/01/202213/07/20226.3375
Tasa Fija 3,009,506.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/01/202208/04/20226.3375
Tasa Fija 476,505.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202229/04/20227.1175 Tasa Fija 44,126.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202211/05/20227.1175 Tasa Fija 9,251,995.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202213/04/20226.3523
Tasa Fija 501,323.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202213/04/20225.9675
Tasa Fija 3,968,209.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202213/04/20226.3375
Tasa Fija 2,507,921.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202213/04/20227.1175 Tasa Fija 322,010.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202213/05/20227.1175 Tasa Fija 815,665.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202212/04/20227.1175 Tasa Fija 330,339.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202230/06/20228.1335 Tasa Fija 178,915.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/05/20226.36 Tasa
Fija 9,022,260.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/01/20236.36 Tasa
Fija 20,049,466.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/04/20226.36 Tasa
Fija 400,989.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/04/20226.36 Tasa
Fija 2,506,183.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202218/04/20227.1175 Tasa Fija 111,442.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202211/05/20227.1175 Tasa Fija 94,024.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202218/04/20227.1175 Tasa Fija 1,075,008.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/05/20226.36 Tasa
Fija 60,148,400.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/04/20226.36 Tasa
Fija 681,681.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/04/20226.8265
Tasa Fija 1,500,284.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/04/20226.36 Tasa
Fija 4,009,893.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202230/06/20228.1334 Tasa Fija 255,341.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202213/05/20227.118 Tasa Fija 1,722.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202222/04/20227.118 Tasa Fija 803,728.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202219/04/20227.118 Tasa Fija 87,158.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202219/04/20227.118 Tasa Fija 1,072,507.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202204/05/20227.118 Tasa Fija 241,444.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202219/04/20226.3625
Tasa Fija 1,001,767.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202212/05/20226.8265
Tasa Fija 1,005,643.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202219/04/20226.8265
Tasa Fija 1,257,054.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202230/12/20226.8265
Tasa Fija 8,003,034.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202219/04/20227.1215 Tasa Fija 594,931.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202218/07/20228.1536 Tasa Fija 2,155,679.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202207/07/20228.1536 Tasa Fija 131,916.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/01/202220/04/20226.8265

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 61 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Fija 1,250,237.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202211/05/20227.1215 Tasa Fija 77,453.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202211/05/20227.1215 Tasa Fija 2,389.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202205/07/20228.1536 Tasa Fija 84,447.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/01/202220/04/20226.3625
Tasa Fija 1,001,767.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/01/202208/04/20226.3625
Tasa Fija 299,778.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/01/202213/05/20226.8265
Tasa Fija 1,000,189.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/01/202220/04/20226.375 Tasa
Fija 1,001,770.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202213/05/20227.1235 Tasa Fija 840,912.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202218/05/20227.1235 Tasa Fija 84,335.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202225/04/20227.1235 Tasa Fija 142,962.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202214/07/20228.1351 Tasa Fija 886,539.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202213/05/20227.1235 Tasa Fija 447,280.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202214/07/20228.1351 Tasa Fija 212,104.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202204/05/20227.1235 Tasa Fija 239,423.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202215/07/20228.1351 Tasa Fija 136,531.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202218/04/20227.1235 Tasa Fija 503,062.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/01/202208/04/20226.3625
Tasa Fija 475,839.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/01/202220/05/20226.8265
Tasa Fija 1,066,202.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/01/202220/05/20226.3625
Tasa Fija 1,001,767.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/01/202221/04/20226.3625
Tasa Fija 400,706.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/01/202217/05/20226.8265
Tasa Fija 1,000,189.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/01/202221/04/20226.3625
Tasa Fija 308,544.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/01/202220/07/20226.3625
Tasa Fija 17,030,045.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202220/05/20227.1225 Tasa Fija 171,545.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202210/06/20228.1027 Tasa Fija 166,537.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202220/05/20227.1225 Tasa Fija 2,217,569.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202225/04/20227.1225 Tasa Fija 214,641.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202204/05/20227.1225 Tasa Fija 63,937.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202221/04/20227.1225 Tasa Fija 153,362.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202220/07/20228.1027 Tasa Fija 81,206.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/01/202224/05/20226.3825
Tasa Fija 1,001,418.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/01/202218/05/20226.8265
Tasa Fija 1,005,643.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/01/202222/04/20226.8265
Tasa Fija 1,500,284.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/01/202222/08/20226.3625
Tasa Fija 3,506,185.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/01/202222/07/20226.3625
Tasa Fija 17,030,045.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202222/04/20227.1252 Tasa Fija 59,294.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202206/05/20227.1252 Tasa Fija 51,796.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/01/202223/08/20226.375 Tasa
Fija 3,505,578.13

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 62 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202204/05/20227.1252 Tasa Fija 128,207.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202225/04/20226.3912
Tasa Fija 400,497.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202220/04/20225.9752
Tasa Fija 1,981,448.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202219/05/20226.8265
Tasa Fija 1,000,189.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202225/04/20226.8265
Tasa Fija 2,000,379.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202224/05/20227.128 Tasa Fija 416,333.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202223/06/20228.1346 Tasa Fija 165,191.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202222/07/20228.1346 Tasa Fija 101,468.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202226/05/20226.8265
Tasa Fija 1,181,203.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202226/04/20226.8265
Tasa Fija 2,000,379.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202222/04/20227.128 Tasa Fija 88,788.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202225/07/20226.3912
Tasa Fija 5,006,213.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202225/07/20226.3912
Tasa Fija 5,006,213.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202225/07/20226.3912
Tasa Fija 5,006,213.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202225/07/20226.3912
Tasa Fija 5,006,213.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202224/05/20226.8265
Tasa Fija 1,000,189.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202224/08/20226.3825
Tasa Fija 2,002,836.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202223/09/20226.8265
Tasa Fija 18,753,555.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202226/04/20227.129 Tasa Fija 396,356.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202214/07/20228.1446 Tasa Fija 182,910.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202218/05/20227.129 Tasa Fija 9,869,056.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202205/07/20228.1446 Tasa Fija 69,980.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202213/05/20227.129 Tasa Fija 1,530,366.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202208/04/20226.8175
Tasa Fija 332,751.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202219/04/20227.129 Tasa Fija 469.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202225/05/20226.8265
Tasa Fija 1,000,189.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202227/04/20227.129 Tasa Fija 33,675.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202227/04/20227.1293 Tasa Fija 289,944.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202221/07/20228.1802 Tasa Fija 1,863,096.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202206/05/20227.1293 Tasa Fija 1,242,355.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202225/05/20227.1293 Tasa Fija 6,002,475.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202225/05/20227.1293 Tasa Fija 3,420,770.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202227/06/20228.1802 Tasa Fija 642,840.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202225/05/20227.1293 Tasa Fija 36,016.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202218/05/20227.1293 Tasa Fija 343,831.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202226/07/20228.1802 Tasa Fija 6,813.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202226/07/20228.1802 Tasa Fija 37,143.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202225/04/20227.1293 Tasa Fija 93,837.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202211/04/20227.1293 Tasa Fija 78,135.36

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 63 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/01/202226/07/20228.1802	Tasa Fija	43,929.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/01/202216/05/20227.1293	Tasa Fija	11,594.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/01/202225/04/20227.1293	Tasa Fija	17,073.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/01/202208/04/20226.8175		Tasa Fija	446,838.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/01/202206/04/20226.33		Tasa Fija	2,510,989.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/01/202212/07/20228.1335	Tasa Fija	138,073.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/01/202205/07/20228.1536	Tasa Fija	45,775.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/01/202219/07/20228.1351	Tasa Fija	26,278.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/01/202212/07/20228.1334	Tasa Fija	56,419.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/01/202212/07/20228.1536	Tasa Fija	141,678.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/01/202221/06/20228.1351	Tasa Fija	1,012.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/01/202222/07/20228.1108	Tasa Fija	215,104.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/01/202211/05/20227.118	Tasa Fija	124,825.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/01/202205/05/20227.1125	Tasa Fija	736,590.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/01/202223/06/20228.0907	Tasa Fija	4,237,496.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202226/04/20227.1298	Tasa Fija	200,465.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202228/06/20228.2557	Tasa Fija	217,660.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202225/04/20227.1298	Tasa Fija	35,837.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202225/07/20228.2557	Tasa Fija	10,567,937.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202225/05/20227.1298	Tasa Fija	70,422.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202230/06/20228.2557	Tasa Fija	65,306.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/01/202231/05/20226.8265		Tasa Fija	1,594,260.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202201/04/20226.884	Tasa Fija	100,602.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202220/05/20227.1298	Tasa Fija	89,156.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202225/05/20227.1298	Tasa Fija	7,602.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/01/202229/06/20228.1536	Tasa Fija	616,684.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/01/202229/03/20227.1125	Tasa Fija	371,308.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202212/05/20227.1298	Tasa Fija	398,350.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202229/06/20228.2557	Tasa Fija	2,189,264.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202222/07/20228.2557	Tasa Fija	42,127.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/01/202206/04/20226.33		Tasa Fija	2,510,989.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202229/07/20228.2557	Tasa Fija	96,307.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202225/04/20227.1298	Tasa Fija	32,569.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202221/06/20228.2557	Tasa Fija	323,662.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202222/04/20227.1298	Tasa Fija	50,585.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/01/202204/05/20227.1125	Tasa Fija	187,956.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/01/202201/04/20227.1125	Tasa Fija	218,986.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/01/202203/06/20228.0907	Tasa Fija	43,369.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202223/05/20227.1298	Tasa Fija	2,550,014.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202223/05/20227.1298	Tasa Fija	2,856,446.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202229/07/20228.2557	Tasa Fija	5,797,386.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/01/202225/04/20227.1165	Tasa Fija	7,652,914.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/01/202202/05/20227.1142	Tasa Fija	195,352.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/01/202209/05/20227.1215	Tasa Fija	1,226,663.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/01/202216/05/20227.1235	Tasa Fija	740,101.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/01/202218/04/20227.1235	Tasa Fija	13,770.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/01/202209/05/20227.118	Tasa Fija	1,989,981.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/01/202209/05/20227.1175	Tasa Fija	176.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/01/202209/05/20227.1142	Tasa Fija	2,727,163.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/01/202218/04/20227.1165	Tasa Fija	525,193.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/01/202211/04/20227.128	Tasa Fija	121,879.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/01/202218/04/20227.1252	Tasa Fija	107,517.26

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 64 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/01/202216/05/20227.1225	Tasa Fija	2,285,925.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/01/202216/05/20227.128	Tasa Fija	295,006.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/01/202216/05/20227.1252	Tasa Fija	1,672,829.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/02/202229/07/20226.8237		Tasa Fija	2,701,535.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202229/07/20228.2712	Tasa Fija	47,792.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202213/04/20227.1325	Tasa Fija	148,378.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202228/06/20228.2712	Tasa Fija	144,719.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202223/05/20227.1325	Tasa Fija	1,585.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202225/04/20227.1325	Tasa Fija	66,920.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202225/04/20227.1325	Tasa Fija	57,400.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202225/04/20227.1325	Tasa Fija	51,683.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202218/05/20227.1325	Tasa Fija	1,190,167.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202227/04/20227.1325	Tasa Fija	286,582.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202225/05/20227.1325	Tasa Fija	24,189.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202208/04/20227.1325	Tasa Fija	376,896.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202223/05/20227.1325	Tasa Fija	391,218.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/02/202223/05/20227.1325	Tasa Fija	22,768.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/02/202202/05/20227.1352	Tasa Fija	100,906.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/02/202221/07/20228.2729	Tasa Fija	480,142.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/02/202229/04/20227.1352	Tasa Fija	451,642.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/02/202225/05/20227.1352	Tasa Fija	115,633.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/02/202227/05/20227.1352	Tasa Fija	839,271.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202201/08/20226.3367		Tasa Fija	1,422,721.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/02/202223/05/20227.1352	Tasa Fija	24,303.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/02/202225/04/20227.1352	Tasa Fija	241,017.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/02/202223/05/20227.1352	Tasa Fija	248,885.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/02/202225/05/20227.1352	Tasa Fija	2,761,869.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202227/04/20225.9852		Tasa Fija	2,474,132.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202202/06/20226.3395		Tasa Fija	1,186,233.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202208/04/20226.3395		Tasa Fija	448,858.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202203/05/20226.341		Tasa Fija	351,787.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202225/05/20227.1355	Tasa Fija	145,286.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202225/05/20227.1355	Tasa Fija	303,418.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202225/05/20227.1355	Tasa Fija	66,493.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202226/07/20228.293	Tasa Fija	181,060.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202211/04/20227.1355	Tasa Fija	12,179.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202225/04/20227.1355	Tasa Fija	33,964.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202211/04/20227.1355	Tasa Fija	96,614.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202223/05/20227.1355	Tasa Fija	15,152.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202205/07/20228.293	Tasa Fija	107,030.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202226/07/20228.293	Tasa Fija	62,845.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202209/05/20227.1355	Tasa Fija	2,721.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202204/05/20227.1355	Tasa Fija	202,360.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/01/202204/04/20221.65886	Tasa Fija	77,902.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/02/202204/05/20226.3362		Tasa Fija	1,256,160.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/01/202219/05/20227.118	Tasa Fija	1,521,057.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/01/202215/07/20228.1334	Tasa Fija	158,308.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202227/05/20227.138	Tasa Fija	1,300,994.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908	Tasa Fija	27,520.51

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01

AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 65 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202227/05/20227.138	Tasa Fija	108,473.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202210/05/20227.138	Tasa Fija	535,255.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202201/07/20228.2908	Tasa Fija	362,522.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908	Tasa Fija	24,427.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908	Tasa Fija	184,290.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202228/07/20228.2908	Tasa Fija	1,967,132.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202221/07/20228.2908	Tasa Fija	2,704,346.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202208/04/20226.3362		Tasa Fija	572,809.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202218/04/20227.138	Tasa Fija	60,388.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202225/05/20227.138	Tasa Fija	36,271.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202202/06/20227.138	Tasa Fija	125,303.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202210/05/20227.138	Tasa Fija	8,177.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908	Tasa Fija	30,049.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202214/07/20228.2908	Tasa Fija	1,017,481.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908	Tasa Fija	20,779.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202204/04/20226.8915	Tasa Fija	607,615.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202230/05/20227.138	Tasa Fija	171,711.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202225/05/20227.138	Tasa Fija	823,262.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202225/04/20227.138	Tasa Fija	28,428.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202229/07/20228.2908	Tasa Fija	1,003,780.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/02/202218/07/20228.2908	Tasa Fija	1,418,055.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202203/05/20225.988		Tasa Fija	2,966,165.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202205/05/20226.3315		Tasa Fija	200,879.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202203/08/20226.3362		Tasa Fija	12,061,249.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202205/05/20226.8265		Tasa Fija	2,000,379.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202229/01/20278.07		Tasa Fija	62,490,195.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202205/04/20226.3315		Tasa Fija	1,004,396.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202203/06/20226.341		Tasa Fija	1,483,765.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/01/202229/07/20228.2557	Tasa Fija	1,901,150.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202201/04/20226.892	Tasa Fija	10,755.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202204/04/20226.892	Tasa Fija	325,698.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202203/06/20227.1387	Tasa Fija	21,327.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202230/05/20227.1387	Tasa Fija	1,765,354.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202225/05/20227.1387	Tasa Fija	2,435,074.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202230/05/20227.1387	Tasa Fija	3,554,613.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202202/08/20228.3001	Tasa Fija	5,540.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202206/04/20226.892	Tasa Fija	137,588.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202229/04/20227.1387	Tasa Fija	289,336.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202203/06/20227.1387	Tasa Fija	176,781.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202219/04/20227.1387	Tasa Fija	652,461.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202223/05/20227.1387	Tasa Fija	483,780.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202204/05/20227.1387	Tasa Fija	4,945.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202205/07/20228.3001	Tasa Fija	283,911.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202208/06/20226.33		Tasa Fija	1,482,454.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202228/04/20227.1387	Tasa Fija	258,417.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202202/05/20227.1387	Tasa Fija	76,185.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202228/04/20227.1387	Tasa Fija	1,011,585.80

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 66 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202204/05/20227.1387 Tasa Fija	139,921.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202209/05/20226.33 Tasa Fija	401,617.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202208/06/20226.33 Tasa Fija	15,063,300.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202209/05/20221.82986 Tasa Fija	57,143.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202202/05/20221.84629 Tasa Fija	2,400,433.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202230/05/20227.165 Tasa Fija	336,925.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202202/05/20227.165 Tasa Fija	56,188.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202206/05/20227.165 Tasa Fija	4,957,750.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202230/05/20227.165 Tasa Fija	14,474.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202204/05/20227.165 Tasa Fija	156,311.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202208/06/20227.165 Tasa Fija	252,537.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202206/05/20227.165 Tasa Fija	200,959.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202225/04/20227.165 Tasa Fija	6,750.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202202/05/20227.165 Tasa Fija	562,915.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202210/05/20227.165 Tasa Fija	23,793.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202219/07/20228.3342 Tasa Fija	96,150.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202208/08/20228.3342 Tasa Fija	242,833.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202206/05/20226.015 Tasa Fija	1,976,013.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202201/06/20227.165 Tasa Fija	814,827.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202217/06/20228.3342 Tasa Fija	322,424.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202201/04/20226.895 Tasa Fija	16,291.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202205/04/20226.895 Tasa Fija	10,729.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202203/06/20227.205 Tasa Fija	195,312.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202204/05/20227.205 Tasa Fija	469,347.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202223/05/20227.205 Tasa Fija	42,603.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202225/05/20227.205 Tasa Fija	10,341.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202210/06/20227.205 Tasa Fija	530,253.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202201/06/20227.205 Tasa Fija	789,510.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202205/08/20228.364 Tasa Fija	2,058,121.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202208/08/20228.364 Tasa Fija	876,722.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202225/05/20227.205 Tasa Fija	786,357.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202225/07/20228.364 Tasa Fija	654,356.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202209/05/20226.055 Tasa Fija	2,471,994.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202211/05/20227.205 Tasa Fija	105,110.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202208/09/20226.33 Tasa Fija	4,016,880.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202205/04/20226.3315 Tasa Fija	2,008,793.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija	81,296,702.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202210/06/20226.3375 Tasa Fija	1,185,252.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202230/12/20226.8265 Tasa Fija	4,001,517.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija	36,072,415.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija	14,591,440.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202201/04/20226.9037 Tasa Fija	52,515.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202203/06/20227.2287 Tasa Fija	412,742.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202229/04/20227.2287 Tasa Fija	69,453.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202229/04/20227.2287 Tasa Fija	23,776.49

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01

AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 67 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202230/05/20227.2287	Tasa Fija	124,271.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202204/05/20227.2287	Tasa Fija	178,552.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202206/06/20227.2287	Tasa Fija	252,459.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202210/05/20227.2287	Tasa Fija	186,426.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202210/05/20227.2287	Tasa Fija	479,975.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202209/08/20228.4097	Tasa Fija	65,223.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02		Tasa Fija	8,587,507.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02		Tasa Fija	72,709,194.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202201/04/20226.9037	Tasa Fija	381,093.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202219/04/20227.2287	Tasa Fija	50,059.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202206/06/20227.2287	Tasa Fija	629,188.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202208/06/20227.2287	Tasa Fija	454,427.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202210/05/20227.2287	Tasa Fija	51,428.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202201/06/20227.2287	Tasa Fija	593,274.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202223/05/20227.2287	Tasa Fija	20,791.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202204/05/20227.2287	Tasa Fija	164,604.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202210/08/20228.4097	Tasa Fija	51,211.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202226/07/20228.4097	Tasa Fija	406,741.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202204/08/20228.4097	Tasa Fija	3,179,782.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202204/08/20228.4097	Tasa Fija	1,244,414.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202209/08/20228.4097	Tasa Fija	65,655.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202214/03/20226.9037	Tasa Fija	25,290.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202201/04/20226.9037	Tasa Fija	313,933.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202206/04/20226.9037	Tasa Fija	74,437.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202211/04/20226.9037	Tasa Fija	686,440.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202212/05/20227.2287	Tasa Fija	199,140.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202206/06/20227.2287	Tasa Fija	2,260,706.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202225/04/20227.2287	Tasa Fija	98,815.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202213/04/20227.2287	Tasa Fija	10,295.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202206/06/20227.2287	Tasa Fija	1,270,658.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/02/202204/08/20228.4097	Tasa Fija	417,913.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/02/202204/04/20221.739	Tasa Fija	97,339.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202211/04/20226.3375		Tasa Fija	6,724,769.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202206/06/20227.605	Tasa Fija	282,839.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202210/06/20227.605	Tasa Fija	403,887.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202210/05/20227.605	Tasa Fija	65,962.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202210/05/20227.605	Tasa Fija	56,602.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202230/05/20227.605	Tasa Fija	28,812.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202204/08/20228.4282	Tasa Fija	985,272.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202208/04/20227.3512	Tasa Fija	927,246.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202204/04/20227.3512	Tasa Fija	64,088.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202219/04/20227.605	Tasa Fija	349,291.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202204/05/20227.605	Tasa Fija	70,246.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202201/06/20227.605	Tasa Fija	368,168.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202211/04/20227.3512	Tasa Fija	155,785.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202204/04/20227.3512	Tasa Fija	730,442.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202213/05/20227.605	Tasa Fija	215,050.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202204/05/20227.605	Tasa Fija	559,109.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202213/04/20226.3375		Tasa Fija	4,012,675.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/02/202225/04/20221.79486	Tasa Fija	1,169,353.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202214/06/20226.3375		Tasa Fija	1,480,902.79

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 68 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202206/06/20227.605 Tasa Fija 75,223.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202212/04/20226.3375
Tasa Fija 6,319,963.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202214/02/20236.3375
Tasa Fija 55,174,281.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202212/02/20276.3375
Tasa Fija 98,644,927.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202210/06/20227.6275 Tasa Fija 90,702.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202213/06/20227.6275 Tasa Fija 999,439.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202210/05/20227.6275 Tasa Fija 61,072.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202223/05/20227.6275 Tasa Fija 49,413.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202212/07/20228.546 Tasa Fija 136,147.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202202/08/20228.546 Tasa Fija 18,711.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202202/05/20227.6275 Tasa Fija 4,566.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202214/06/20227.6275 Tasa Fija 942,946.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202215/06/20226.3425
Tasa Fija 1,184,517.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202209/05/20221.79486 Tasa Fija 32,286.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202230/05/20222.06443 Tasa Fija 29,540.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202216/05/20226.3487
Tasa Fija 501,410.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202205/04/20227.3756 Tasa Fija 1,188,208.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202231/05/20227.6275 Tasa Fija 65,610.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202206/06/20227.6275 Tasa Fija 3,698.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202213/05/20226.4775
Tasa Fija 3,452,669.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202215/06/20226.3425
Tasa Fija 6,017,970.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202208/04/20227.3825 Tasa Fija 40,586.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202211/04/20227.3825 Tasa Fija 166,378.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202222/04/20227.6325 Tasa Fija 189,550.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202217/05/20227.6325 Tasa Fija 352,289.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202223/05/20227.6325 Tasa Fija 64,414.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202230/05/20222.19386 Tasa Fija 5,110.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202208/04/20227.3825 Tasa Fija 633,789.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202220/05/20227.6325 Tasa Fija 4,129,356.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202216/06/20227.6325 Tasa Fija 201,865.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202208/06/20227.6325 Tasa Fija 3,790,435.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202206/06/20227.6325 Tasa Fija 13,984.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202221/09/20226.8265
Tasa Fija 15,002,844.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202216/05/20227.6325 Tasa Fija 303,670.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202205/05/20227.6325 Tasa Fija 341,195.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202201/06/20227.6325 Tasa Fija 2,791,747.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202214/06/20227.6325 Tasa Fija 2,018,657.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202208/04/20226.3487
Tasa Fija 476,340.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202218/04/20221.86871 Tasa Fija 454,984.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202201/04/20227.3875 Tasa Fija 128,723.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202210/06/20227.6375 Tasa Fija 814,366.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202206/06/20227.6375 Tasa Fija 29,148.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202215/06/20227.6375 Tasa Fija 628,372.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202215/08/20228.5537 Tasa Fija 309,427.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202210/06/20227.6375 Tasa Fija 1,091,985.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/02/202208/04/20226.3523
Tasa Fija 428,631.50

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 69 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202210/05/20227.6375 Tasa Fija 6,353.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/02/202217/06/20226.3523
Tasa Fija 1,083,841.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202209/06/20227.6375 Tasa Fija 28,511.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202215/07/20228.5537 Tasa Fija 161,923.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202231/05/20227.6375 Tasa Fija 110,435.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202208/06/20227.6375 Tasa Fija 1,949,273.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202210/05/20227.6375 Tasa Fija 37,014.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202209/05/20227.6375 Tasa Fija 943,431.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202216/08/20228.5537 Tasa Fija 66,554.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/02/202222/04/20226.4875
Tasa Fija 2,479,118.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/02/202217/06/20226.3523
Tasa Fija 2,005,293.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202211/04/20227.3825 Tasa Fija 24,836.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202219/04/20227.3825 Tasa Fija 30,229.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202211/04/20227.3825 Tasa Fija 797,177.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202208/06/20227.63 Tasa Fija 93,527.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202215/06/20227.63 Tasa Fija 17,815,807.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202210/05/20227.63 Tasa Fija 545,012.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202225/05/20227.63 Tasa Fija 1,321,674.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202226/07/20228.5179 Tasa Fija 294,740.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202216/08/20228.5179 Tasa Fija 8,914.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202212/04/20227.3825 Tasa Fija 376,762.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202227/05/20227.63 Tasa Fija 332,056.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202216/05/20227.63 Tasa Fija 358,119.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202215/06/20227.63 Tasa Fija 2,405,877.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202225/05/20227.63 Tasa Fija 1,427,920.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202206/06/20227.63 Tasa Fija 73,078.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202216/08/20228.5179 Tasa Fija 22,082.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202211/08/20228.5179 Tasa Fija 2,659,007.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202211/08/20228.5179 Tasa Fija 781,846.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202217/06/20226.3523
Tasa Fija 1,083,841.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202219/05/20227.63 Tasa Fija 20,188.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202213/06/20227.63 Tasa Fija 1,595,381.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202215/06/20227.63 Tasa Fija 88,797.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202212/05/20227.63 Tasa Fija 849,683.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202217/06/20227.63 Tasa Fija 238,307.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202225/05/20227.63 Tasa Fija 616.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202218/05/20227.63 Tasa Fija 208,163.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202221/07/20228.5179 Tasa Fija 1,270,061.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202211/08/20228.5179 Tasa Fija 3,395,245.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202216/05/20226.48 Tasa
Fija 1,774,249.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202217/06/20226.3523
Tasa Fija 1,002,646.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202217/02/20276.3523
Tasa Fija 38,542,823.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202218/04/20226.36 Tasa
Fija 5,012,366.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202219/05/20226.3625
Tasa Fija 450,795.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202217/06/20226.3523
Tasa Fija 1,002,646.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202208/04/20227.3775 Tasa Fija 145,043.84

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 70 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202218/04/20227.3775	Tasa Fija	224,230.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202212/04/20227.3775	Tasa Fija	2,215,749.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202217/06/20227.6225	Tasa Fija	265,678.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202217/05/20227.6225	Tasa Fija	40,442.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202206/06/20227.6225	Tasa Fija	85,259.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	1,872,300.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202229/04/20227.6225	Tasa Fija	103,956.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202222/07/20228.5309	Tasa Fija	585,807.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202216/08/20228.5309	Tasa Fija	9,093.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202216/08/20228.5309	Tasa Fija	15,048.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202216/08/20228.5309	Tasa Fija	6,718.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/02/202221/06/20226.3625		Tasa Fija	1,087,653.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/02/202221/06/20226.3625		Tasa Fija	1,064,760.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/02/202221/06/20226.3625		Tasa Fija	3,005,302.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/02/202220/12/20287.4		Tasa Fija	33,294,102.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/02/202219/04/20226.3625		Tasa Fija	5,008,836.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202220/05/20227.6225	Tasa Fija	74,303.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	151,522.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202215/06/20227.6225	Tasa Fija	503,015.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202212/05/20227.6225	Tasa Fija	673,875.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202214/06/20227.6225	Tasa Fija	4,838,628.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	21,344.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202210/08/20228.5309	Tasa Fija	62,329.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202217/08/20228.5309	Tasa Fija	144,614.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202226/07/20228.5309	Tasa Fija	9,398.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	1,460.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202202/05/20221.87957	Tasa Fija	342,538.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202218/04/20227.375	Tasa Fija	492,311.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202213/04/20227.375	Tasa Fija	179,119.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202222/04/20227.375	Tasa Fija	1,988,640.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202220/05/20227.6225	Tasa Fija	202,294.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202223/05/20227.6225	Tasa Fija	257,096.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202215/06/20227.6225	Tasa Fija	1,445,610.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202225/05/20227.6225	Tasa Fija	4,105.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	7,300.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202215/06/20227.6225	Tasa Fija	203,597.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202215/08/20228.5787	Tasa Fija	840,245.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202209/08/20228.5787	Tasa Fija	105,967.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202218/04/20227.375	Tasa Fija	1,298,596.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202213/04/20227.375	Tasa Fija	166,373.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	133,067.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202217/05/20227.6225	Tasa Fija	124,356.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202221/06/20227.6225	Tasa Fija	449,673.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202204/05/20227.6225	Tasa Fija	40,717.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	384,319.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/02/202223/05/20226.375		Tasa Fija	500,796.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202225/04/20221.87957	Tasa Fija	270,216.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202212/04/20227.375	Tasa Fija	429,215.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202205/04/20227.375	Tasa Fija	70,916.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	29,835.59

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01

AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 71 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202215/06/20227.6225	Tasa Fija	854,392.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202217/05/20227.6225	Tasa Fija	873,775.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202215/06/20227.6225	Tasa Fija	82,056.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202219/08/20228.5787	Tasa Fija	93,337.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/02/202222/06/20226.3625	Tasa Fija	2,003,534.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/02/202220/04/20226.3625	Tasa Fija	5,008,836.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202219/04/20227.375	Tasa Fija	71,728.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202211/04/20227.375	Tasa Fija	199,522.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202215/06/20227.6225	Tasa Fija	576,130.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202222/06/20227.6225	Tasa Fija	927,732.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202225/05/20227.6225	Tasa Fija	1,019.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202215/06/20227.6225	Tasa Fija	4,637,489.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202219/08/20228.5787	Tasa Fija	125,093.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202202/05/20221.86386	Tasa Fija	56,408.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202218/04/20227.375	Tasa Fija	71,688.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	940,091.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202225/05/20227.6225	Tasa Fija	17,825.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202215/06/20227.6225	Tasa Fija	59,042.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	75,091.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/02/202219/09/20226.8265	Tasa Fija	15,002,844.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202219/04/20227.375	Tasa Fija	1,177,486.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202215/06/20227.6225	Tasa Fija	2,928,654.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202230/05/20227.6225	Tasa Fija	4,645.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/02/202224/05/20226.3825	Tasa Fija	100,053.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	23,567.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202213/06/20227.6225	Tasa Fija	22,292.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/02/202221/04/20226.375	Tasa Fija	5,007,968.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/02/202208/04/20226.375	Tasa Fija	380,605.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202225/04/20221.88786	Tasa Fija	132,078.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202211/04/20227.371	Tasa Fija	324,238.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202211/04/20227.371	Tasa Fija	16,758.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202220/04/20227.371	Tasa Fija	1,057,888.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202218/04/20227.371	Tasa Fija	1,376,089.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202217/06/20227.615	Tasa Fija	2,758,982.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202210/05/20227.615	Tasa Fija	109,977.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202223/05/20227.615	Tasa Fija	198,863.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202213/06/20227.615	Tasa Fija	442,565.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202215/06/20227.615	Tasa Fija	31,218.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202215/06/20227.615	Tasa Fija	750,922.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202209/08/20228.5802	Tasa Fija	5,565.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202216/05/20227.615	Tasa Fija	62,895.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202210/05/20227.615	Tasa Fija	564,402.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202215/06/20227.615	Tasa Fija	476,759.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202212/07/20228.5802	Tasa Fija	23,215.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202223/08/20228.5802	Tasa Fija	30,396.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202220/04/20227.371	Tasa Fija	1,255,397.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202211/04/20227.371	Tasa Fija	73,037.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202213/05/20227.615	Tasa Fija	85,242.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202203/05/20227.615	Tasa Fija	132,447.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202215/06/20227.615	Tasa Fija	266,651.31

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 72 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202215/06/20227.615 Tasa Fija 158,619.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/02/202208/04/20226.3825
Tasa Fija 570,808.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/02/202224/06/20226.3825
Tasa Fija 1,001,418.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202201/04/20227.371 Tasa Fija 789,732.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202206/05/20227.615 Tasa Fija 920,736.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202215/06/20227.615 Tasa Fija 352,063.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202223/08/20228.5802 Tasa Fija 240,460.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202223/08/20228.5802 Tasa Fija 31,965.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/02/202205/05/20226.3315
Tasa Fija 18,430,682.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/02/202225/05/20226.3912
Tasa Fija 233,220.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202225/04/20221.89757 Tasa Fija 323,186.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202225/04/20227.378 Tasa Fija 294,688.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202225/04/20227.378 Tasa Fija 40,196.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202223/06/20227.6325 Tasa Fija 655,445.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202215/06/20227.6325 Tasa Fija 234,243.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202219/05/20227.6325 Tasa Fija 860,970.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202225/05/20227.6325 Tasa Fija 808,265.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202215/06/20227.6325 Tasa Fija 855,693.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202212/05/20227.6325 Tasa Fija 996,763.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202216/08/20228.5764 Tasa Fija 2,063.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202223/08/20228.5764 Tasa Fija 157,678.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202220/04/20227.378 Tasa Fija 20,127.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202225/04/20227.378 Tasa Fija 183,628.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202224/06/20227.6325 Tasa Fija 371,229.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202215/06/20227.6325 Tasa Fija 5,621.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202206/06/20227.6325 Tasa Fija 48,983.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202212/05/20227.6325 Tasa Fija 127,028.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202216/08/20228.5764 Tasa Fija 1,163,695.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202208/04/20226.3912
Tasa Fija 475,590.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202226/05/20226.8175
Tasa Fija 300,227.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202209/05/20226.33 Tasa
Fija 12,525,450.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202220/04/20227.378 Tasa Fija 992,580.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202226/05/20227.6325 Tasa Fija 191,409.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202220/06/20227.6325 Tasa Fija 44,764.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202218/05/20227.6325 Tasa Fija 209,009.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202225/05/20227.6325 Tasa Fija 259,770.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202218/05/20227.6325 Tasa Fija 189,877.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202224/08/20228.5764 Tasa Fija 71,851.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202218/08/20228.5764 Tasa Fija 2,082,324.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202218/08/20228.5764 Tasa Fija 2,029,770.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202226/05/20226.8175
Tasa Fija 200,151.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202220/06/20227.6325 Tasa Fija 2,457,707.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202225/04/20227.378 Tasa Fija 310,231.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202220/06/20227.6325 Tasa Fija 2,801,467.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202216/01/20236.3487
Tasa Fija 10,028,216.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202226/01/20236.8175
Tasa Fija 15,011,362.50

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 73 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202231/01/20236.8265
Tasa Fija 15,002,844.38

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202220/02/20236.3625
Tasa Fija 2,003,534.72

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202205/04/20221.90786 Tasa Fija 93,478.62

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202213/06/20222.20443 Tasa Fija 198,338.73

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202218/03/20227.384 Tasa Fija 185,223.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202228/03/20227.384 Tasa Fija 36,513.84

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202210/06/20227.665 Tasa Fija 658,857.44

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202225/05/20227.665 Tasa Fija 229,020.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202223/05/20227.665 Tasa Fija 1,837,474.75

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202222/06/20227.665 Tasa Fija 68,413.58

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202224/05/20227.665 Tasa Fija 599,302.41

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202228/06/20227.665 Tasa Fija 4,027,253.67

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202216/06/20227.665 Tasa Fija 574,560.10

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202208/07/20228.5997 Tasa Fija 101,853.93

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202224/08/20228.5997 Tasa Fija 159,501.21

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202218/08/20228.5997 Tasa Fija 651,837.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202223/08/20228.5997 Tasa Fija 26,820.98

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/02/202208/04/20226.8175
Tasa Fija 541,910.19

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202211/04/20227.384 Tasa Fija 185,701.06

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202225/04/20227.384 Tasa Fija 13,203.34

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202221/04/20227.384 Tasa Fija 1,138,765.51

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202225/04/20227.384 Tasa Fija 46,203.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202220/06/20227.665 Tasa Fija 971,270.43

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202215/06/20227.665 Tasa Fija 52,154.59

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202223/05/20227.665 Tasa Fija 1,070,135.51

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202220/06/20227.665 Tasa Fija 16,384.06

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/02/202227/05/20226.8175
Tasa Fija 1,901,439.25

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202224/05/20227.665 Tasa Fija 981,337.56

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/02/202220/04/20226.3625
Tasa Fija 9,191,215.54

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/02/202226/08/20226.8175
Tasa Fija 5,003,787.50

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/02/202226/08/20226.8175
Tasa Fija 6,004,545.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202230/05/20227.1387 Tasa Fija 9,873.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202225/04/20227.1235 Tasa Fija 667,579.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202225/04/20227.1225 Tasa Fija 706,577.48

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202225/04/20227.1252 Tasa Fija 13,660.89

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202207/06/20228.0626 Tasa Fija 31,750.21

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202231/05/20228.1334 Tasa Fija 1,364.31

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202229/04/20227.3867 Tasa Fija 8,599,987.76

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202213/05/20227.6615 Tasa Fija 4,848,950.47

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202217/06/20227.6615 Tasa Fija 213,575.09

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202222/06/20227.6615 Tasa Fija 1,909,561.84

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202225/05/20227.6615 Tasa Fija 125,431.67

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202225/05/20227.6615 Tasa Fija 255,497.25

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202226/08/20228.634 Tasa Fija 1,282,515.82

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202220/06/20222.22871 Tasa Fija 28,538.76

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202215/06/20227.6615 Tasa Fija 835,766.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202225/05/20227.6615 Tasa Fija 44,472.25

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202211/05/20227.6615 Tasa Fija 3,037,972.61

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/03/202230/05/20226.8265

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 74 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Fija 582,220.72	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202207/04/20227.3867	Tasa Fija 206,944.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202211/04/20227.3867	Tasa Fija 16,744.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202217/06/20227.6615	Tasa Fija 196,575.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202215/06/20227.6615	Tasa Fija 124,192.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202205/05/20227.6615	Tasa Fija 807,538.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202203/06/20227.6615	Tasa Fija 970,033.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202225/05/20227.6615	Tasa Fija 11,988.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202213/06/20227.6615	Tasa Fija 5,649.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/03/202229/06/20226.8237	
Tasa Fija 3,001,705.93	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/03/202230/05/20226.8265	
Tasa Fija 12,004,551.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/03/202230/05/20226.8265	
Tasa Fija 450,170.66	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202223/05/20221.944	Tasa Fija 101,643.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202225/04/20221.71057	Tasa Fija 412,611.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202223/05/20221.92314	Tasa Fija 299,248.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/03/202230/05/20226.8265	
Tasa Fija 15,005,688.75	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202205/04/20221.90429	Tasa Fija 1,097,875.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202220/06/20222.20471	Tasa Fija 3,646.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202225/04/20227.3895	Tasa Fija 545,328.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202223/05/20227.6682	Tasa Fija 57,086.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202222/06/20227.6682	Tasa Fija 29,530.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202225/05/20227.6682	Tasa Fija 17,274.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202223/05/20227.6682	Tasa Fija 988,827.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202222/04/20227.3895	Tasa Fija 869,085.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202225/05/20227.6682	Tasa Fija 160,938.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202222/06/20227.6682	Tasa Fija 6,798,356.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202228/04/20227.3895	Tasa Fija 779,704.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202227/05/20227.6682	Tasa Fija 43,155.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202220/06/20227.6682	Tasa Fija 16,022.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202215/06/20227.6682	Tasa Fija 102,056.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202204/05/20227.6682	Tasa Fija 809,908.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202222/06/20227.6682	Tasa Fija 1,803,742.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202220/06/20227.6682	Tasa Fija 7,893.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202229/08/20226.8237	
Tasa Fija 10,005,686.42	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202225/05/20227.6682	Tasa Fija 35,629.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202224/05/20226.5182	
Tasa Fija 984,527.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202229/08/20226.8237	
Tasa Fija 8,004,549.13	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202228/06/20227.705	Tasa Fija 560,726.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202231/05/20227.705	Tasa Fija 43,065.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202229/06/20227.705	Tasa Fija 301,273.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202225/05/20227.705	Tasa Fija 55,176.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202227/05/20226.555	Tasa Fija 1,672,438.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202229/04/20227.391	Tasa Fija 30,247.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202220/05/20227.705	Tasa Fija 9,662.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202225/08/20228.6173	Tasa Fija 1,846,746.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202201/06/20226.341	Tasa Fija 10,051,080.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202222/04/20227.391	Tasa Fija 87,588.91

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 75 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202225/04/20227.391	Tasa Fija	946,045.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202205/04/20227.391	Tasa Fija	88,939.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202201/06/20227.705	Tasa Fija	40,442.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202230/05/20227.705	Tasa Fija	92,360.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202225/05/20227.705	Tasa Fija	204,320.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202225/05/20227.705	Tasa Fija	722,730.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202225/05/20227.705	Tasa Fija	392,942.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202222/06/20227.705	Tasa Fija	1,496,031.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202226/08/20228.6173	Tasa Fija	996,872.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202225/08/20228.6173	Tasa Fija	146,485.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202225/08/20228.6173	Tasa Fija	2,467,409.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/03/202223/08/20228.6173	Tasa Fija	5,901.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202201/06/20226.555	Tasa Fija	982,523.35	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202225/04/20227.3862	Tasa Fija	237,962.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202224/06/20227.6937	Tasa Fija	124,681.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202220/06/20227.6937	Tasa Fija	249,306.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202210/06/20227.6937	Tasa Fija	115,723.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202222/06/20227.6937	Tasa Fija	70,325.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202215/07/20228.6437	Tasa Fija	131,038.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202225/08/20228.6437	Tasa Fija	899,921.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202230/08/20228.6437	Tasa Fija	287,140.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202230/08/20228.6437	Tasa Fija	41,723.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202210/05/20221.92214	Tasa Fija	558,488.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202202/05/20221.92214	Tasa Fija	609,531.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202202/06/20226.3362	Tasa Fija	502,464.08	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202229/04/20227.3862	Tasa Fija	14,444.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202227/05/20227.6937	Tasa Fija	172,447.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202229/06/20227.6937	Tasa Fija	148,751.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202222/06/20227.6937	Tasa Fija	68,231.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202225/08/20228.6437	Tasa Fija	517,132.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202226/04/20227.3862	Tasa Fija	245,690.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202217/06/20227.6937	Tasa Fija	140,330.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202227/06/20227.6937	Tasa Fija	217,124.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202202/06/20226.5437	Tasa Fija	1,473,547.84	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202222/04/20227.3862	Tasa Fija	127,801.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202202/05/20227.3862	Tasa Fija	556,464.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202220/05/20227.6937	Tasa Fija	1,963,051.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202227/06/20227.6937	Tasa Fija	3,219,983.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202201/07/20227.6937	Tasa Fija	304,813.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202222/06/20227.6937	Tasa Fija	189,170.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202227/06/20227.6937	Tasa Fija	4,430,696.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202231/08/20228.6437	Tasa Fija	259,621.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202230/08/20228.6437	Tasa Fija	27,900.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202218/08/20228.6437	Tasa Fija	1,511,015.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202231/08/20226.8265	Tasa Fija	8,001,517.00	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202216/05/20221.98314	Tasa Fija	345,017.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/02/202209/05/20221.90786	Tasa Fija	562,263.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/03/202209/05/20221.923	Tasa Fija	659,039.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202211/04/20227.3815	Tasa Fija	111,029.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202204/04/20227.3815	Tasa Fija	20,219.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202209/05/20227.686	Tasa Fija	447,797.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202224/06/20227.686	Tasa Fija	30,694.23

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 76 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202230/05/20227.686	Tasa Fija	867,003.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202227/06/20227.686	Tasa Fija	33,588.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202206/06/20227.686	Tasa Fija	4,918,741.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202231/08/20228.6786	Tasa Fija	100,602.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202201/06/20227.686	Tasa Fija	40,601.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202227/06/20227.686	Tasa Fija	11,945.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202229/06/20227.686	Tasa Fija	890,267.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202208/06/20227.686	Tasa Fija	99,678.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202227/06/20227.686	Tasa Fija	9,548.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202202/06/20227.686	Tasa Fija	1,969,021.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202212/04/20227.3815	Tasa Fija	54,559.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202208/04/20227.3815	Tasa Fija	37,319.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202227/06/20227.686	Tasa Fija	34,039.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202230/05/20227.686	Tasa Fija	2,725,076.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202210/06/20227.686	Tasa Fija	116,808.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202225/05/20227.686	Tasa Fija	384,052.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/03/202229/08/20228.6786	Tasa Fija	382,866.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/03/202206/05/20226.3315		Tasa Fija	2,008,793.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/03/202202/09/20226.3315		Tasa Fija	20,087,937.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/03/202228/02/20236.536		Tasa Fija	1,506,808.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/03/202209/05/20221.92214	Tasa Fija	129,074.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/02/202214/03/20221.70271	Tasa Fija	22,811.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202225/04/20227.38	Tasa Fija	26,416.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202226/04/20227.38	Tasa Fija	903,311.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202208/04/20227.38	Tasa Fija	276,795.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202210/06/20227.6825	Tasa Fija	79,646.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202210/06/20227.6825	Tasa Fija	110,549.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202227/06/20227.6825	Tasa Fija	201,561.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202202/09/20228.7265	Tasa Fija	1,039,146.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202223/08/20228.7265	Tasa Fija	19,927.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202216/05/20222.01014	Tasa Fija	59,566.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202229/04/20227.38	Tasa Fija	1,283,361.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202227/06/20227.6825	Tasa Fija	142,857.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202210/05/20227.6825	Tasa Fija	3,766,225.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/03/202202/09/20226.33		Tasa Fija	5,021,100.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/03/202206/06/20226.33		Tasa Fija	502,110.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202203/06/20227.6825	Tasa Fija	179,338.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202215/06/20227.6825	Tasa Fija	48,747.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202210/06/20227.6825	Tasa Fija	16,630.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/03/202216/08/20228.7265	Tasa Fija	76,114.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/03/202206/06/20226.5325		Tasa Fija	981,675.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/03/202202/09/20226.33		Tasa Fija	3,012,660.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/03/202222/04/20227.38	Tasa Fija	2,187,326.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/03/202202/05/20227.38	Tasa Fija	5,868.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/03/202211/04/20227.38	Tasa Fija	33,511.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/03/202205/07/20227.6805	Tasa Fija	201,031.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/03/202227/06/20227.6805	Tasa Fija	3,258.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/03/202201/06/20227.6805	Tasa Fija	1,207,364.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/03/202205/07/20227.6805	Tasa Fija	1,235,030.63

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01

AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 77 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202225/04/20227.38	Tasa Fija	12,719.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202202/05/20227.38	Tasa Fija	293,556.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202227/06/20227.6805	Tasa Fija	395,073.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202227/06/20227.6805	Tasa Fija	87,817.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202214/06/20227.6805	Tasa Fija	555,063.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202207/06/20226.5305	Tasa Fija	981,501.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202207/06/20226.33	Tasa Fija	25,004.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202202/05/20227.38	Tasa Fija	523,901.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202212/04/20227.38	Tasa Fija	37,348.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202225/04/20227.38	Tasa Fija	4,719.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202229/06/20227.6805	Tasa Fija	4,698,746.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202205/09/20228.7962	Tasa Fija	498,729.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202207/06/20226.5305	Tasa Fija	1,472,252.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202208/04/20226.33	Tasa Fija	414,921.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202204/04/20221.72114	Tasa Fija	46,832.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202216/05/20222.103	Tasa Fija	357,928.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202229/04/20227.385	Tasa Fija	45,824.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202224/06/20227.685	Tasa Fija	996,346.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202207/06/20227.685	Tasa Fija	36,356.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202206/07/20227.685	Tasa Fija	2,404,371.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202210/06/20227.685	Tasa Fija	34,682.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202210/06/20227.685	Tasa Fija	203,221.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202230/05/20227.685	Tasa Fija	319,546.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202208/06/20227.685	Tasa Fija	2,067,661.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202206/09/20226.335	Tasa Fija	5,019,356.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202225/04/20227.385	Tasa Fija	73,948.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202203/05/20227.385	Tasa Fija	382,097.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202209/06/20227.685	Tasa Fija	145,651.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202206/09/20228.8791	Tasa Fija	130,852.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202208/04/20226.335	Tasa Fija	476,838.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202203/05/20227.385	Tasa Fija	309,004.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202208/07/20227.685	Tasa Fija	718,497.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202208/07/20227.685	Tasa Fija	301,408.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202210/06/20227.685	Tasa Fija	666,203.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202223/08/20228.8791	Tasa Fija	301,692.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202209/12/20226.335	Tasa Fija	8,599,162.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202205/04/20221.75171	Tasa Fija	2,275,550.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202216/05/20222.145	Tasa Fija	61,915.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202226/04/20222.145	Tasa Fija	2,325,300.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202210/05/20227.3875	Tasa Fija	130,036.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202204/05/20227.3875	Tasa Fija	121,860.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202217/05/20227.7225	Tasa Fija	681,749.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202230/05/20227.7225	Tasa Fija	301,477.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/07/20227.7225	Tasa Fija	1,518,463.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202202/06/20227.7225	Tasa Fija	528,681.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202210/06/20227.7225	Tasa Fija	118,871.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/07/20227.7225	Tasa Fija	2,453.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202209/05/20227.3875	Tasa Fija	6,317,627.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202204/07/20227.7225	Tasa Fija	1,421,638.50

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 78 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/07/20227.7225	Tasa Fija	1,184,727.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202205/07/20227.7225	Tasa Fija	276,238.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202201/09/20228.8565	Tasa Fija	1,556,677.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202201/09/20228.8565	Tasa Fija	1,283,663.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202220/02/20236.3625	Tasa Fija	4,007,069.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202209/06/20226.3375	Tasa Fija	451,663.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202208/07/20226.3375	Tasa Fija	1,003,696.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202208/04/20226.3375	Tasa Fija	429,080.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202211/04/20227.3875	Tasa Fija	28,989.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202204/05/20227.3875	Tasa Fija	1,869,611.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202209/05/20227.3875	Tasa Fija	1,415,640.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202204/07/20227.7225	Tasa Fija	1,543,282.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/06/20227.7225	Tasa Fija	237,787.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202210/06/20227.7225	Tasa Fija	11,839.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202204/07/20227.7225	Tasa Fija	971,824.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/07/20227.7225	Tasa Fija	27,177.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202201/09/20228.8565	Tasa Fija	487,210.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202225/04/20227.3875	Tasa Fija	412,931.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202219/04/20227.3875	Tasa Fija	31,513.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202213/05/20227.7225	Tasa Fija	1,047,744.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202208/06/20227.7225	Tasa Fija	38,814.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/06/20227.7225	Tasa Fija	477,699.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202205/07/20227.7225	Tasa Fija	6,806.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202201/09/20228.8565	Tasa Fija	1,434,706.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202208/04/20227.3875	Tasa Fija	2,249,935.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202213/01/20236.3375	Tasa Fija	3,251,977.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202206/09/20226.3375	Tasa Fija	20,073,937.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202218/04/20227.3875	Tasa Fija	46,284.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202228/03/20227.3875	Tasa Fija	104,806.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202225/04/20227.3875	Tasa Fija	168,080.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202201/07/20227.7075	Tasa Fija	1,423,356.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202225/05/20227.7075	Tasa Fija	25,302.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202204/07/20227.7075	Tasa Fija	326,582.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202210/06/20227.7075	Tasa Fija	424,214.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202206/09/20228.906	Tasa Fija	170,629.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202206/09/20228.906	Tasa Fija	30,046.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202206/09/20228.906	Tasa Fija	9,901.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202229/04/20227.3875	Tasa Fija	177,276.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202202/06/20227.7075	Tasa Fija	303,044.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202215/06/20227.7075	Tasa Fija	5,509.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202201/09/20228.906	Tasa Fija	1,223,852.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202206/09/20228.906	Tasa Fija	709,504.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202206/05/20227.3875	Tasa Fija	986,626.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202210/06/20227.7075	Tasa Fija	199,939.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202207/06/20227.7075	Tasa Fija	115,510.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202229/06/20227.7075	Tasa Fija	74,019.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202208/04/20226.3375	Tasa Fija	462,210.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202209/09/20228.906	Tasa Fija	126,956.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202209/09/20226.3375		

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 79 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Fija 5,015,843.75	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202219/04/20227.3925	Tasa Fija 126,655.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202206/07/20227.7412	Tasa Fija 36,978.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202207/06/20227.7412	Tasa Fija 407,623.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202222/06/20227.7412	Tasa Fija 279,282.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202205/05/20227.3925	Tasa Fija 498,549.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202207/06/20227.7412	Tasa Fija 195,014.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202209/09/20228.9277	Tasa Fija 5,417.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202211/04/20227.3925	Tasa Fija 92,514.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202224/06/20227.7412	Tasa Fija 268,530.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202208/06/20227.7412	Tasa Fija 20,347.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202227/06/20227.7412	Tasa Fija 210,478.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202215/06/20227.7412	Tasa Fija 449,856.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202209/09/20228.9277	Tasa Fija 164,535.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202219/08/20228.9277	Tasa Fija 11,442.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202206/09/20228.9277	Tasa Fija 122,593.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202207/06/20227.7412	Tasa Fija 157,571.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202215/06/20227.7412	Tasa Fija 681,023.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/03/202213/06/20226.3425	
Tasa Fija 451,347.78	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/03/202210/06/20226.5912	
Tasa Fija 1,471,610.60	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202212/07/20227.7412	Tasa Fija 2,007,311.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/03/202220/02/20236.3625	
Tasa Fija 1,001,767.36	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/03/202228/02/20236.5912	
Tasa Fija 1,003,112.51	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/03/202209/12/20226.3425	
Tasa Fija 2,005,990.48	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202206/05/20227.3987	Tasa Fija 257,426.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202210/05/20227.3987	Tasa Fija 104,687.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202201/07/20227.761	Tasa Fija 1,147,859.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202226/05/20227.761	Tasa Fija 319,889.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202206/07/20227.761	Tasa Fija 6,717,911.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202213/06/20227.761	Tasa Fija 172,185.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202220/05/20222.28471	Tasa Fija 5,107.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202209/05/20222.28471	Tasa Fija 107,708.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202210/05/20227.3987	Tasa Fija 1,504,326.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202225/05/20227.761	Tasa Fija 3,676.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202229/07/20228.9798	Tasa Fija 93,878.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202216/08/20228.9798	Tasa Fija 92,238.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202218/04/20227.3987	Tasa Fija 19,342.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202225/04/20227.3987	Tasa Fija 6,909.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202204/07/20227.761	Tasa Fija 32,533.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202208/06/20227.761	Tasa Fija 153,326.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202204/07/20227.761	Tasa Fija 16,276.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202215/06/20227.761	Tasa Fija 106,190.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202208/06/20227.761	Tasa Fija 546,188.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/03/202212/10/20226.3487	
Tasa Fija 10,028,216.44	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/03/202212/09/20226.3487	
Tasa Fija 5,014,108.22	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/03/202214/07/20226.3487	
Tasa Fija 1,002,821.64	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/03/202212/09/20226.8265	
Tasa Fija 40,007,585.00	

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01

AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 80 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202211/04/20227.4023	Tasa Fija	79,456.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202213/07/20227.7641	Tasa Fija	135,192.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202208/06/20227.7641	Tasa Fija	4,269.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202214/06/20227.7641	Tasa Fija	79,265.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202204/07/20227.7641	Tasa Fija	143,267.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202222/06/20227.7641	Tasa Fija	29,890.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202214/07/20227.7641	Tasa Fija	611,973.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202210/06/20227.7641	Tasa Fija	24,889.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202222/06/20227.7641	Tasa Fija	49,969.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202216/08/20228.9767	Tasa Fija	65,799.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202211/04/20221.84143	Tasa Fija	125,626.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202218/04/20222.31643	Tasa Fija	49,449.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202209/05/20227.4023	Tasa Fija	5,725.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202211/05/20227.4023	Tasa Fija	936,171.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202215/07/20227.7641	Tasa Fija	15,167.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202213/06/20227.7641	Tasa Fija	188,608.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202204/07/20227.7641	Tasa Fija	78,473.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202204/07/20227.7641	Tasa Fija	24,997.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202222/08/20228.9767	Tasa Fija	796,461.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/03/202215/07/20226.3523		Tasa Fija	601,588.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202210/06/20227.7641	Tasa Fija	347,856.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202225/05/20227.7641	Tasa Fija	6,851.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202212/09/20228.9767	Tasa Fija	172,645.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/03/202222/04/20227.4023	Tasa Fija	6,697.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/03/202213/10/20226.3523		Tasa Fija	7,018,527.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/03/202213/10/20226.3523		Tasa Fija	3,007,940.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/03/202209/09/20226.3523		Tasa Fija	20,052,935.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/03/202213/09/20226.8265		Tasa Fija	25,004,740.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/03/202210/05/20226.3523		Tasa Fija	5,013,233.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202211/04/20221.86757	Tasa Fija	189,849.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202216/05/20222.34814	Tasa Fija	493,110.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202210/05/20227.41	Tasa Fija	222,480.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202208/07/20227.8025	Tasa Fija	33,619.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202213/07/20227.8025	Tasa Fija	106,765.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202213/06/20227.8025	Tasa Fija	100,965.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202215/07/20227.8025	Tasa Fija	275,834.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202210/06/20227.8025	Tasa Fija	158,974.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202227/06/20227.8025	Tasa Fija	91,834.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202213/09/20228.9716	Tasa Fija	71,294.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202208/09/20228.9716	Tasa Fija	915,963.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202208/09/20228.9716	Tasa Fija	3,007,661.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202229/04/20227.41	Tasa Fija	140,122.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202207/04/20227.41	Tasa Fija	350,563.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202216/05/20227.41	Tasa Fija	317,325.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202227/05/20227.8025	Tasa Fija	95,225.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202213/07/20227.8025	Tasa Fija	278,694.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202211/07/20227.8025	Tasa Fija	250,827.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202209/06/20227.8025	Tasa Fija	316,529.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202207/07/20227.8025	Tasa Fija	443,949.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/03/202213/09/20228.9716	Tasa Fija	140,428.71

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 81 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202208/09/20228.9716 Tasa Fija 258,540.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/03/202214/09/20226.36 Tasa Fija 5,012,366.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/03/202215/07/20226.36 Tasa Fija 1,002,473.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/03/202216/06/20226.36 Tasa Fija 501,236.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202212/05/20227.41 Tasa Fija 756,345.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202225/04/20227.41 Tasa Fija 4,968,324.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202211/07/20227.8025 Tasa Fija 1,189.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202211/07/20227.8025 Tasa Fija 35,979.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202213/09/20228.9716 Tasa Fija 9,809.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202214/09/20228.9716 Tasa Fija 200,697.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/03/202215/06/20226.6525 Tasa Fija 1,960,312.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/03/202212/05/20226.36 Tasa Fija 5,012,366.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/03/202214/09/20226.8265 Tasa Fija 25,004,740.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202201/04/20227.4125 Tasa Fija 79,995.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202210/05/20227.4125 Tasa Fija 26,233.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202218/04/20227.4125 Tasa Fija 44,444.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202204/05/20227.4125 Tasa Fija 199,489.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202216/05/20227.4125 Tasa Fija 457,112.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202201/07/20227.805 Tasa Fija 1,022,784.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202213/07/20227.805 Tasa Fija 185,182.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202213/06/20227.805 Tasa Fija 2,374,295.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202208/06/20227.805 Tasa Fija 470,529.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202220/06/20227.805 Tasa Fija 96,132.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202211/07/20227.805 Tasa Fija 1,961,304.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202213/05/20227.4125 Tasa Fija 988,665.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202211/07/20227.805 Tasa Fija 1,268,865.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202210/06/20227.805 Tasa Fija 61,654.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202211/07/20227.805 Tasa Fija 470,259.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202216/05/20227.4125 Tasa Fija 364,717.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202213/05/20227.4125 Tasa Fija 79,590.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202222/04/20227.4125 Tasa Fija 426,877.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202213/04/20227.4125 Tasa Fija 727,964.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202204/07/20227.805 Tasa Fija 184,540.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202206/07/20227.805 Tasa Fija 139,932.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202215/09/20226.3625 Tasa Fija 5,008,836.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202220/06/20226.3625 Tasa Fija 500,883.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202215/09/20228.9365 Tasa Fija 180,392.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202214/09/20226.3625 Tasa Fija 20,035,347.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202216/05/20226.3625 Tasa Fija 5,008,836.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202220/07/20226.3625 Tasa Fija 4,007,069.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202230/05/20222.35757 Tasa Fija 374,412.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202226/04/20227.425 Tasa Fija 17,218.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202208/07/20227.845 Tasa Fija 97,230.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202211/07/20227.845 Tasa Fija 11,809.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202220/07/20227.845 Tasa Fija 987,219.60

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 82 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202213/07/20227.845	Tasa Fija	5,602,244.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202228/06/20227.845	Tasa Fija	1,228,957.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202209/09/20229.0675	Tasa Fija	2,213,539.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202208/09/20229.0675	Tasa Fija	1,314,368.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202219/05/20227.425	Tasa Fija	10,333.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202204/05/20227.425	Tasa Fija	34,842.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202204/05/20227.425	Tasa Fija	62,326.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202215/06/20227.845	Tasa Fija	81,784.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202213/06/20227.845	Tasa Fija	4,729.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202205/07/20227.845	Tasa Fija	28,461.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202227/06/20227.845	Tasa Fija	15,431.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202215/09/20229.0675	Tasa Fija	370,843.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202226/08/20229.0675	Tasa Fija	11,023.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202208/09/20229.0675	Tasa Fija	1,256,781.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202219/09/20226.375	Tasa Fija	5,007,968.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202221/07/20226.375	Tasa Fija	1,001,593.75	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202208/07/20227.845	Tasa Fija	77,800.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202220/07/20227.845	Tasa Fija	46,768.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202212/09/20229.0675	Tasa Fija	1,013,688.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/03/202219/09/20229.0675	Tasa Fija	611,382.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202220/05/20226.375	Tasa Fija	5,007,968.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202221/07/20226.375	Tasa Fija	4,006,375.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202213/01/20236.375	Tasa Fija	1,983,155.63	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202226/04/20227.4325	Tasa Fija	7,245.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202218/04/20227.4325	Tasa Fija	204,372.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202216/06/20227.845	Tasa Fija	10,025.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202225/05/20227.845	Tasa Fija	366,245.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202221/06/20227.845	Tasa Fija	29,207.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202221/06/20227.845	Tasa Fija	411,275.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202213/07/20227.845	Tasa Fija	96,286.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202225/05/20227.845	Tasa Fija	50,522.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202211/07/20227.845	Tasa Fija	137,754.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202205/08/20229.191	Tasa Fija	284,968.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202209/09/20229.191	Tasa Fija	681,526.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202210/06/20227.845	Tasa Fija	60,158.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202210/05/20227.4325	Tasa Fija	110,827.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202210/05/20227.4325	Tasa Fija	991,592.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202222/04/20227.4325	Tasa Fija	1,699,552.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202225/05/20227.845	Tasa Fija	62,536.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202222/07/20226.3825	Tasa Fija	1,001,418.33	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/03/202211/07/20227.845	Tasa Fija	250,224.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202220/06/20226.695	Tasa Fija	1,468,764.11	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202220/10/20226.3825	Tasa Fija	5,007,091.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202222/06/20226.3825	Tasa Fija	500,709.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202220/09/20226.3825	Tasa Fija	2,503,545.83	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/03/202227/06/20227.8594	Tasa Fija	257,054.42

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 83 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202229/04/20227.4412 Tasa Fija	11,256.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202210/05/20227.4412 Tasa Fija	125,973.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202204/04/20227.4412 Tasa Fija	149,509.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202204/04/20227.4412 Tasa Fija	32,426.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202217/06/20227.8594 Tasa Fija	2,766,274.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202231/05/20227.8594 Tasa Fija	78,247.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202225/05/20227.8594 Tasa Fija	37,594.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202211/07/20227.8594 Tasa Fija	94,863.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202213/07/20227.8594 Tasa Fija	1,158,611.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202211/07/20227.8594 Tasa Fija	4,595.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202220/07/20227.8594 Tasa Fija	118,844.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202207/07/20227.8594 Tasa Fija	1,247,198.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202207/09/20229.2148 Tasa Fija	76,281.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202215/09/20229.2148 Tasa Fija	3,147,247.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202215/09/20229.2148 Tasa Fija	1,672,523.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202225/04/20222.36571 Tasa Fija	40,056.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202213/05/20227.4412 Tasa Fija	627,669.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202217/05/20227.4412 Tasa Fija	266,045.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202208/07/20227.8594 Tasa Fija	731,262.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202220/07/20227.8594 Tasa Fija	1,171,690.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202227/06/20227.8594 Tasa Fija	9,374.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202220/09/20229.2148 Tasa Fija	13,448.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202208/09/20229.2148 Tasa Fija	739,635.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202221/09/20226.3912 Tasa Fija	5,006,213.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202204/04/20227.4412 Tasa Fija	60,704.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202205/05/20227.4412 Tasa Fija	1,395,543.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202218/07/20227.8594 Tasa Fija	1,149,279.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202227/06/20227.8594 Tasa Fija	10,921.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202218/07/20227.8594 Tasa Fija	293,816.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202222/07/20226.3912 Tasa Fija	1,001,242.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202217/05/20227.4412 Tasa Fija	307,703.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202223/05/20227.4412 Tasa Fija	483,382.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202218/07/20227.8594 Tasa Fija	142,020.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202201/09/20229.2148 Tasa Fija	749,115.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202218/04/20221.85657 Tasa Fija	459,633.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202220/06/20222.36571 Tasa Fija	129,422.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202211/07/20222.78971 Tasa Fija	436,820.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202224/05/20226.3912 Tasa Fija	5,006,213.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202223/06/20226.7094 Tasa Fija	1,467,632.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202221/09/20226.3912 Tasa Fija	20,024,854.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202221/09/20226.3912 Tasa Fija	2,503,106.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202222/07/20226.3912 Tasa Fija	1,001,242.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202214/07/20226.8265 Tasa Fija	1,000,189.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202229/08/20257.8394 Tasa Fija	25,000,000.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202230/05/20222.36557 Tasa Fija	207,244.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202211/07/20222.82586 Tasa Fija	41,503.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202226/04/20227.8675 Tasa Fija	5,903.82

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 84 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202223/05/20227.8675	Tasa Fija	143,403.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202217/05/20227.8675	Tasa Fija	242,089.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202228/04/20227.8675	Tasa Fija	108,775.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202223/05/20227.8675	Tasa Fija	159,984.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202227/06/20228.165	Tasa Fija	15,951.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202222/06/20228.165	Tasa Fija	296,592.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202223/06/20228.165	Tasa Fija	79,950.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202218/07/20228.165	Tasa Fija	2,430,542.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202208/06/20228.165	Tasa Fija	2,425,055.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202222/07/20228.165	Tasa Fija	2,001,814.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202218/07/20228.165	Tasa Fija	1,729,753.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202230/08/20229.1478	Tasa Fija	17,429.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202220/09/20229.1478	Tasa Fija	73,052.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202215/09/20229.1478	Tasa Fija	2,238,211.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202220/09/20229.1478	Tasa Fija	93,638.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202223/05/20227.8675	Tasa Fija	4,584,910.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202217/06/20228.165	Tasa Fija	176,330.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202230/05/20228.165	Tasa Fija	939,158.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202220/07/20228.165	Tasa Fija	2,533.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202220/09/20229.1478	Tasa Fija	209,139.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202220/06/20228.165	Tasa Fija	12,665.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/03/202223/09/20226.8175		Tasa Fija	5,003,787.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202218/05/20227.8675	Tasa Fija	262,685.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202210/06/20228.165	Tasa Fija	3,790.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202220/06/20228.165	Tasa Fija	349,151.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202218/05/20227.8675	Tasa Fija	692,282.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/03/202218/07/20228.165	Tasa Fija	1,662.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/03/202213/01/20236.8175		Tasa Fija	1,963,486.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/03/202226/05/20226.8175		Tasa Fija	5,003,787.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/03/202223/09/20226.8175		Tasa Fija	5,784,672.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202225/04/20221.84514	Tasa Fija	409,841.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202206/06/20222.38286	Tasa Fija	1,135,758.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202226/04/20227.8737	Tasa Fija	33,620.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202209/05/20227.8737	Tasa Fija	2,484,808.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202223/06/20228.1725	Tasa Fija	148,001.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202218/07/20228.1725	Tasa Fija	15,600.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202226/04/20227.8737	Tasa Fija	3,536.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202208/07/20228.1725	Tasa Fija	214,746.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202223/09/20229.2807	Tasa Fija	519,536.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202221/09/20229.2807	Tasa Fija	39,552.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202223/06/20228.1725	Tasa Fija	128,340.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202209/09/20229.2807	Tasa Fija	306,292.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202223/08/20229.2807	Tasa Fija	40,535.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/03/202227/07/20226.8237		Tasa Fija	1,000,568.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202228/04/20227.8737	Tasa Fija	38,282.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202214/06/20228.1725	Tasa Fija	116,405.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202209/08/20229.2807	Tasa Fija	3,578,945.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202219/09/20229.2807	Tasa Fija	239,184.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/03/202230/08/20229.2807	Tasa Fija	173,566.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/03/202227/07/20226.8237		Tasa Fija	1,000,568.64

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 85 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/03/202219/07/20226.8265	
Tasa Fija 1,000,189.63	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/03/202227/06/20226.8237	
Tasa Fija 500,284.32	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/03/202223/09/20226.8237	
Tasa Fija 4,193,383.18	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202223/05/20222.39629 Tasa Fija 1,164,538.17	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202223/05/20227.8765 Tasa Fija 2,002,405.06	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202206/07/20228.1765 Tasa Fija 20,509.59	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202227/06/20228.1765 Tasa Fija 305,337.48	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202220/07/20228.1765 Tasa Fija 2,647,619.71	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202227/06/20228.1765 Tasa Fija 146,185.05	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202225/05/20227.8765 Tasa Fija 255,894.55	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202219/05/20227.8765 Tasa Fija 1,102,995.63	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202215/07/20228.1765 Tasa Fija 151,978.19	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202210/06/20228.1765 Tasa Fija 11,676.34	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202227/06/20228.1765 Tasa Fija 40,266.28	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202210/05/20227.8765 Tasa Fija 45,638.19	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20226.8265	
Tasa Fija 2,982,130.54	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20226.8265	
Tasa Fija 3,001,137.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20226.8265	
Tasa Fija 3,001,137.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20226.8265	
Tasa Fija 3,001,137.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20226.8265	
Tasa Fija 3,001,137.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/06/20226.8265	
Tasa Fija 2,500,948.13	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/06/20226.8265	
Tasa Fija 2,500,948.13	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202226/09/20226.7265	
Tasa Fija 2,445,913.68	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/06/20226.8265	
Tasa Fija 427,500.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202226/10/20226.8265	
Tasa Fija 5,001,896.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/06/20227.0265	
Tasa Fija 1,464,979.58	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202208/08/20226.8265	
Tasa Fija 10,003,792.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202210/08/20226.8265	
Tasa Fija 10,003,792.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202212/08/20226.8265	
Tasa Fija 10,003,792.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202215/08/20226.8265	
Tasa Fija 10,003,792.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202217/08/20226.8265	
Tasa Fija 10,003,792.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202225/07/20226.8265	
Tasa Fija 5,001,896.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20226.8265	
Tasa Fija 5,001,896.25	

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 86 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202228/07/20226.8265
Tasa Fija 5,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202226/07/20226.8265
Tasa Fija 5,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202227/07/20226.8265
Tasa Fija 5,001,896.25

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202221/06/20222.406 Tasa Fija 187,358.25

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202215/07/20228.1765 Tasa Fija 2,426,264.52

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202227/07/20228.1765 Tasa Fija 436,035.91

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202227/06/20228.1765 Tasa Fija 1,265,992.03

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202229/07/20226.8265
Tasa Fija 5,000,948.13

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202229/07/20226.8265
Tasa Fija 5,000,948.13

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202229/07/20226.8265
Tasa Fija 1,000,189.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202229/06/20226.8265
Tasa Fija 332,563.05

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202224/06/20227.0265
Tasa Fija 977,697.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202220/05/20227.8765 Tasa Fija 982,776.85

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202210/05/20227.8765 Tasa Fija 78,318.01

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202203/05/20227.8765 Tasa Fija 207,218.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202210/05/20227.8765 Tasa Fija 180,476.60

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202207/06/20228.1765 Tasa Fija 37,151.43

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202227/06/20228.1765 Tasa Fija 230,614.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202214/06/20228.1765 Tasa Fija 71,818.60

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202210/06/20228.1765 Tasa Fija 7,518.07

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202218/07/20228.1765 Tasa Fija 4,955.27

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202209/09/20229.2343 Tasa Fija 912,516.64

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202206/09/20229.2343 Tasa Fija 5,416.46

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202215/06/20228.1765 Tasa Fija 127,667.04

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202229/08/20226.8265
Tasa Fija 10,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202222/08/20226.8265
Tasa Fija 10,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202202/09/20226.8265
Tasa Fija 10,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202224/08/20226.8265
Tasa Fija 10,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202226/08/20226.8265
Tasa Fija 10,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202207/09/20226.8265
Tasa Fija 10,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202219/08/20226.8265
Tasa Fija 10,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202205/09/20226.8265
Tasa Fija 10,001,896.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202227/09/20226.8265
Tasa Fija 2,500,474.06

FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo01/01/202231/01/20220 Tasa Fija 2,546,723.36

FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo01/01/202231/01/20220 Tasa Fija 638,263.67

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 87 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

TOTAL	5,442,278,007.45	7,710,824,031.90	13,285,608,066.79	2,953,064,069.90				
	2,211,063,563.84	1,727,754,920.60	205,700,152.88	96,618,977.42	22,883,131.40			
	45,875,363.68	-	-					
Total bancarios	5,543,947,831.78	8,872,680,698.56	13,285,608,066.79	2,953,064,069.90				
	2,211,063,563.84	1,727,754,920.60	5,183,259,984.03	2,090,323,388.89	22,883,131.40			
	45,875,363.68	-	-					

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]
 Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]
 Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]
 Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]
 Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro]
 Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]

Bursátiles y colocaciones privadas [sinopsis]

Bursátiles listadas en bolsa (quiropgrafarios)

ScotiabankNo41453450937.3	1,150,000,000.00							
ScotiabankNo43612448756.47	2,353,589,631.28							
ScotiabankNo43612448756.47	3,652,943,700.00							
ScotiabankNo43805450126.43	6,000,000,000.00							
ScotiabankNo43613448730.94	111,775,000.00							
ScotiabankNo43613448730.94	123,450,000.00							
TOTAL	-	-	-	-	12,006,533,331.28	1,150,000,000.00	-	-
	235,225,000.00	-						

Bursátiles listadas en bolsa (con garantía)

TOTAL - - - - - - - - - - - - - - - -

Colocaciones privadas (quiropgrafarios)

ScotiabankNo44540448906.16	800,000,000.00							
ScotiabankNo44552449026.6265	1,500,000,000.00							
ScotiabankNo41991456317.4	2,093,000,000.00							
ScotiabankNo432794873912.3	3,360,000,000.00							
ScotiabankNo433544517411.32	3,455,000,000.00							
TOTAL	2,300,000,000.00	-	-	-	8,908,000,000.00	-	-	-

Colocaciones privadas (con garantía)

TOTAL - - - - - - - - - - - - - - - -

Total bursátiles listados en bolsa y colocaciones privadas	-	2,300,000,000.00	-					
	12,006,533,331.28	10,058,000,000.00	-	-	-	235,225,000.00	-	

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]
 Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]
 Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]
 Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]
 Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro]
 Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]

Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo [sinopsis]

Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo

TOTAL

Total otros pasivos circulantes y no circulantes con costo

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 88 / 88

CONSOLIDADO

Impresión Final

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de
interés y/o sobretasa Denominación [eje]
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]
Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año
[miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años
o más [miembro]
Proveedores [sinopsis]
Proveedores

TOTAL

Total proveedores

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de
interés y/o sobretasa Denominación [eje]
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]
Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año
[miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años
o más [miembro]
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo [sinopsis]
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

TOTAL

Total otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

Total de créditos

Comentarios:

El tipo de cambio tomado al cierre de marzo fue de 19.8911

"ver archivo completo en pdf"

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 1 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

Instrumentos Financieros Derivados

I. Información Cualitativa

a. Discusión sobre las políticas de uso de instrumentos financieros derivados

La Dirección General del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (GFSBI), al cual pertenece Scotiabank Inverlat (SBI) y un comité designado por el Consejo de Administración revisan por lo menos con periodicidad semestral y cada vez que las condiciones del mercado lo ameritan, los objetivos, metas y procedimientos de operación y control, así como los niveles de tolerancia de riesgo.

Para tales efectos, la Dirección General se apoya en las áreas u órganos apropiados (Consejo de Administración, Comité de Riesgos) para llevar a cabo las actividades específicas en los requerimientos de administración que marca la

Circular 4/2012 emitida por Banco de México.

Las diferentes áreas responsables de la operación y supervisión del mercado definen los objetivos, metas y procedimientos particulares, de operación y control, así como las tolerancias máximas de riesgo aceptables por área, mismos que deberán ser congruentes con los lineamientos generales establecidos por la Dirección General.

Los productos derivados son importantes herramientas de gestión de riesgo tanto para el Banco como para sus clientes.

El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo con las políticas establecidas.

Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:

Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.

Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.

Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.

Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

La Institución cuenta con Políticas y manuales, que se enlistan a continuación, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y administración de derivados; entre estas políticas se destaca la de Gestión del Riesgos de Nuevas Iniciativas que involucra la participación de diversas áreas de la Institución, a fin de garantizar que no se incurran en riesgos operativos, legales o reputacionales.

Manual de Operación de Derivados.

Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

Política de Riesgo de Contraparte

Política de Sobregiros

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados. Durante el primer trimestre de 2022, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a los Criterios Contables B-5 "derivados y operaciones de cobertura" emitido por la CNBV y aplicables a las Instituciones de Crédito, en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de operaciones de cobertura.

Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles movimientos de las tasas de interés y de tipo de cambio. Las condiciones de mercado bajo las cuales se realizan coberturas son las siguientes:

Núm.	Tipo de Cobertura	Posición	Cubierta	Tipo de posición cubierta	Condición de Mercado	Derivado
1.	Flujos de Efectivo	Pagarés con rendimiento	liquidable al vencimiento de tasa fija	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
2.	Valor Razonable	Bonos de tasa fija en moneda extranjera	Activa	Cubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente.	Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)	
3.	Flujos de Efectivo	Cartera Comercial de tasa flotante	Activa	Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)	
4.	Valor Razonable	Cartera Comercial de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera	Activa	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)	
5.	Flujos de Efectivo	Certificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcional	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)	
6.	Valor Razonable	Bonos de tasa fija en moneda funcional	Pasiva	Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)	
7.	Flujos de Efectivo	Reportos	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)	
8.	Flujos de Efectivo	Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera	Activa	Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN	Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa	

flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional
9. Flujo de Efectivo Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

Las operaciones de derivados de cobertura se incluirán dentro del cálculo de medidas de sensibilidad (i.e. Valor Económico y sensibilidad del margen). En adición, se monitorearán bajo los límites establecidos para ALM previamente aprobados por el Comité de Riesgos.

En lo que respecta a los productos de negociación aprobados Banco se encuentran:

Subyacente*FuturosOpcionesSwaps

MRMEMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

*Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (Currency Swaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (Forward Starting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algortihmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Con esta metodología se generan 300 escenarios a partir de las observaciones históricas y los principales supuestos del modelo son:

El Modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo

El Modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.

El Modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados.)

El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.

Debido a que la medida de VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución realiza diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

Adicionalmente se realizan pruebas de backtest donde se compara el P&L (teórico y real) diario vs VaR de 1 día. Este análisis es realizado mensualmente y es presentado al Comité de Riesgos del Consejo de Administración al menos trimestralmente.

Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles. Scotiabank Inverlat administra su exposición al riesgo de liquidez conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado.

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.

Eliminar la necesidad de obtener fondos a tasas por arriba de las de mercado o a través de ventas forzadas de activos.

Satisfacer los límites y requerimientos de liquidez exigidas por las autoridades. Establecer e implementar políticas de liquidez prudentes.

Desarrollar e implementar técnicas y procedimientos efectivos para monitorear, medir y controlar los requerimientos de liquidez.

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo. Diversificar fuentes de fondeo.

Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes activos líquidos para hacer frente a eventos inesperados.

Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de marzo 2022 y en promedio para el primer trimestre de 2022 es de:

Scotiabank Posición Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 49,01665,663

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 83,803110,172

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales, incluyendo posiciones de derivados de cobertura.

Inventario de modelos de derivados

Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration - Grupo Financiero Scotiabank (México). El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los aplicativos desarrollados en casa matriz (K2 & Wall Street).

Clase de activo Derivado Tipo Breve descripción

Tasas de interés Opciones Europea Caps, Floors:

Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets.

$Cap = \sum_{i=1}^n Caplet_i$

Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet.

$Floor = \sum_{i=1}^n Floorlet_i$

Binaria La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos.

La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:

Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap).

Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).

IRSEl intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).

CCIRS Intercambio de intereses en moneda

nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.

Tipo de cambio Opciones Europea En este tipo de contratos se utiliza la fórmula

Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.

Americana El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)

Binaria Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción.

A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.

Barrera Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento S_T , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t < T}$, son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria.

Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente S_T alcance un umbral preestablecido H llamado barrera de la opción.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 7 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

ForwardForward OTCCompra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

Instrumentos a Valor Razonable

Clase de activoDerivadoTipoBreve descripción

Índices, capitales y metalesOpciones

EuropeaOpción Europea Call / Put: Este tipo de contratos utiliza la fórmula de Black-Scholes.

Opción Europea Quanto: Una opción tipo Quanto es un derivado en el cual el subyacente se denomina en una moneda, pero el instrumento en sí se liquida en otra moneda a una tasa determinada. Tales productos son atractivos para los inversionistas que desean estar expuestos a un activo extranjero, pero sin el riesgo de tipo de cambio equivalente.

BinariaTipo de opción la cual al vencimiento solo tiene dos eventos pagar o no pagar un monto previamente definido.

Derivados listadosMexder FuturesIRLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre Contrato de Intercambio de Flujos de Tasas son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

FXLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre el tipo de cambio son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

Instrumentos valuados a costo

Clase de activoNombre de productoMetodologíaNotas

FI SecurityBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

EQ CashAccionesLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Fondos de inversiónETFsLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Notas Estructuradas listadasBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Políticas Líneas de Crédito

Se informa a esa H. Comisión que en el Manual de Políticas de Crédito Cartera Comercial, en su "Manual de Productos y Programas Especiales de Crédito Cartera Comercial, Apartado III Mercado Financiero, 1.1 Operaciones del Banco en el Mercado Financiero" se norman las operaciones del Banco en el Mercado Financiero estableciendo:

Tipos de Operación que son ofrecidos en función al tipo de acreditado

a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

Necesidades de tesorería del Banco

Relación de corresponsalía

Límites recíprocos

b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:
Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

Tesorería: Call Money

Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

Cambios: FOREX

Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

Metales

Sujetos de Crédito

Podrán ser sujetos de crédito en productos de este mercado, los siguientes:

Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat

Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.

Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)

Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público

Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure". La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar. Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.

La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.

Idoneidad del Cliente

La celebración de operaciones de productos de Mercado Financiero implica la necesidad de que el Banco cuente con elementos razonables que le garanticen, que:

El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar

Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

Para tales efectos, en toda Solicitud de línea para este tipo de productos, se deben aplicar las reglas de la Política de Idoneidad del Grupo Scotiabank, que establece los procesos a seguir para la clasificación del riesgo de idoneidad,

basado en la complejidad de las operaciones y en el conocimiento/ experiencia que el cliente tenga al respecto. Asimismo, en cada revisión anual se debe evaluar si la clasificación de riesgo de idoneidad del cliente es la misma o ha cambiado desde la última revisión.

Políticas de VaR

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de Negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algorithmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Debido a que la medida VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución deberá realizar diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

La unidad Riesgo de Mercado (TFRM) es responsable de definir los procedimientos y cálculos necesarios para realizar el análisis de sensibilidad sobre los portafolios de Trading. Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple y eficaz, además de que se puede hacer un seguimiento de manera sencilla de Estados de resultados (P&L). Los cálculos de sensibilidad se realizan diariamente en forma automática, con procedimientos desarrollados por la Dirección de TFRM.

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

Se estima cual sería el comportamiento del valor del portafolio ante un cambio en las tasas de interés cotizadas en el mercado (curva de rendimientos).

Las sensibilidades del portafolio de instrumentos de renta fija se basan en los conceptos de duración y convexidad y su aplicación dependerá del tipo de instrumento. En todos los casos se producen 2 mediciones; i) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 1 punto base (0.01%) en la curva de rendimiento, y ii) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 100 puntos base (1%) en la curva de rendimiento.

Bonos de Tasa Flotante

En el caso de bonos de tasa flotante la unidad Riesgo de Mercado (TFRM) realiza dos tipos de sensibilidades, la sensibilidad a la tasa libre de riesgos (curva de gobierno o curva mayor) y la sensibilidad a la sobretasa o Spreads, esta metodología asume que un bono de tasa flotante se comporta como la parte flotante de un swap de tasas de interés.

Con metodología se asume que la reprecación ocurre justamente al pago de cupón.

Bonos Cupón Cero

Para el cómputo de la sensibilidad de instrumentos cupón cero, se utiliza el mismo sistema utilizado en instrumentos de tasa fija.

Riesgo de Crédito

También se utiliza el concepto de duración, pero en el caso de los instrumentos de tasa flotante se utiliza la duración total de instrumento en lugar de la "duración al próximo cupón".

Sensibilidad del Pasivo

Gran parte del portafolio de trading de la institución se encuentra fondeado con reportos. Para efectos de determinar cuál es la sensibilidad de la parte corta (el financiamiento) de las posiciones, se determina el cambio del valor del portafolio ante un cambio de 1 (0.01%) y 100 puntos básicos en las tasas de interés (1%).

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

Para efectos de determinar la sensibilidad a cambios en la curva de rendimiento de los Swaps de TIIE, se efectúa un cambio de 1 punto base en cada uno de los puntos relevantes de la curva de rendimientos, además de un cambio de 1 y cien puntos base de forma paralela, valuando el portafolio con las diferentes curvas y calculando cual es el cambio en el valor del portafolio con cada uno de esos cambios.

En el caso de Swaps sobre otro tipo de tasas de interés, lo cual puede incluir CETES y/o Libor, los cálculos se realizan directamente haciendo un shock de 1 y 100 puntos base sobre la curva cupón cero. Todas las transacciones realizadas sobre subyacentes distintos de TIIE están autorizados sólo en una base back to back

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

Para el cálculo de sensibilidad de estos derivados a la tasa de interés, se utilizan los conceptos de duración y convexidad.

Futuros de CETE

El tratamiento de futuros de Cete es análogo al tratamiento de futuros de TIIE.

Efectividad De la Cobertura:

Se realizan pruebas y análisis, al inicio de cada operación de cobertura y de manera continua, con base en la comparación de los cambios pasados en el valor

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 11 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

razonable o en los flujos de efectivo del instrumento de cobertura con los cambios que hayan experimentado en el pasado el valor razonable o los flujos de efectivo de la posición primaria.

Las pruebas consideran 61 escenarios históricos y se realiza con base en un análisis de regresión.

Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios semanales históricos, es decir una ventana de observación mayor a un año.

Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos).

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios arriba descritos. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

Grado de relación entre los cambios observados: $R^2 > 80\%$.

Pendiente de la regresión entre $[-1.25$ y $-0.80]$.

Significancia de la regresión: $F > 5$.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con los requerimientos del B5 para concluir cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2022 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son cobertura eficiente.

Durante el primer trimestre de 2022 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha de actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos del B5 aplicables a Instituciones de Crédito.

Cobertura de Flujos de efectivo:

La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de la cuenta de utilidad integral en el capital contable y, la porción ineffectiva, se reconoce inmediatamente en los resultados del periodo.

El componente del capital contable que forma parte de la utilidad integral asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre:

La ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.

Cobertura de Valor Razonable:

La ganancia o pérdida que resulte de valorar el instrumento de cobertura a su valor razonable es reconocida de forma inmediata en los resultados del período en que ocurre.

La ganancia o pérdida que resulte de valorar la posición cubierta atribuible al riesgo cubierto debe ajustar el valor en libros de dicha posición y se reconoce inmediatamente en los resultados del período en que ocurre.

En adición a lo arriba descrito, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base 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 2022 y promedio del primer trimestre 2022 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank Posición	Posición	
(millones de pesos)	(Cierre)	(Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	83,803	110,172

Se realizó un análisis de sensibilidad para las operaciones con instrumentos financieros derivados mismo que refleja requerimientos adicionales que pudieran suscitarse por eventualidades en el mercado, lo anterior podría verse reflejado en una pérdida potencial o en salidas de efectivo adicionales para Scotiabank Inverlat.

Para estos efectos el cálculo de la exposición potencial para derivados considera lo siguiente:

Considerando 3 escenarios (probable, posible y de estrés), Scotiabank Inverlat podría tener salidas de efectivo adicionales por posible baja en su calificación crediticia, dado que el colateral entregado sería mayor. Esto en conexión con instrumentos financieros derivados OTC que tengan asociados contratos marco.

La salida/pérdida potencial para los 3 escenarios dada la baja de 3 escalafones en la calificación crediticia del GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat, está dada por:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.

Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:

Scotiabank NormalEscenario PosibleEscenario ProbableEscenario de Estrés
(millones de pesos)

Gap 30d Gap Acum49,01646,22546,22546,225

Cambios en el Gap respecto al escenario normal(2,791)(2,791)(2,791)

d. Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz, y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.

El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.

Delta

La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.

Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.

Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes.

Exposición Delta: Se define como el monto nocional equivalente del subyacente (en cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.

Gamma

El riesgo gamma es complementario al riesgo delta, y es otra medida de sensibilidad del valor de una opción con respecto al valor de un subyacente. Gamma mide la tasa de cambio de la delta ante un cambio en el nivel del subyacente, y análogo al cálculo de delta, puede ser interpretada de manera analítica, como la segunda derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al subyacente.

Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos de medición de riesgos no se realizan de manera analítica, sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo gamma, denominadas $\gamma_{1\%}$ y $\gamma_{5\%}$.

$\gamma_{1\%}$ mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que $\gamma_{5\%}$ mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio ante un cambio de 5% en el valor del subyacente. Ambas mediciones cuentan con límites de riesgos.

Vega

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.

Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

Rho

Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portafolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).

RHO es entonces definida como el cambio en el valor de un portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.

Theta

Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio ante el paso del tiempo. Analíticamente, Theta

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 15 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

puede ser expresado como la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al tiempo.

Theta es calculada mediante el procedimiento de valuación completa (tal como es el caso de las otras griegas) en lugar de analíticamente, sólo con fines informativos y de atribución de P&L.

Dividend Risk

La valoración de opciones sobre índices o acciones supone una tasa de dividendos compuesta continúa conocida. Los dividendos, sin embargo, son una estimación y por tanto una variable desconocida, representando un factor de riesgos para la valuación y el consiguiente P&L de las operaciones con opciones.

El riesgo de dividendos no tiene una letra "griega" asociada a su sensibilidad, y en el caso de opciones sobre índices y acciones. La medición se realiza por la vía de incrementar un 1% (i.e. desde 1% a 1.01%) la tasa de dividendos.

II. Información Cuantitativa

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa.

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a marzo 31, 2022:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	1,443.00	(2,731.00)	22,543.00	(5,785.00)	(25,478.00)	646.00	(9,362.00)
CCS	1.00	12.00	(2.00)	(22.00)	10.00	(1.00)	(2.00)
Caps&Floors	(44.00)	135.00	6.00	9.00	--	106.00	
Binary Caps&Floors	-----						
TIIE Futures	-----						
Mbonds Futures	-----						
Total DERIVATIVES	1,400.00	(2,584.00)	22,547.00	(5,798.00)	(25,468.00)	645.00	(9,258.00)

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 sensibilidad es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.

Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (10.02) Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (20.04) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (49.63) Millones de pesos.

Los escenarios de stress están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de escenarios al alza.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
 GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
 INVERLAT

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 16 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 Caps(0.01)(109.84)50.00(0.46)100.00(0.93)200.00
 (1.85)
 Volatilidad al 1%Caps & Floors(0.01)(0.23)0.10(0.00)0.40(0.00)1.00(0.01)
 a FX %Forwards4.8095.540.10(9.56)0.20(19.11)0.50(47.77)
 a FX %Opciones Divisa--0.100.000.20-0.500.00
 Total (10.02) (20.04) (49.63)

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 31 marzo de 2022 (la sensibilidad de las opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

DeltaVegaGamma
 Options IDBTVR.INDX---
 Options MEXEZU.USM---
 Options MEXFXI.USM---
 Options MEXIL5.INDX---
 Options MEXIXM.INDX---
 Options MEXMCH.USM---
 Options MEXMSF.INDX---
 Options MEXMSI.INDX---
 Options MEXQQQ.USM---
 Options MEXSR5.INDX---
 Options MEXXLE.USM---
 TOTAL---

Análisis de Stress

Los escenarios de stress a la baja; probable -10%, poco probable -30% y muy poco probable -50% son los siguientes:

Escenarios a la Baja
 (0.1)(0.3)(0.5)
 Options IDBTVR.INDX---
 Options MEXEZU.USM---
 Options MEXFXI.USM---
 Options MEXIL5.INDX---
 Options MEXIXM.INDX---
 Options MEXMCH.USM---
 Options MEXMSF.INDX---
 Options MEXMSI.INDX---
 Options MEXQQQ.USM---
 Options MEXIBX.INDX---
 Options MXSXAE.INDX---
 TOTAL---

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 01 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
 INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
 GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
 INVERLAT

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 17 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

Escenarios a la Alza
 0.050.150.2
 Options IDBTVR.INDX---
 Options MEEXEZU.USM---
 Options MEXFXI.USM---
 Options MEXIL5.INDX---
 Options MEXIXM.INDX---
 Options MEXMCH.USM---
 Options MEXMSF.INDX---
 Options MEXMSI.INDX---
 Options MEXQQQ.USM---
 Options MEXIBX.INDX---
 Options MXSXAE.INDX---
 TOTAL---

Y están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de escenarios al alza.

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del EscenarioMonto
 Probable(0.00)
 Poco Probable(0.00)
 Muy poco Probable(0.00)

Describir y numerar las llamadas de margen que se hayan presentado durante el trimestre

Respecto a las llamadas de margen, al 31 de marzo de 2022 se tienen los siguientes saldos:

Cifras expresadas en pesos

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1MXN		86,100,000.00	(39,500,000)
CLIENTE 2MXN		31,000,000	(31,000,000)
CLIENTE 3MXN		9,300,000.00	(26,600,000)
CLIENTE 4MXN		85,900,000	(109,100,000)
CLIENTE 5MXN		154,400,000	(58,200,000)
CLIENTE 6MXN		807,200,583	(428,300,000)
CLIENTE 7USD		6,700,000	(20,290,000)
CLIENTE 8USD		83,880,000	(6,070,000)
CLIENTE 9USD		209,170,000	(65,300,000)
CLIENTE 10USD		-	(980,000)
CLIENTE 11USD		3,430,000	(5,960,000)
CLIENTE 12USD		300,000	
-			
CLIENTE 13USD		26,960,000	(28,440,000)
CLIENTE 14USD		260,000	
-			
CLIENTE 15USD		9,760,000	(22,640,000)
CLIENTE 16MXN		312,600,000	(266,500,000)
CLIENTE 17MXN		146,300,000	(181,200,000)
CLIENTE 18MXN		23,400,000	(13,400,000)
CLIENTE 19MXN		-	(29,700,000)
CLIENTE 20MXN		342,400,000	(684,100,000)

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 18 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

CLIENTE 21USD	16,010,000	
-		
CLIENTE 22MXN	89,000,000	
-		
CLIENTE 23MXN	52,872,686	(8,061,341,000)
CLIENTE 24MXN	25,000,000	(12,400,000)
CLIENTE 25MXN		- (127,700,000)
CLIENTE 26USD	5,130,000	(7,580,000)
CLIENTE 27USD		- (4,715,000)
CLIENTE 28USD	2,780,000	(9,800,000)
TOTAL	2,529,853,269.30	(10,240,816,000)

Describir y numerar los Instrumentos Financieros Derivados que hayan vencido durante el trimestre y de aquéllos cuya posición haya sido cerrada.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01**

AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 19 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01**

AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 20 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01**

AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 21 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01**

AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 22 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 23 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

Liquidados anticipadamente

Revelación de cualquier incumplimiento que se haya presentado en los contratos respectivos

Cifras expresadas en pesos

Deal	Producto	Fecha de evento	Contraparte/
SAK055	Interest Rate Swap	ene-22	Cliente
SX6539	Interest Rate Swap	ene-22	Cliente
SAK055	Interest Rate Swap	feb-22	Cliente
SX6539	Interest Rate Swap	feb-22	Cliente
C67387	Cross Currency Swaps	feb-22	Cliente
C67387	Cross Currency Swaps	feb-22	Cliente
C67390	Cross Currency Swaps	mar-22	Cliente
C67390	Cross Currency Swaps	mar-22	Cliente
SDT815	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente
LLAMADA DE MARGEN		mar-22	Cliente
SDT175	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente
SDS941	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente
SDT297	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente
2022022403316	Forwards FX	mar-22	Cliente

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01**

AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 24 / 24

CONSOLIDADO

Impresión Final

SDW519	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente	15MXN	4,958	NO ENVIO LOS FONDOS
SAK055	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente	16MXN	666,296	NO FONDEO SU CUENTA
SDS115	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente	17MXN	2,556	NO FONDEO SU CUENTA
SX6539	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente	18MXN	692,591	NO FONDEO SU CUENTA
SDT314	Interest Rate Swap	mar-22	Cliente	19MXN	52,869	NO FONDEO SU CUNETA
C67387	Cross Currency Swaps	mar-22	Cliente	20MXN	2,172,412	NO FONDEO SU CUNETA
C67387	Cross Currency Swaps	mar-22	Cliente	21MXN	275,738	NO FONDEO SU CUNETA

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte
Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados
Cifras expresadas en pesos

"ver archivo completo en pdf"
