Scotiabank Inverlat

Información Financiera

SCOTIABANK INVERLAT

Indicadores Financieros

Scotiabank-Indicadores Financieros	T2 2022	T3 2022	T4 2022	T1 2023
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	15.7%	15.1%	10.1%	15.9%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	1.7%	1.6%	1.0%	1.6%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.6%	3.5%	2.8%	3.7%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.3%	2.3%	2.4%	2.3%
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)	3.6%	3.8%	3.7%	3.8%
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.)	95.2%	85.8%	90.6%	87.8%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	20.70%	20.99%	19.78%	21.01[1)]
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	16.50%	16.41%	15.50%	16.12[1)]
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	42.5%	40.6%	45.5%	44.0%

1). Sujeto a aprobación de Banco Central

Los resultados alcanzados dan una utilidad neta acumulada después de impuestos al cierre del primer trimestre de $2,995 millones, una disminución anual de 13%; debido principalmente al efecto en reservas crediticias producto de la implementación de IFRS 9 durante el primer trimestre de 2022, compensados parcialmente por Inversiones en instrumentos financieros en intermediación, así como un mayor margen financiero.

La utilidad neta mostró un incremento de $1,075 millones o 56% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a menores requerimientos de reservas crediticias; compensados parcialmente con mayores impuestos a la utilidad.

Scotiabank- Información Financiera (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A Δ%
Ingresos por intereses	12,030	16,950	18,392	53%
Gastos por intereses	(6,045)	(10,211)	(11,733)	-94%
Margen Financiero	**5,985**	**6,739**	**6,659**	**11%**
Comisiones	1,002	1,197	1,199	20%
Resultado por Intermediación	379	333	563	49%
Otros ingresos/egresos de la operación	135	274	282	> +100%
Ingresos no Financieros	**1,516**	**1,804**	**2,044**	**35%**
Total Ingresos	**7,501**	**8,543**	**8,703**	**16%**
Gastos de Administración y Promoción	(4,474)	(4,310)	(4,434)	1%
PTPP[1).]	**3,027**	**4,233**	**4,269**	**41%**
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	1,430	(2,006)	(145)	> -100%
Resultado de la Operación	4,457	2,227	4,124	-7%
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	-	-	79	0%
Resultado antes de Impuestos a la Utilidad	**4,457**	**2,227**	**4,203**	**-6%**
Impuestos a la Utilidad	(1,008)	(307)	(1,208)	-20%
Resultado Neto	**3,449**	**1,920**	**2,995**	**-13%**
Otros Resultados Integrales				
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	(49)	238	52	> +100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	357	(137)	(42)	> -100%
Remedición de beneficios definidos a los empleados	(4)	(366)	1	> +100%
Participación en ORI de otras entidades	-	(2)	-	0%
Resultado Integral	**3,753**	**1,653**	**3,006**	**-20%**

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

Margen Financiero

El margen financiero fue de $6,659 millones al cierre del primer trimestre de 2023, un incremento de $674 millones u 11% respecto al mismo trimestre del año anterior impulsado por mayores volúmenes de hipotecas y cartera comercial.

Al cierre del primer trimestre el margen financiero se ubicó $80 millones o 1% por debajo del trimestre anterior; debido a que los ingresos por intereses subieron $1,442 millones mientras que los gastos por intereses se incrementaron en $1,522 millones. El cambio de mezcla favoreció a la cartera hipotecaria y comercial. Por su parte, la participación de depósitos a plazo aumentó; así como los depósitos de exigibilidad inmediata.

Ingresos no Financieros

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A Δ%
Aceptaciones por Cuenta de Terceros	-	-	1	0%
Actividades Fiduciarias	65	54	60	-8%
Apertura de Cuenta	4	6	6	50%
Cartas de Crédito sin Refinanciamiento	57	82	75	32%
Cheques Certificados	1	1	1	0%
Cheques de caja	-	1	-	0%
Manejo de Cuenta	83	86	83	0%
Operaciones de Crédito	391	487	400	2%
Otras Comisiones y Tarifas	330	401	495	50%
Servicios de Banca Electrónica	44	50	51	16%
Transferencia de Fondos	27	29	27	0%
Total de Comisiones y Tarifas (netas)	**1,002**	**1,197**	**1,199**	**20%**

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	(14)	20	35	> +100%
Aportaciones al IPAB	(502)	(521)	(533)	-6%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	83	25	35	-58%
Donativos	-	(11)	-	0%
Estimación por Pérdida de Valor de Bienes Adjudicados	(4)	(8)	(7)	-75%
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito	-	52	-	0%
Ingresos por Arrendamiento	72	3	3	-96%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados	29	45	46	59%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	851	639	762	-10%
Quebrantos	(405)	(34)	(72)	82%
Recuperaciones	3	11	-	-1%
Resultado en Venta de Bienes Adjudicados	22	22	13	-41%
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo	-	1	-	0%
Utilidad por venta de cartera de crédito	-	30	-	0%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación	**135**	**274**	**282**	**> +100%**

El total de ingresos no financieros fue de $2,044 millones en el primer trimestre de 2023, un incremento de $528 millones o 35% respecto al mismo trimestre del año anterior, debido a mayores comisiones y tarifas (netas) principalmente por colocación de créditos, así como mayores ingresos por intermediación y por Otros Ingresos/Egresos de la Operación. Los ingresos por intermediación se vieron impactados por mayores resultados de inversiones en instrumentos financieros en el trimestre y menores ingresos por cambios y derivados.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron un incremento de $240 millones o 13%, debido principalmente a mejores resultados por intermediación en instrumentos financieros y en derivados.

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

	3 meses			
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A Δ%
Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	1,430	(2,006)	(145)	> -100%

En el primer trimestre de 2023, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en $145 millones, un incrementó de $1,575 millones respecto al mismo periodo del año anterior; debido a la implementación de IFRS 9, durante el primer trimestre de 2022.

Por el contrario, respecto al trimestre anterior, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra una disminución de $1,861 millones o 93% debido principalmente a menores requerimientos de la cartera total (comercial y tarjeta de crédito), así como de reservas adicionales.

Gastos de Administración y Promoción

	3 meses			
Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A Δ%
Gastos de Personal	(2,402)	(1,555)	(2,367)	1%
Gastos de Operación	(2,072)	(2,755)	(2,067)	0%
Total de Gastos de Administración y Promoción	(4,474)	(4,310)	(4,434)	1%

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en $4,434 millones en el primer trimestre, una disminución de $40 millones o 1% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a una disminución en gastos de personal.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, incrementaron $124 millones o 3%. principalmente por el ajuste estacional del monto de PTU durante el primer trimestre de cada año y menores gastos generales.

Impuestos a la Utilidad

	3 meses			
Scotiabank-Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A Δ%
Impuesto a la Utilidad Causado	(622)	(682)	(962)	-55%
Impuesto a la Utilidad Diferido	(386)	375	(246)	36%
Total de Impuestos a la Utilidad	**(1,008)**	**(307)**	**(1,208)**	**-20%**

En el primer trimestre, se registró un impuesto neto a cargo de $1,208 millones, un incremento de $200 millones o 20% respecto al mismo trimestre del año anterior, debido a una menor inflación en el trimestre.

Respecto al trimestre inmediato anterior, el impuesto incremento $901 millones, originado principalmente por una mayor utilidad en el periodo.

Balance General

	3 meses			
Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	183,564	231,456	248,273	35%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	426,349	476,776	472,571	11%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	16,180	18,541	18,550	15%
Partidas diferidas	-	2,746	2,765	0%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,599)	(16,805)	(16,278)	-4%
Otros Activos	42,974	37,366	50,515	18%
Total Activo	**653,468**	**750,080**	**776,396**	**19%**
Depósitos	429,019	485,466	485,731	13%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	41,936	49,518	35,734	-15%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,096	9,057	9,099	0%
Otros Pasivos	102,826	130,759	170,396	66%
Capital	**70,591**	**75,280**	**75,436**	**7%**
Total Pasivo y Capital	**653,468**	**750,080**	**776,396**	**19%**

Al 31 de marzo de 2023, el total de activos de Scotiabank se ubicó en $776,396 millones, un incremento de $122,928 millones o 19% respecto al cierre de marzo de 2022. El incremento anual se debió a mayores volúmenes de cartera de crédito, inversiones en instrumentos financieros de valores gubernamentales (negociables y por cobrar o vender), efectivo y equivalentes de efectivo principalmente en depósitos en Banxico; así como mayores volúmenes en instrumentos financieros derivados.

Los activos totales incrementaron $26,316 millones o 4% respecto al cierre del trimestre anterior, debido principalmente a mayores volúmenes en inversiones en instrumentos financieros de valores gubernamentales (negociables y por cobrar o vender) y deudores por liquidación de operaciones en otros; compensados parcialmente por menores volúmenes en efectivo y equivalentes en préstamos interbancarios call money y depósitos en otras entidades financieras.

El total del pasivo registró $700,960 millones al 31 de marzo, un incremento de $118,083 millones o 20% respecto al año pasado. Este incremento fue resultado principalmente de mayores volúmenes en depósitos, así como acreedores por reporto, instrumentos financieros derivados y valores asignados por liquidar (en otros).

Respecto al cierre del trimestre anterior, el pasivo total incrementó $26,160 millones o 4%, debido principalmente a mayores volúmenes en acreedores por reporto y liquidación de operaciones, instrumentos financieros derivados y colaterales vendidos o dados en garantía (en otros); compensados en parte por menores volúmenes de préstamos bancarios y de otros organismos.

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	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A %
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	34,150	33,259	33,042	-3%
Créditos a la Vivienda	169,766	189,071	192,939	14%
Total Préstamos de Menudeo	**203,916**	**222,330**	**225,981**	**11%**
Actividad Empresarial o Comercial	185,275	221,292	216,060	17%
Entidades Financieras	17,720	17,426	16,097	-9%
Entidades Gubernamentales	19,438	15,728	14,433	-26%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	**222,433**	**254,446**	**246,590**	**11%**
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	**426,349**	**476,776**	**472,571**	**11%**

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales etapa 1 y 2 al 31 de marzo de 2023 se ubicó en $246,590 millones, un incremento de $24,157 millones u 11% respecto al año pasado y una disminución de $7,856 o 3% respecto al trimestre anterior. El incremento anual se dio principalmente por mayores créditos de actividad empresarial o comercial. La disminución trimestral se debió a menores créditos de actividad empresarial o comercial; entidades financieras y gubernamentales.

La cartera de préstamos de menudeo etapa 1 y 2 al 31 de marzo de 2023 alcanzó $225,981 millones, un incremento anual de $22,065 millones y $3,651 millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado por mayores créditos a la vivienda.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	16,180	18,541	18,550	15%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,599)	(16,805)	(16,278)	-4%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta	**581**	**1,736**	**2,272**	**> +100%**
Índice de morosidad	**3.66%**	**3.74%**	**3.78%**	**12pb**

Al 31 de marzo de 2023 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó $18,550 millones, un incremento anual de $2,370 millones o 15% y un incremento trimestral de $9 millones.

En esta misma fecha, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en $16,278 millones, un incremento anual de $679 millones o 4% y una disminución de $527 millones o 3% respecto del trimestre anterior. La estimación preventiva para riesgos crediticios representa el 3.3% de la cartera total, una disminución de 21pb respecto al año anterior y de 8pb respecto al trimestre anterior.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 87.8% al 31 de marzo de 2023, una disminución de 800pb respecto del año anterior y de 300pb respecto del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 31 de marzo de 2023 fue de 3.8%, un incremento de 12pb respecto del año anterior y 3pb respecto al trimestre pasado.

Depósitos

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023	A/A Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro	**216,843**	**231,775**	**229,911**	**6%**
Público en General	187,317	209,629	205,915	10%
Mercado de Dinero	2,302	31,238	43,630	> +100%
Total Depósitos a Plazo	**189,619**	**240,867**	**249,545**	**32%**
Títulos de Crédito Emitidos	21,676	11,845	5,047	-77%
Cuenta global de captación sin movimientos	881	979	1,228	39%
Total de Depósitos	**429,019**	**485,466**	**485,731**	**13%**

El total de depósitos registró $485,731 millones al 31 de marzo de 2023, un incremento anual de $56,712 millones o 13%, debido principalmente a mayores depósitos a plazo por $59,926 millones o 32%.

El total de depósitos se muestra sin cambios significativos respecto al trimestre anterior, con un incremento de $265 millones.

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros (millones de pesos al 31 de marzo de 2023 valor razonable)					
Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Instrumentos financieros negociables	**68,852**	**1,556**	**14**	**180**	**70,602**
Sin restricción:	-	-	13	-	13
Restringidos:	68,852	1,556	1	180	70,589
En operaciones de reporto	55,464	1,556	-	180	57,200
Préstamos de valores	4,793	-	-	-	4,793
Otros	8,595	-	1	-	8,596
Instrumentos financieros para cobrar o vender	**51,940**	**21,433**	**-**	**1,607**	**74,980**
Sin restricción:	36,070	21,433	-	1,607	59,110
Restringidos:	15,870	-	-	-	15,870
En operaciones de reporto	15,383	-	-	-	15,383
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	487	-	-	-	487
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	**4,765**	**-**	**-**	**-**	**4,765**
Sin restricción	4,765	-	-	-	4,765
Total	**125,557**	**22,989**	**14**	**1,787**	**150,347**

Scotiabank Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto) (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)				
Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I-BANSAN-23155	14,964,608,046	11.15%	14	14,900

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023 valor razonable)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Negociación	4,595	4,051	-	-	1,718	1,546	261	230	26,370	26,418	-	-	32,944	32,245
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	8,645	6,260	-	-	8,645	6,260

Scotiabank-Montos nocionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de marzo de 2023)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados	
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
Con fines de negociación												
Posición USD	3,196	3,384	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	1	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CHF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	1	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	12	12	474	459	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	59	59	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	292	292	917	407	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	-	3,432	4,104	668	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	32,704	31,839	330,400	329,209	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	782	781	2,820	2,951	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-		-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
Con fines de cobertura												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	57,895	3,550	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	482	477	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	168,675	45,364	-	214,039
Créditos a entidades financieras	16,046	51	-	16,097
Créditos a entidades gubernamentales	10,823	3,610	-	14,433
Créditos al consumo	32,374	-	-	32,374
Créditos a la vivienda	189,834	16	55	189,905
Total	**417,752**	**49,041**	**55**	**466,848**

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	417,752	49,041	55	466,848
Créditos al consumo	668	-	-	668
Créditos a la vivienda	3,028	1	5	3,034
Total	**5,717**	**1**	**5**	**5,723**

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	7,760	1,574	-	9,334
Créditos a entidades financieras	91	-	-	91
Créditos al consumo	823	-	-	823
Créditos a la vivienda	8,261	34	7	8,302
Total	**16,935**	**1,608**	**7**	**18,550**

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)	
Saldo al 31 de diciembre de 2022	**18,541**
Reestructuras	75
Recuperaciones	(398)
Castigos y quitas	(582)
Traspasos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 3	1,048
Fluctuación Tipo Cambio	(134)
Saldo al 31 de marzo de 2023	**18,550**

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)		
Saldo al 31 de diciembre de 2022		16,805
Más: Creación de reservas		27
Calificación		184
Menos: Adjudicaciones y otros		15
Castigos y quitas		587
Comercial	33	
Hipotecario	116	
Consumo	438	
Desliz cambiario		136
Saldo al 31 de marzo de 2023		16,278

Scotiabank-Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)		
No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
1	10,293	15.09%
2	8,102	11.88%
3	7,575	11.10%
Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos		25,970

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2			
Metropolitano	56.1%	62.2%	63.8%
Noroeste – Centro	12.1%	10.7%	10.5%
Norte	15.7%	13.7%	13.2%
Bajío	9.7%	7.9%	7.3%
Sur	6.4%	5.5%	5.2%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3			
Metropolitano	40.5%	41.5%	51.0%
Noroeste – Centro	18.0%	19.6%	16.3%
Norte	8.1%	7.3%	6.1%
Bajío	17.0%	15.7%	13.0%
Sur	16.3%	15.9%	13.6%

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)						
Grado de Riesgo	Importe Cartera Crediticia	Reservas Preventivas Necesarias				
		Cartera Comercial	Consumo		Cartera de Vivienda	Total Reservas Preventivas
			No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes		
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	417,341	907	99	453	303	1,762
Riesgo A2	61,512	624	29	196	13	862
Riesgo B1	12,170	153	38	55	14	260
Riesgo B2	6,868	26	49	32	53	160
Riesgo B3	5,422	77	20	36	46	179
Riesgo C1	3,352	56	30	66	50	202
Riesgo C2	3,424	83	28	94	199	404
Riesgo D	7,290	624	49	262	1,247	2,182
Riesgo E	11,765	6,142	617	286	1,742	8,787
Total	**529,144**	**8,692**	**959**	**1,480**	**3,667**	**14,798**
Exceso						**1,480**
Reservas Constituidas						**16,278**

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 2023.

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	$ 3
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	23
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos	6
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	1,448
Total	**$ 1,480**

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 2023 mantiene el Banco en el rubro de "Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses" son:

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)			
	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	1,661	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	**11,209,692**	**1,661**	

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)	ISR	PTU
Provisión por perdidas de crédito	4,883	1,104
Compensación diferida	(1,195)	(268)
Ingresos diferidos	522	113
Instalaciones y equipos / depreciación	774	176
Beneficios a los empleados	986	222
Provisiones	904	162
Otros	(645)	(47)
Efecto Neto en Diferido	**6,229**	**1,462**

Al 31 de marzo de 2023, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)						
Vencimiento	Préstamos			Financiamiento		Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	7,187	3,162	-	10,349
Largo	-	-	9,500	4,592	-	14,092
Total	**-**	**-**	**16,687**	**7,754**	**-**	**24,441**
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	12.59%	10.73%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	8,651	-	17	666	1,826	11,160
Largo	-	-	-	133	-	133
Total	**8,651**	**-**	**17**	**799**	**1,826**	**11,293**
Tasa Promedio	5.35%	0.00%	6.12%	5.23%	5.83%	
Total Préstamos Interbancarios	**8,651**	**-**	**16,704**	**8,553**	**1,826**	**35,734**

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 2023.

Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	31 mar 2022	31 dic 2022	31 mar 2023
Depósitos a la Vista	**53.4%**	**49.1%**	**48.1%**
Metropolitano	21.8%	22.3%	21.5%
Noroeste – Centro	11.4%	9.1%	9.0%
Norte	8.3%	7.0%	6.7%
Bajío	6.1%	5.2%	5.1%
Sur	5.8%	5.5%	5.8%
Depósitos Ventanilla	**46.0%**	**44.3%**	**42.8%**
Metropolitano	18.7%	21.4%	19.9%
Noroeste - Centro	6.9%	4.8%	4.4%
Norte	9.2%	8.6%	7.6%
Bajío	5.6%	5.1%	5.3%
Sur	5.6%	4.4%	5.6%
Total de Captación del Público	**99.4%**	**93.4%**	**90.9%**
Fondeo Profesional	**0.6%**	**6.6%**	**9.1%**

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional **Tasa Promedio** **(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)**	Pesos	Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	4.71%	2.11%	-
Depósitos a plazo	9.73%	0.00%	-

Scotiabank-Resultados por Intermediación **(millones de pesos)**	31 mar 2023
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	377
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(4)
Resultado por valuación de divisas	(604)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	423
Resultado por compraventa de divisas	373
Costos de transacción	(2)
Total	563

Emisión de Certificados Bursátiles

Al cierre de marzo de 2023, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

	Quinta[1).]
Clave de Pizarra	SCOTIAB 13-2
Monto de la Emisión	$1,150 millones
Fecha de Emisión y Colocación	28 junio 2013
Plazo de Vigencia de la Emisión	3,640 días, 20 períodos 182 días, aprox. 10 años
Garantía	Quirografaria
Tasa de interés	7.30% Fijo
Pago de Intereses	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) /"mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento

1). Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

Emisión de Obligaciones Subordinadas

(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)					
Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo	Importe ($)	Tasa (%)
18-diciembre-14	05-diciembre-24	MX0QSC1N0016	3,640	2,093,000,000	7.4
28-junio-18	09-junio-33	MX0QSC1N0024	5,460	3,360,000,000	12.3
11-septiembre-18	Perpetua	MX0QSC1N0032	-	3,455,000,000	11.3
Total de Obligaciones Subordinadas				8,908,000,000	

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
99-SCOTIAB 07-20	7,299,300	14-may-20	12-may-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	729,930,000
99-SCOTIAB 08-20	402,350	11-jun-20	09-jun-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	40,235,000
99-SCOTIAB 04-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99-SCOTIAB 05-21	4,854,600	29-abr-21	26-abr-24	1,093	Index (IDBTVER)	485,460,000
99-SCOTIAB 06-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1,093	Index (IDBTVER)	57,230,000
99-SCOTIAB 08-21	802,900	12-ago-21	10-ago-23	728	Index (IDBTVER)	80,290,000
99-SCOTIAB 09-21	3,940,200	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	394,020,000
99-SCOTIAB 10-21	3,841,300	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	384,130,000
99-SCOTIAB 11-21	1,105,530	07-dic-21	01-jun-23	541	MSCI ETF (EZU)	110,553,000
99-SCOTIAB 01-22	543,200	28-feb-22	25-feb-25	1,093	MSFDVTHY Index	54,320,000
99-SCOTIAB 02-22	512,600	28-feb-22	27-feb-24	729	Invesco QQQ Series 1	51,260,000
99-SCOTIAB 03-22	369,750	08-mar-22	05-sep-23	546	iShares MSCI China ETF	36,975,000
99_SCOTIAB_04-22	571,500	12-may-22	10-nov-23	547	SPDR Gold Shares (GLD)	57,150,000
99_SCOTIAB_05-22	1,255,860	15-jun-22	13-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	125,586,000
99_SCOTIAB_06-22	1,826,500	15-jun-22	13-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	182,650,000
99_SCOTIAB_07-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_08-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_09-22	495,000	23-jun-22	22-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	49,500,000
99_SCOTIAB_10-22	720,100	30-jun-22	29-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	72,010,000
99_SCOTIAB_11-22	5,791,750	17-nov-22	14-nov-25	1,093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	579,175,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-22	14-nov-25	1,092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	803,800	19-dic-22	17-dic-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	80,380,000
99_SCOTIAB_1-23	120,200	03-mar-23	03-sep-24	550	iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)	12,020,000
Total Bonos Bancarios al 31 de marzo de 2023						3,831,348,000

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 2023)**		
Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	13,468
2	Resultados de ejercicios anteriores	50,948
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	11,021
4	Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1 (solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones)	No aplica
5	Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital común de nivel 1)	No aplica
6	Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	75,437
	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)	1,466
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-
12	Reservas pendientes de constituir	-
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	-
14	Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable	No aplica
15	Plan de pensiones por beneficios definidos	-
16 conservador	Inversiones en acciones propias	-
17 conservador	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	-
18 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
19 conservador	Inversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
20 conservador	Derechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%)	-
21	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo)	-
22	Monto que excede el umbral del 15%	No aplica

23	del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
24	del cual: Derechos de servicios hipotecarios	No aplica
25	del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales	No aplica
26	Ajustes regulatorios nacionales	8,669
A	del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	-
B	del cual: Inversiones en deuda subordinada	-
C	del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	-
D	del cual: Inversiones en organismos multilaterales	-
E	del cual: Inversiones en empresas relacionadas	-
F	del cual: Inversiones en capital de riesgo	-
G	del cual: Inversiones en sociedades de inversión	-
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones	-
J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	8,187
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	482
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deduciones	-
28	**Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1**	10,135
29	**Capital común de nivel 1 (CET1)**	65,301
	Capital adicional de nivel 1: instrumentos	
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,482
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,482
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**	3,482
	Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios	
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde las Institución	No aplica

	no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	
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)**	3,482
45	**Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)**	68,783
	Capital de nivel 2: instrumentos y reservas	
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	3,903
47	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2	-
48	Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2)	No aplica
49	de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
50 conservador	Reservas	1,436
51	**Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios**	5,339
	Capital de nivel 2: ajustes regulatorios	
52 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53 conservador	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
55 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	**Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2**	-
58	**Capital de nivel 2 (T2)**	5,339
59	**Capital total (TC = T1 + T2)**	74,122
60	**Activos ponderados por riesgo totales**	459,745
	Razones de capital y suplementos	
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	14.20%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	14.96%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.12%
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)	17.30%

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)	7.20%
	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)	1,436
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,139
78	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite)	-
79	Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas	-
	Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de emero de 2022)	
80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
81	Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	No aplica
82	Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual	-
83	Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amotizaciones y vencimientos)	-
84	Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual	-
85	Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-

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

Referencia	Descripción
1	Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
2	Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.
3	Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo, resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remediciones por beneficios definidos a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.

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

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

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

40 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
41	Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
42	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
43	Suma de los renglones 37 a 42.
44	Renglón 36, menos el renglón 43.
45	Renglón 29, más el renglón 44.
46	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental ni en el Capital Básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
47	Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
48	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
50	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.
51	Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.
52 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
54 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
55 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
56	Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
57	Suma de los renglones 52 a 56.
58	Renglón 51, menos renglón 57.
59	Renglón 45, más renglón 58.
60	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.
61	Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
62	Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
63	Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
64	Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61, 65, 66 y 67.
65	Reportar 2.5%
66	Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
67	La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.

68	Renglón 61 menos 7%.
69	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
70	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
71	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
72	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
73	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
74	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
75	El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.
76	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
77	1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
78	Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
79	0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
80	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
81	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
82	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
83	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.
84	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
85	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)		
Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Efectivo y equivalentes de efectivo	53,597
BG2	Cuentas de Margen	1,081
BG3	Inversiones en instrumentos financieros	150,347
BG4	Deudores por reporto	4,847
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos financieros derivados	41,589
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(1,111)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	477,608
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	28,795

BG11	Bienes adjudicados (neto)	374
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	2,354
BG13	Inversiones permanentes	3,791
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta	14
BG15	Impuestos a la utilidad diferidos (neto)	6,205
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)	2,794
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	2,010
	Activos Intangibles (neto)	4,570
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	485,799
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	35,734
	Valores Asignados por liquidar	7,743
BG19	Acreedores por reporto	72,573
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	8,526
BG22	Instrumentos financieros derivados	38,505
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	1
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	34,894
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por Impuestos a la Utilidad	1,061
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,077
	Pasivos por arrendamiento	2,119
	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	9,099
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	6,300
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	13,468
BG30	Capital ganado	61,966
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	248,799
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	455,305
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	72,728
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	14,522
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	8,525
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	-
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	1,389
BG41	Otras cuentas de registro	1,718,968

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 2023)				
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	1,466	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) $1,466
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	1,436	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) $1,436
14	Inversiones en deuda subordinada	26-B	-	
15	Inversiones en organismos multilaterales	26-D	-	
16	Inversiones en empresas relacionadas	26-E	-	
17	Inversiones en capital de riesgo	26-F	-	
18	Inversiones en sociedades de inversión	26-G	-	
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	8,187	BG 16 Activos

				Intangibles $4,570 más Gastos de Instalación $3,617
21	Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	482	BG 13 Inversiones Permanentes $ 482
	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	3,482	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,482
30	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental	33	-	
31	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S	46	3,903	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,903
32	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario	47	-	
33	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	-	
	CAPITAL CONTABLE			
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	13,468	BG 29 Capital Social $10,671 más Prima en Venta de Acciones $2,797
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	50,948	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores $50,948
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	810	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo $810
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	10,211	BG 30 Reservas de Capital $8,001 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta ($304) más Remedición por beneficios definidos a los empleados ($481)

				más Resultado Neto $2,995
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
	CUENTAS DE ORDEN			
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
	CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL			
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

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

Identificador	Descripción
1	Crédito mercantil.
2	Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.
3	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales.
4	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.
5	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado.
6	Cualquier acción propia que la Institución adquiera de conformidad con lo previsto en la Ley, que no hayan sido restadas; considerando aquellos montos adquiridos a través de las inversiones en índices de valores y el monto correspondiente a las inversiones en sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18
7	Inversiones en acciones de sociedades distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) de la fracción I del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas, considerando aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18.
8	Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.
9	Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.
10	Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.
11	Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.
12	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales.
13	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el

	requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
14	Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
15	Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
16	Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
17	Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
18	Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
19	Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de estas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
20	Cargos diferidos y pagos anticipados.
21	La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos que tengan ser deducidas de acuerdo con el Artículo 2 Bis 8 de las presentes disposiciones.
23	Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.
24	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al crédito mercantil.
25	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a otros intangibles (distintos al crédito mercantil).
26	Pasivos del plan de pensiones por beneficios definidos asociados a inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos.
27	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al plan de pensiones por beneficios definidos.
28	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales distintos los de las referencias 24, 25, 27 y 33.
29	Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.
30	Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital Básico No Fundamental.
31	Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.
32	Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario.
33	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a cargos diferidos y pagos anticipados.
34	Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-Q de las presentes disposiciones.
35	Resultado de ejercicios anteriores.
36	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a valor razonable.
37	Resultado neto y resultado por valuación de títulos disponibles para la venta.

38	Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.
39	Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a costo amortizado.
41	Efecto acumulado por conversión.
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios.
43	Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.
44	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
45	El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
46	Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
47	El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
48	Derogado

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)		
Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	55,251	4,420
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,054	84
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA´s	3,143	251
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's, UMA´s o con rendimiento referido al INPC	74	6
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	2,721	218
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	2,359	189
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	64	5
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	44	4
Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	23	2
Grupo I-B (ponderados al 4%)	-	-
Grupo II (ponderados al 0%)	-	-
Grupo II (ponderados al 10%)	-	-
Grupo II (ponderados al 20%)	-	-
Grupo II (ponderados al 50%)	-	-

Grupo II (ponderados al 100%)	-	-
Grupo II (ponderados al 120%)	-	-
Grupo II (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 2.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 10%)	935	75
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	4,184	335
Grupo III (ponderados al 25%)	1	0
Grupo III (ponderados al 50%)	353	28
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	274	22
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	2,410	193
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	156	12
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	12	1
Grupo VI (ponderados al 20%)	2,692	215
Grupo VI (ponderados al 25%)	1,878	150
Grupo VI (ponderados al 30%)	7,380	590
Grupo VI (ponderados al 40%)	8,008	641
Grupo VI (ponderados al 50%)	37,606	3,008
Grupo VI (ponderados al 70%)	34	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	21,375	1,710
Grupo VI (ponderados al 85%)	3,705	296
Grupo VI (ponderados al 100%)	56,639	4,531
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	154	12
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	19,012	1,521
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	12	1
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	11,004	880
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	130,669	10,454
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	71	6
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,655	132
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%)	448	36
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%)	6,879	550
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,311	265
Grupo IX (ponderados al 100%)	29,799	2,384
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	36	3
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 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	2,004	160
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	19	2
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	11	1

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional		
Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Indicador de Negocio	42,291	3,383

CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

Al 31 de marzo del 2023, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 12.73% (Índice regulatorio más suplemento de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local más Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales), por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

Scotiabank-Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio		
Referencia	Características	Opciones
1	Emisor	Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2	Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg	N.A.
3	Marco legal	Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
	Tratamiento regulatorio	
4	Nivel de capital con transitoriedad	N.A.
5	Nivel de capital sin transitoriedad	Fundamental
6	Nivel del instrumento	Institución de crédito sin consolidar subsidiarias
7	Tipo de Instrumento	Acción series "F" y "B"
8	Monto reconocido en el capital regulatorio	13,468,335,561
9	Valor nominal del instrumento	Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A	Moneda del instrumento	Pesos mexicanos
10	Clasificación contable	Capital
11	Fecha de emisión	13-ene-01
12	Plazo del instrumento	Perpetuidad
13	Fecha de vencimiento	Sin vencimiento
14	Cláusula de pago anticipado	No
15	Primera fecha de pago anticipado	N.A.
15A	Eventos regulatorios o fiscales	No
15B	Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado	N.A.
16	Fechas subsecuentes de pago anticipado	N.A.
	Rendimientos / dividendos	
17	Tipo de rendimiento / dividendo	Fijo o Variable
18	Tasa de Interés /Dividendo	La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19	Cláusula de cancelación de dividendos	Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20	Discrecionalidad en el pago	Parcialmente discrecional.
21	Cláusula de aumento de intereses	No
22	Rendimientos / dividendos	No Acumulable
23	Convertibilidad del instrumento	N.A.

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

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

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

14	Especificar si el título incluye una cláusula de pago anticipado por el emisor donde se ejerza el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.
15	Fecha en la que el emisor puede, por primera vez, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.
15A	Especificar si la cláusula de pago anticipado considera eventos regulatorios o fiscales.
15B	Especificar el precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado.
16	Fechas en la que el emisor puede, posterior a la especificada en la referencia 15, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.
17	Especificar el tipo de rendimiento/dividendo que se mantendrá durante todo el plazo del título.
18	Tasa de interés o índice al que hace referencia el rendimiento/dividendo del título
19	Especificar si el título incluye cláusulas que prohíban el pago de dividendos a los poseedores de títulos representativos del capital social cuando se incumple con el pago de un cupón o dividendo en algún instrumento de capital.
20	Discrecionalidad del emisor para el pago de los intereses o dividendos del título. Si la Institución en cualquier momento puede cancelar el pago de los rendimientos o dividendos deberá seleccionarse (Completamente discrecional); si solo puede cancelarlo en algunas situaciones (Parcialmente discrecional) o si la institución de crédito no puede cancelar el pago (Obligatorio).
21	Especificar si en el título existen cláusulas que generen incentivos a que el emisor pague anticipadamente, como cláusulas de aumento de intereses conocidas como "Step-Up".
22	Especificar si los rendimientos o dividendos del título son acumulables o no.
23	Especificar si el título es convertible o no en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.
24	Condiciones bajo las cuales el título es convertible en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.
25	Especificar si el título se convierte en su totalidad o solo una parte cuando se satisfacen las condiciones contractuales para convertir.
26	Monto por acción considerado para convertir el título en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero en la moneda en la que se emitió dicho instrumento.
27	Especificar si la conversión es obligatoria u opcional.
28	Tipo de acciones en las que se convierte el título.
29	Emisor del instrumento en el que se convierte el título.
30	Especificar si el título tiene una característica de cancelación de principal.
31	Condiciones bajo las cuales el título disminuye su valor.
32	Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el título baja de valor en su totalidad o solo una parcialmente.
33	Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el instrumento baja de valor permanente o de forma temporal.
34	Explicar el mecanismo de disminución de valor temporal.
35	Posición más subordinada a la que está subordinado el instrumento de capital que corresponde al tipo de instrumento en liquidación.
36	Especificar si existen o no características del título que no cumplan con las condiciones establecidas en los anexos 1-Q, 1-R y 1-S de las presentes disposiciones.
37	Especificar las características del título que no cumplen con las condiciones establecidas en los anexos 1-Q, 1-R y 1-S de las presentes disposiciones.

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 diferentes a las anteriores	-
España	-	Luxemburgo	-		
Estados Unidos	-	México	-		

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)		
Referencia	Rubro	Mar-23[1)]
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	7,638
1a	No aplica	
2	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo	459,745
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	1.63%
3a	No aplica	
4	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones	814,737
5	Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	0.94%
5a	No aplica	
6a	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No
6b	"Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No
6c	En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?	0%

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

Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

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

Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en 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 2023 fue de $23.75 millones y su promedio durante el primer trimestre de 2023 fue de $15.64 millones mismo que corresponde a un 0.021% del capital neto ($74,675 millones a febrero 2023, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del primer trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos	Cierre Marzo 2023	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	955,409	882,957
Mercado de Dinero	58,320	57,589
Tipo de cambio		
Cash	5,902	7,469
Derivados	157,947	175,950
Capitales		
Derivados	13,866	16,776

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre Marzo 2023	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	15.49	13.86
Tipo de cambio	18.21	5.88
Capitales	-	-
VaR Global	23.75	15.64

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 2023 muestra una pérdida máxima de $315.7. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, México 1994 por el denominado "Error de diciembre" y México 1997 por el efecto de la "crisis del rublo" y la crisis financiera asiática.

Asimismo, mensualmente se realizan pruebas de "backtesting" para comparar las pérdidas y ganancias teóricas y reales con el valor en riesgo observado y, en consecuencia, en su caso calibrar los modelos utilizados. El nivel de eficiencia del modelo se basa en el enfoque establecido por el BIS. Respecto de las pruebas de backtesting, durante el primer trimestre de 2023, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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

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

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

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

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de marzo 2023 así como el promedio del primer trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)[2]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US	17,546	32,749
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	89,512	89,364

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

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el primer trimestre de 2023 de 133% y 108% respectivamente.

[2] Cifras previas al cierre de marzo 2023.

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

Para la medición del riesgo de tasas de interés se emplean indicadores tales como sensibilidad del valor económico y sensibilidad de margen. Para el cálculo de dichos indicadores se utilizan brechas de reprecio, construidas con base en las tasas de referencia de activos y pasivos; para el caso de posiciones a tasa fija son modeladas acorde a sus amortizaciones y vencimientos contractuales, mientras que aquellas posiciones referenciadas a una tasa flotante se modelan en función a su próxima fecha de reprecio. La metodología para el cálculo de los indicadores considera supuestos de estabilidad de depósitos de exigibilidad inmediata y de prepago de hipotecas. El primero consiste en un análisis de cosechas a fin de evaluar la permanencia de los depósitos mientras que el segundo considera un análisis histórico para estimar una tasa de prepago aplicable al portafolio de créditos.

Tanto la sensibilidad del valor económico como de la sensibilidad de margen contemplan un impacto de ± 100 puntos base en las tasas de interés y considera la máxima pérdida esperada por escenario. Esta medición se realiza de manera semanal y se reporta a los miembros del Comité de Activos y Pasivos, al Comité de Riesgos y Consejo de Administración en sus respectivas sesiones.

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

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de marzo 2023 y en promedio para el primer trimestre de 2023 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Valor Económico (+100 pbs)	(1,109)	(1,126)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(206)	(219)

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].	74,980	71,039
Derivados de Cobertura	76,438	70,696

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 2023 y el promedio del primer trimestre del 2023 fueron $2,760 millones y $3,171 millones, respectivamente.

Riesgo de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del primer trimestre corresponde a $41; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.

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

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

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

Al cierre del primer trimestre de 2023, el Banco mantiene $851 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

Información metodológica

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito[1]. (Cifras al 31 de marzo 2023)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.3%	3.3%
Consumo	3.7%	11.5%
Cartera Comercial	0.6%	4.0%
Total	**0.7%**	**4.2%**

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

Parámetros de Riesgo[1]. (Cifras a millones al 31 de marzo 2023)	EI2[2].	PI	SP
Hipotecas	192,939	1.63%	18.04%
Consumo	50,287	4.79%	72.22%
Cartera Comercial	294,282	1.68%	44.26%

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

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

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de marzo de 2023.

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 2023 y en promedio durante el tercer trimestre de 2023, 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 0.89% y 0.89% 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 del Indicador de Negocio, mismo que entró en vigor en enero 2023.

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de enero - marzo 2023, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por $48.4 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de marzo 2023 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman $243.9 millones, donde $4.5 millones corresponden a riesgo operacional y $239.4 millones a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)
Periodo Reportado: enero 2023 – marzo 2023 (T1 2023)
Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez[3]

(Cifras en millones de pesos)		Calculo Individual T1 2023		Calculo Consolidado T1 2023	
		Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES					
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	97,051.25	No aplica	97,051.25
SALIDAS DE EFECTIVO					
2	Financiamiento minorista no garantizado	171,917.33	13,826.38	171,917.33	13,826.38
3	Financiamiento estable	99,473.38	6,581.98	99,473.38	6,581.98
4	Financiamiento menos estable	72,443.95	7,244.39	72,443.95	7,244.39
5	Financiamiento mayorista no garantizado	225,278.66	85,860.31	225,278.66	85,860.31
6	Depósitos operacionales	94,744.43	23,019.86	94,744.43	23,019.86
7	Depósitos no operacionales	125,726.60	58,032.82	125,726.60	58,032.82
8	Deuda no garantizada	4807.629622	4807.629622	4807.629622	4807.629622
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	416.6676667	No aplica	416.6676667
10	Requerimientos adicionales:	242,456.68	18,415.30	242,456.68	18,415.30
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,302.68	5,319.87	7,302.68	5,319.87
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	0	0	0	0
13	Líneas de crédito y liquidez	235,154.00	13,095.42	235,154.00	13,095.42
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	37.11434444	37.11434444	37.11434444	37.11434444
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,414.80	2,414.80	2,414.80	2,414.80
16	TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	120,970.57	No aplica	120,970.57
ENTRADAS DE EFECTIVO					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	5,183.99	351.6656778	5,183.99	351.6656778
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	46,431.04	31,887.24	46,431.04	31,887.24
19	Otras entradas de efectivo	15,884.74	15,884.74	15,884.74	15,884.74
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	67,499.77	48,123.64	67,499.77	48,123.64
					Importe ajustado
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	97,051.25	No aplica	97,051.25
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	72,846.93	No aplica	72,846.93
23	COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]	No aplica	133.12	No aplica	133.12

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

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

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

Durante marzo 2023, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):[4]

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por $51,268 millones y depósitos a plazo tradicionales por $34,199 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por $1,846 millones y $2,760 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por $12,809 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de $17,842 millones y por operaciones de call money de $5,992 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por $17,248 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de $89,512 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; $44,028 millones en títulos de deuda de nivel 1, $36,531 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por $7,627 millones y $1,326 millones en títulos de nivel 2.

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

Promedio de cuarto trimestre 2022: 129% – promedio del primer trimestre 2023: 133% El coeficiente de cobertura de liquidez creció 400 pb respecto del cuarto trimestre del 2022, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron $3,557 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN $12,235 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de $697 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco decreció en $4,969 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en $4, millones.

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

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

Evolución de Activos Líquidos T1-2023	Enero	Febrero	Marzo
Efectivo	9%	9%	9%
Reservas en el Banco Central	53%	37%	41%
Nivel 1	37%	53%	49%
Nivel 2ª	1%	1%	1%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento	Enero	Febrero	Marzo
CAPTACION TRADICIONAL			
Depósitos de exigibilidad inmediata	43%	43%	46%
Depósitos a plazo			
Del público en general	41%	42%	42%
Mercado de dinero	7%	7%	5%
Títulos de crédito emitidos	2%	2%	2%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	4%	3%	3%
De largo plazo	3%	3%	2%
Total	100%	100%	100%

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

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

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

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

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

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

Exposición Potencial Futura (marzo 2023) (Cifras en millones de pesos)	
Con contrato de compensación	3,912
Sin contrato de compensación	6,935
Posibles llamadas de margen (marzo 2023)	
Colateral en Tránsito	36
Downgrade (Marzo 2023)	
Baja calificación 3 niveles	2,760

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de marzo 2023 es la siguiente:

Scotiabank-Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	955,409
Tipo de cambio	157,947
Capitales	13,866
Total	**1,127,222**

g) El descalce en divisas;

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

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

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el primer trimestre del 2023, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -3.54% al cierre de marzo del 2023 y en promedio durante primer trimestre del 2023 fue de -4.26%.

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

Concentración de Depósitos[6]	Límite MM
Concepto	
Concentración de Depósitos (MXN)	9,000 MXN
Concentración de Depósitos (USD)	150 USD

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

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

[6] Sujeto a excepciones para algunos nombres.

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

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

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

Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con las siguientes exposiciones a finales de marzo 2023.

Descripción [7]	Promedio T1 2023	Marzo 2023
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	7,061	9,465
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	45,126	51,899
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	42	41
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	40	39
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	42	41
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	40	39

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

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

Los resultados al cierre de marzo 2023 y el promedio del primer trimestre de 2023 son:

Scotiabank [8]	Posición (Cierre)[9]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	17,546	32,749
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	89,512	89,364

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.

[7] Sujeto a excepciones para algunos nombres.
[8] Sujeto a excepciones para algunos nombres.
[9] Cifras previas al cierre de marzo 2023.

II. Información cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- Cálculo de CCL (Coeficiente de Cobertura de Liquidez)
- Cálculo de CFEN (Coeficiente de Financiamiento Estable Neto)
- Cómputo de Activos Líquidos
- Cálculo de LDR (Loan to Deposit Ratio)
- Monitoreo de la concentración de fondeo profesional
- Monitoreo de Brechas de Liquidez
- Monitoreo de Concentración de Depósitos
- Monitoreo de Depósitos con Bancos
- Monitoreo del Portafolio de Inversión

- Monitoreo de créditos cedidos como garantía de fondeo
- Pruebas de Estrés de Liquidez
- Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez
- Reportes periódicos al Comité de Activos y Pasivos de la Institución
- Reportes periódicos al Comité de Riesgos
- Reportes al Consejo de Administración
- Políticas y Manuales alusivos a la Administración del Riesgo de Liquidez
- Plan de Contingencia para Riesgos de Solvencia y Liquidez

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

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

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

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

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

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

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

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

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

e) Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el primer trimestre de 2023, 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 2023, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)

Periodo Reportado: primer trimestre del 2023

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto[10]

(Cifras en millones de pesos)		Cifras Individuales					Cifras Consolidadas				
		Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado
		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año	
1	Capital:	79,208.28	0.00	0.00	0.00	79,208.28	79,208.28	0.00	0.00	0.00	79,208.28
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	79,208.28	0.00	0.00	0.00	79,208.28	79,208.28	0.00	0.00	0.00	79,208.28
3	Otros instrumentos de capital.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
4	Depósitos minoristas:	0.00	205,738.97	2,178.36	21.91	191,733.23	0.00	205,738.97	2,178.36	21.91	191,733.23
5	Depósitos estables.	0.00	90,720.04	994.40	19.06	87,147.78	0.00	90,720.04	994.40	19.06	87,147.78
6	Depósitos menos estables.	0.00	115,018.93	1,183.96	2.85	104,585.45	0.00	115,018.93	1,183.96	2.85	104,585.45
7	Financiamiento mayorista:	0.00	334,474.36	33,449.54	19,695.17	146,741.49	0.00	334,474.36	33,449.54	19,695.17	146,741.49
8	Depósitos operacionales.	0.00	12,430.97	0.00	0.00	6,215.49	0.00	12,430.97	0.00	0.00	6,215.49
9	Otro financiamiento mayorista.	0.00	322,043.39	33,449.54	19,695.17	140,526.00	0.00	322,043.39	33,449.54	19,695.17	140,526.00
10	Pasivos interdependientes	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11	Otros pasivos:	3,352.78	32,939.41	0.00	3,866.19	3,866.19	3,352.78	32,939.41	0.00	3,866.19	3,866.19
12	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	3,352.78	0.00	0.00	0.00	0.00	3,352.78	0.00	0.00	0.00	0.00
13	Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	0.00	32,939.41	0.00	3,866.19	3,866.19	0.00	32,939.41	0.00	3,866.19	3,866.19
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	82,561.05	573,152.74	35,627.90	23,583.26	421,549.18	82,561.05	573,152.74	35,627.90	23,583.26	421,549.18
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	5,944.61	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	5,944.61
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
17	Préstamos al corriente y valores:	0.00	119,832.47	41,653.61	301,540.08	335,641.96	0.00	119,832.47	41,653.61	301,540.08	335,641.96
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	1,588.62	0.00	0.00	158.86	0.00	1,588.62	0.00	0.00	158.86
19	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	10,546.88	3,777.95	2,218.74	5,689.75	0.00	10,546.88	3,777.95	2,218.74	5,689.75
20	Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	89,216.98	34,941.15	134,212.23	169,694.11	0.00	89,216.98	34,941.15	134,212.23	169,694.11
21	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
22	Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:	0.00	3,206.75	3,376.89	187,854.08	150,582.99	0.00	3,206.75	3,376.89	187,854.08	150,582.99
23	Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	420.22	442.38	24,709.11	16,492.22	0.00	420.22	442.38	24,709.11	16,492.22
24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	15,693.48	0.00	1,964.14	9,516.26	0.00	15,693.48	0.00	1,964.14	9,516.26
25	Activos interdependientes.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
26	Otros Activos:	0.00	71,055.46	411.80	5,911.73	36,557.92	0.00	71,055.46	411.80	5,911.73	36,557.92
27	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00
28	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	No Aplica	2,240.76	0.00	0.00	1,904.65	No Aplica	2,240.76	0.00	0.00	1,904.65

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

29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	737.74	No Aplica	0.00	0.00	0.00	737.74
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,753.59	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,753.59
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		68,814.70	411.80	5,911.73	30,161.94	0.00	68,814.70	411.80	5,911.73	30,161.94
32	Operaciones fuera de balance.	No Aplica	233,781.80	0.00	0.00	11,689.09	No Aplica	233,781.80	0.00	0.00	11,689.09
33	Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	389,833.58	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	389,833.58
34	**Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**108.14**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**108.14**

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

Durante marzo 2023, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:

- Fondeo Estable Disponible:
  Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por $161,603 millones y depósitos a plazo tradicionales por $137,104 millones, Capital (fundamental y complementario) por $82,822 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por $18,200 millones y $12,615 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por $5,648 millones.
- Fondeo Estable Requerido:
  Fondeo Requerido ponderado por carteras de $338,690 y por operaciones mercado de dinero de $16,867 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por $14,552 millones, deducciones de capital por $10,167 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por $3,753 millones.

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

Promedio del cuarto trimestre del 2022: 110.84% – Promedio del primer trimestre del 2023: 108.14% (decremento: 270pb). El coeficiente de financiamiento neto disminuyó 270pb respecto al cuarto trimestre del 2022, esto debido principalmente a:

a. El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional disminuyó en MXN 8,108 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 4,641 millones.
b. El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas crecieron $1,085 millones.

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

Monto Computable (MXN MM)	Enero	Febrero	Marzo
Financiamiento Estable Disponible	426,602	420,054	417,991
Financiamiento Estable Requerido	387,442	387,985	394,073
Coeficiente de Fondeo Estable Neto	110.11%	108.27%	106.07%

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 2023 la posición accionaria de títulos para negociar asciende $15 millones de pesos, con una minusvalía de $(0.37) millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	2,930	0.45	0.53	(0.08)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	310,000	3.54	3.76	(0.22)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	125,000	0.48	0.46	0.02
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	155,000	3.10	3.24	(0.14)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	100,000	0.46	0.39	0.07
Scotiabank	Pública	1-ORBIA-*	20,000	0.79	0.72	0.07
Scotiabank	Pública	1-LASITE-B-1	100,000	0.75	0.67	0.08
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	11,000	5.43	5.60	(0.17)
Total			**823,930**	**15.00**	**15.37**	**(0.37)**

Al cierre del primer trimestre del año 2023, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por $0.78 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	15,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	25,000	0.01	(0.02)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	100,390	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	50,751	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	59,379	0.07	(0.03)	0.04
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	133,390	0.23	(0.09)	0.14
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	79,698	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-FEMSA-UBD	28,089	0.11	-	0.11
Scotiabank	Pública	1-AMX-L	286,600	0.34	(0.01)	0.33

Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	1,806	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	4,600	0.20	-	0.20
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	154	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	3,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	1,004	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	3,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	327,705	-	(0.22)	(0.22)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	58,683	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	16,008	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	55,000	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1-FEMSA-UBD	39,483	0.04	(0.05)	(0.01)
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	16,613	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1B-NAFTRAC-ISHRS	15,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	1,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	798	-	(0.05)	(0.05)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	7,128	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-XLC-*	1,600	0.12	-	0.12
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	30,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	668	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	40,365	-	(0.06)	(0.06)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	57,788	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	90,000	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	10,000	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	111,298	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ORBIA-*	16,356	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1-LASITE-B-1	28,767	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	100	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	4,300	-	(0.13)	(0.13)
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	6,469	0.10	-	0.10
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	12,000	0.43	(0.32)	0.11
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	70,459	0.16	(0.07)	0.09
Scotiabank	Pública	1I-XLC-*	3,000	0.05	(0.05)	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	8,366	0.01	(0.11)	(0.10)
Total			**1,820,815**	**2.05**	**(1.27)**	**0.78**

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

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

Al 31 de marzo de 2023, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de $5.10 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de $ 3.75 millones de pesos y el requerimiento por riesgo especifico asciende a la cantidad de $1.35 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición	Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado	16.86	-	16.86	22.23%	3.75
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	15.00	-	15.00	8.00%	1.20
Índices accionarios	1.86	-	1.86	4.00%	0.07
Requerimiento por riesgos específico	1.86	-	1.86	4.00%	0.07
Total Requerimiento de capital					**5.10**

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

Rerferencia	Rubro	dic-22	mar-22
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)	712,010	732,429
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,616)	(10,135)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	701,395	722,293
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)	7,019	8,290
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	3,819	4,478
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)	(1,941)	(2,820)
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)	8,897	9,948
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	3,224	4,847
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(1,223)	(846)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	-	0
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-	0.0
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	2,001	4,002
Otras exposiciones fuera de balance			
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	264,565	248,799
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(168,959)	(170,305)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	95,606	78,495
Capital y exposiciones totales			
20	Capital de Nivel 1	68,247	68,783
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	807,899	814,737
Coeficiente de apalancamiento			
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	8.45%	8.44%

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

Rerferencia	DESCRIPCION	dic-22	mar-23
1	Activos totales	751,487	778,865
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	(612)	(482)
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	(27,355)	(31,642)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(1,223)	(846)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	95,606	78,495
7	Otros ajustes	(10,003)	(9,653)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	807,898	814,737

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

Rerferencia	DESCRIPCION	dic-22	dic-23
1	Activos totales	751,487	778,865
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(36,252)	(41,589)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(3,224)	(4,847)
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	712,010	732,429

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

CONCEPTO/PERIODO	dic-22	mar-23	Variación
Capital Básico [1)]	68,247	68,783	0.06%
Activos Ajustados[2)]	807,899	814,737	-0.07%
Razón de Apalancamiento [3)]	8.45%	8.44%	-1 pb

1). Reportado en la fila 20

2). Reportado en la fila 21 y

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

Cifras previas a la réplica de Banxico

Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la Razón de Apalancamiento por el periodo de diciembre de 2022 a marzo de 2023.

El indicador se ubicó en 8.44%, 1pb inferior respecto al trimestre anterior, activos ajustados (-7 pbs) debido principalmente al incremento en las exposiciones dentro del balance (netas excluyendo instrumentos financieros derivados y SFT) (-21 pbs) se compensan parcialmente con la disminución en las exposiciones fuera del balance (+18 pbs). Respecto al capital nivel 1 (+6 pbs) la mejora en el trimestre fue por menores deducciones.

TABLA I.2
NOTAS AL FORMATO DE REVELACIÓN ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

Referencia	Explicación
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico
	(menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.
2	Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.
3	Suma de las líneas 1 y 2
4	Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) *recibidas,* siempre que se cumpla con las condiciones siguientes: **a)** Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución. **b)** La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma

	frecuencia. **c)** El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda. **d)** El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente. **e)** El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos. En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.
5	Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.
	En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7	Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
10	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11	Suma de las líneas 4 a 10
12	Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)
13	Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes: **a)** Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación. **b)** Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento. **c)** Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar. **d)** Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo. El monto se debe registrar con signo negativo.
14	Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.
15	Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado. Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.
16	Suma de las líneas 12 a 15
17	Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.
18	Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%. El monto se debe registrar con signo negativo.
19	Suma de las líneas 17 y 18
20	Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

21	Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19
22	Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

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

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

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

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

Agencias Calificadoras

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

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

Dividendos

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de marzo del 2023, 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$63,550 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN$53,597 millones de pesos.

Adicionalmente:

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

Inversiones relevantes en capital

Al 31 de marzo de 2023, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.

Instrumentos Financieros Derivados

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

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

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

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

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

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 (*Swaps*) en especie y por diferenciales.	✓	✓				

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

2). (MR) Mercados reconocidos

3). (ME) Mercados extrabursátiles

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 2023 y en promedio para el primer trimestre de 2023 es de:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)11	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	17,546	32,749
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	89,512	89,364

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

[11] Cifras previas al cierre de marzo 2023.

Inventario de modelos de derivados

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

Instrumentos a Valor Razonable

Clase de activo	Derivado	Tipo	Breve descripción
Tasas de interés	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. $$\text{Cap} = \sum_{i=1}^{n} \text{Caplet}_i$$ • Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet. $$\text{Floor} = \sum_{i=1}^{n} \text{Floorlet}_i$$
		Binaria	La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo: • Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto nocional 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 nocional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).
	IRS		El intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).
	CCIRS		Intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.
Tipo de cambio	Opciones	Europea	En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black–Scholes–Merton.
		Americana	El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)
		Binaria	Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción. A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.
		Barrera	Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento S_T, sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t<T}$, son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente S_T alcance un umbral preestablecido H llamado barrera de la opción.
	Forward	Forward OTC	Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

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

Instrumentos valuados a costo

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

Políticas Líneas de Crédito

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

Tipos de Operación que son ofrecidos en función al tipo de acreditado

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

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

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

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

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

Sujetos de Crédito

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

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

Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

Idoneidad del Cliente

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

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

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

Políticas de VaR

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

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

b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

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

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

Bonos de Tasa Flotante

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

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

Bonos Cupón Cero

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

Riesgo de Crédito

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

Sensibilidad del Pasivo

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

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

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

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

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2023 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el primer trimestre de 2023 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por inefectividad.

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

c. Información de Riesgos por el uso de Derivados

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

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

Al cierre de marzo de 2023 y promedio del primer trimestre 2023 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)12	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	89,512	89,364

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

En donde:

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

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

[12] Cifras previas al cierre de marzo 2023.

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	17,546	14,779	14,765	14,751
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(2,767)	(2,781)	(2,796)

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

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

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

Vega

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.
Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

Rho

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

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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, 2023:

Scotiabank	0-3 Meses	3 - 12 Meses	1 - 3 Años	3 - 5 Años	5 - 10 Años	10 - 30 Años	Total
Swaps	(17,639.15)	(5,530.19)	(246,330.40)	130,512.45	38,481.49	(60,128.23)	(160,634.03)
CCS	24,720.66	(2,255.17)	(1,493.87)	344.74	258.56	(28.73)	21,546.19
Caps&Floors	158.01	(57.45)	158.01	57.45	-	-	316.02
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total DERIVADOS	**7,239.52**	**(7,842.81)**	**(247,666.26)**	**130,914.64**	**38,740.05**	**(60,156.96)**	**(138,771.82)**

1). Cifras expresadas en pesos

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

a) Bajo el escenario probable una pérdida de (161.09) Millones de pesos.
b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (322.18) Millones de pesos.
c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (798.5) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock(+/-)	P&L	Stress 1 Shock(+/-)	P&L	Stress 2 Shock(+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	(0.14)	65.97	50.00	(6.94)	100.00	(13.88)	200.00	(27.75)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	-	(0.01)	0.10	-	0.40	-	1.00	-
a FX %	Forwards	85.54	1,541.49	0.10	(154.15)	0.20	(308.30)	0.50	(770.75)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
Total					**(161.09)**		**(322.18)**		**(798.50)**

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

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 31 de marzo de 2023 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options BNPUI5.INDX	61,647.00	2,152.00	27,961.00
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options EZU.P	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	93,577.00	1,953.00	35,650.00
Options MCHI.OQ	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options NVDA.OQ	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
TOTAL	**155,224.00**	**4,105.00**	**63,611.00**

1). Cifras expresadas en pesos

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 BNPUI5.INDX	(6,164.70)	(18,494.10)	(30,823.50)
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options EZU.P	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	(9,357.70)	(28,073.10)	(46,788.50)
Options MEXIBX.INDX	-	-	-
Options MXSXAE.INDX	-	-	-
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
TOTAL	(15,522.40)	(46,567.20)	(77,612.00)

1). Cifras expresadas en pesos

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

Escenarios al alza	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options BNPUI5.INDX	3,082.35	9,247.05	12,329.40
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options EZU.P	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	4,678.85	14,036.55	18,715.40
Options MEXIBX.INDX	-	-	-
Options MXSXAE.INDX	-	-	-
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
TOTAL	7,761.20	23,283.60	31,044.80

1). Cifras expresadas en pesos

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:

Scotiabank	Monto
Probable	(15,522.40)
Poco Probable	(46,567.20)
Muy poco Probable	(77,612.00)

1). Cifras expresadas en pesos

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 2023 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	MXN	48,800,000	(207,800,000)
CLIENTE 2	MXN	430,000,000	(492,000,000)
CLIENTE 3	MXN	561,900,000	(264,600,000)
CLIENTE 4	MXN	50,800,000	(84,100,000)
CLIENTE 5	MXN	823,400,053	(1,422,100,000)
CLIENTE 6	USD	70,470,000	(107,690,000)
CLIENTE 7	USD	45,800,000	(25,720,000)
CLIENTE 8	USD	252,900,000	(345,200,000)
CLIENTE 9	USD	2,210,000	(890,000)
CLIENTE 10	USD	7,400,000	(9,330,000)
CLIENTE 11	USD	150,000	(100,000)
CLIENTE 12	USD	10,430,000	(6,900,000)
CLIENTE 13	USD	260,000	-
CLIENTE 14	USD	3,660,000	(3,200,000)
CLIENTE 15	MXN	140,500,000	(352,300,000)
CLIENTE 16	MXN	179,300,000	(229,500,000)
CLIENTE 17	MXN	7,400,000	-
CLIENTE 18	MXN	1,622,800,000	(576,900,000)
CLIENTE 19	MXN	351,675,414	(1,128,878,132)
CLIENTE 20	MXN	8,400,000	(1,700,000)
CLIENTE 21	USD	14,090,000	(5,630,000)
CLIENTE 22	USD	2,710,000	(42,550,000)
CLIENTE 23	USD	19,380,000	(20,020,000)
TOTAL		**4,654,435,467**	**(5,327,108,132)**

1). Cifras expresadas en pesos

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

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
C67377	13/03/2023	A	usd/mxn		82,000,000	1,799,080,000	
C67399	13/03/2023	A	mxn/usd		1,799,080,000	82,000,000	
SDR945	09/02/2023	A	mxn	6,000,000	6,000,000	6,000,000	
SDR976	24/02/2023	A	mxn	215,000,000	215,000,000	215,000,000	
SDS008	26/02/2023	A	mxn	6,185,333	6,185,333	6,185,333	
SDS009	26/02/2023	A	mxn	6,185,333	6,185,333	6,185,333	
SDS012	09/02/2023	A	mxn	6,000,000	6,000,000	6,000,000	
SDS024	28/02/2023	A	mxn	350,000,000	350,000,000	350,000,000	
SDS037	28/02/2023	A	mxn	350,000,000	350,000,000	350,000,000	
SDS081	30/01/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SDS082	09/02/2023	A	mxn	5,933,242	5,933,242	5,933,242	
SDS085	14/03/2023	A	mxn	8,997,051	8,997,051	8,997,051	
SDS099	30/01/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SDS111	09/02/2023	A	mxn	5,933,242	5,933,242	5,933,242	
SDS116	10/02/2023	A	mxn	4,000,000	4,000,000	4,000,000	
SDS120	02/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDS125	10/02/2023	A	mxn	4,000,000	4,000,000	4,000,000	
SDS143	03/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDS186	06/03/2023	A	mxn	220,000,000	220,000,000	220,000,000	
SDS200	10/02/2023	A	mxn	3,000,000	3,000,000	3,000,000	
SDS225	14/03/2023	A	mxn	8,997,051	8,997,051	8,997,051	
SDS233	07/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDS248	07/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDS287	10/02/2023	A	mxn	3,000,000	3,000,000	3,000,000	
SDS324	08/03/2023	A	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDS347	14/01/2023	A	mxn	180,000,000	180,000,000	180,000,000	
SDS585	03/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDS601	09/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDS602	26/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDS612	25/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDS615	24/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDS628	09/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDS632	12/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDS640	13/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDS677	22/02/2023	A	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDS735	02/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDS773	14/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SDS774	14/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SDS871	10/01/2023	A	mxn	8,021,531	8,021,531	8,021,531	
SDS909	10/01/2023	A	mxn	8,021,531	8,021,531	8,021,531	
SDT088	27/03/2023	A	mxn	215,000,000	215,000,000	215,000,000	
SDT168	29/03/2023	A	mxn	215,000,000	215,000,000	215,000,000	
SDT189	24/03/2023	A	mxn	170,000,000	170,000,000	170,000,000	
SDT235	28/02/2023	A	mxn	25,000,000	25,000,000	25,000,000	
SDT239	13/03/2023	A	mxn	15,000,000	15,000,000	15,000,000	
SDT241	13/03/2023	A	mxn	15,000,000	15,000,000	15,000,000	
SDT271	28/02/2023	A	mxn	25,000,000	25,000,000	25,000,000	
SDT283	13/03/2023	A	mxn	15,000,000	15,000,000	15,000,000	
SDT286	13/03/2023	A	mxn	15,000,000	15,000,000	15,000,000	
SDT307	19/01/2023	A	mxn	330,000,000	330,000,000	330,000,000	
SDT309	01/03/2023	A	mxn	80,000,000	80,000,000	80,000,000	
SDT346	01/03/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDT413	10/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT479	15/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDT516	20/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT586	21/03/2023	A	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDT632	22/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT709	10/03/2023	A	usd	342,543	342,543	342,543	
SDT718	10/03/2023	A	usd	342,543	342,543	342,543	
SDT753	23/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDT771	31/01/2023	A	mxn	515,776	515,776	515,776	
SDT773	28/02/2023	A	mxn	970,909	970,909	970,909	
SDT790	28/02/2023	A	mxn	833,905	833,905	833,905	
SDT802	23/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDT814	13/02/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDT835	19/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDT845	13/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDT861	13/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDT864	31/01/2023	A	mxn	515,776	515,776	515,776	
SDT880	23/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDT888	28/02/2023	A	mxn	970,909	970,909	970,909	
SDT898	28/02/2023	A	mxn	833,905	833,905	833,905	
SDT921	23/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDT962	27/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU002	27/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU046	27/01/2023	A	mxn	160,000,000	160,000,000	160,000,000	
SDU074	27/01/2023	A	mxn	160,000,000	160,000,000	160,000,000	
SDU079	04/01/2023	A	mxn	6,704,256	6,704,256	6,704,256	
SDU080	27/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU090	04/01/2023	A	mxn	6,704,256	6,704,256	6,704,256	
SDU102	03/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU126	27/03/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDU137	04/01/2023	A	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SDU169	06/01/2023	A	mxn	60,000,000	60,000,000	60,000,000	
SDU171	29/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU239	29/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU283	09/02/2023	A	mxn	91,000,000	91,000,000	91,000,000	
SDU289	30/03/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDU326	11/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDU371	31/03/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU473	26/01/2023	A	mxn	670,000,000	670,000,000	670,000,000	
SDU572	27/02/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU589	31/03/2023	A	usd	317,605	317,605	317,605	
SDU590	31/03/2023	A	usd	317,605	317,605	317,605	
SDU592	13/02/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDU593	27/02/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU623	19/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU784	23/02/2023	A	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDU810	10/03/2023	A	mxn	49,450,718	49,450,718	49,450,718	
SDU817	10/03/2023	A	mxn	49,450,718	49,450,718	49,450,718	
SDU861	24/03/2023	A	mxn	90,000,000	90,000,000	90,000,000	
SDU870	23/02/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDU875	24/03/2023	A	mxn	90,000,000	90,000,000	90,000,000	
SDV007	13/02/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDV026	03/02/2023	A	mxn	80,000,000	80,000,000	80,000,000	
SDV054	13/02/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDV071	06/02/2023	A	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDV151	22/03/2023	A	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDV183	14/02/2023	A	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SDV185	09/01/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SDV240	26/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV280	26/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV281	30/01/2023	A	usd	12,000,000	12,000,000	12,000,000	
SDV291	26/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV293	31/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV309	31/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV324	31/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV346	30/01/2023	A	usd	12,000,000	12,000,000	12,000,000	
SDV359	10/02/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV362	10/02/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV393	15/02/2023	A	mxn	105,000,000	105,000,000	105,000,000	
SDV398	09/01/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SDV414	30/01/2023	A	mxn	2,140,967	2,140,967	2,140,967	
SDV418	30/01/2023	A	mxn	2,140,967	2,140,967	2,140,967	
SDV423	16/02/2023	A	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV457	30/01/2023	A	mxn	2,934,000	2,934,000	2,934,000	
SDV474	09/02/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SDV475	17/02/2023	A	mxn	5,714,300	5,714,300	5,714,300	
SDV485	30/01/2023	A	mxn	2,934,000	2,934,000	2,934,000	
SDV491	17/02/2023	A	mxn	5,714,300	5,714,300	5,714,300	
SDV494	09/02/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
MNF363	30/01/2023	A	usd	12,000,000		12,000,000	
MNF364	31/01/2023	A	mxn	100,000,000		100,000,000	
MNF368	28/02/2023	A	usd	2,799,000		2,799,000	
SDV611	30/01/2023	A	mxn	1,360,000	1,360,000	1,360,000	
SDV615	20/02/2023	A	mxn	10,700,000	10,700,000	10,700,000	
SDV625	20/02/2023	A	mxn	10,700,000	10,700,000	10,700,000	
SDV632	30/01/2023	A	mxn	1,360,000	1,360,000	1,360,000	
SDV638	11/02/2023	A	mxn	109,038,997	109,038,997	109,038,997	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
MNF375	10/02/2023	A	mxn	36,917,525		36,917,525	
SDV670	28/02/2023	A	mxn	2,626,389	2,626,389	2,626,389	
SDV674	28/02/2023	A	mxn	2,626,389	2,626,389	2,626,389	
SDV693	24/02/2023	A	mxn	675,000,000	675,000,000	675,000,000	
SDV700	08/03/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
P16888	28/02/2023	A	mxn	29,499,000			29,499,000
SDV716	08/03/2023	A	mxn	5,493,198	5,493,198	5,493,198	
SDV717	08/03/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDV721	08/03/2023	A	mxn	5,493,198	5,493,198	5,493,198	
SDV735	09/02/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SDV742	09/02/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SDV755	28/02/2023	A	usd	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SDV762	28/02/2023	A	usd	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SDV771	28/02/2023	A	usd	2,799,000	2,799,000	2,799,000	
SDV772	28/02/2023	A	usd	2,799,000	2,799,000	2,799,000	
SDV835	28/02/2023	A	usd	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SDV837	28/02/2023	A	usd	2,799,000	2,799,000	2,799,000	
SDV863	05/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDV870	15/02/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV878	31/01/2023	A	mxn	488,000,000	488,000,000	488,000,000	
P16910	28/02/2023	A	mxn	47,026,000			47,026,000
P16911	28/02/2023	A	mxn	29,499,000			29,499,000
SDV886	21/03/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDV914	09/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDV917	15/02/2023	A	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDV938	11/01/2023	A	mxn	80,000,000	80,000,000	80,000,000	
SDV940	15/02/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
P16922	28/02/2023	A	mxn	47,026,000			47,026,000
SDV958	08/03/2023	A	mxn	3,000,000,000	3,000,000,000	3,000,000,000	
SDV969	15/02/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDV975	11/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW012	30/01/2023	A	usd	12,000,000	12,000,000	12,000,000	
SDW018	18/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW029	27/03/2023	A	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDW032	01/02/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDW059	18/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDW078	02/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW085	03/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDW086	01/03/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDW087	09/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
P16949	20/02/2023	A	mxn	500,000,000			500,000,000
SDW100	09/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDW103	12/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDW112	13/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDW115	24/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
P16950	20/02/2023	A	mxn	500,000,000			500,000,000
SDW126	25/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW129	26/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDW134	28/02/2023	A	mxn	472,745	472,745	472,745	
SDW143	28/02/2023	A	mxn	472,745	472,745	472,745	
SDW150	24/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW153	08/03/2023	A	mxn	1,240,000	1,240,000	1,240,000	
SDW158	08/03/2023	A	mxn	1,240,000	1,240,000	1,240,000	
SDW193	24/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDW206	30/01/2023	A	mxn	1,500,000	1,500,000	1,500,000	
SDW212	30/01/2023	A	mxn	1,500,000	1,500,000	1,500,000	
SDW226	28/02/2023	A	mxn	221,191,216	221,191,216	221,191,216	
SDW262	26/01/2023	A	mxn	20,000,000	20,000,000	20,000,000	
SDW310	26/01/2023	A	mxn	70,000,000	70,000,000	70,000,000	
P16984	20/03/2023	A	mxn	300,000,000			300,000,000
P16985	20/03/2023	A	mxn	300,000,000			300,000,000
SDW375	28/02/2023	A	mxn	495,749	495,749	495,749	
SDW394	02/02/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW395	01/03/2023	A	mxn	800,000,000	800,000,000	800,000,000	
SDW400	30/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDW422	13/01/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDW469	28/02/2023	A	mxn	495,749	495,749	495,749	
SDW490	03/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SDW529	18/01/2023	A	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SDW551	02/02/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW589	08/02/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDW597	31/03/2023	A	mxn	9,763,872	9,763,872	9,763,872	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDW613	08/02/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW617	03/02/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDW649	09/02/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDW650	31/01/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
P17043	29/03/2023	A	mxn	216,666,667			216,666,667
P17044	29/03/2023	A	mxn	216,666,667			216,666,667
SDW680	02/02/2023	A	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW685	09/02/2023	A	mxn	70,000,000	70,000,000	70,000,000	
SDW706	10/02/2023	A	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDW707	02/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW748	30/01/2023	A	mxn	565,000	565,000	565,000	
SDW757	30/01/2023	A	mxn	565,000	565,000	565,000	
SDW759	15/02/2023	A	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDW769	09/02/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SDW776	03/02/2023	A	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW777	09/02/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SDW807	02/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW861	09/02/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SDW866	09/02/2023	A	mxn	5,600,000	5,600,000	5,600,000	
SDW869	10/02/2023	A	mxn	289,676,240	289,676,240	289,676,240	
SDW878	10/02/2023	A	mxn	36,917,525	36,917,525	36,917,525	
SDW884	09/02/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SDW886	09/02/2023	A	mxn	5,600,000	5,600,000	5,600,000	
SDW895	10/02/2023	A	mxn	36,917,525	36,917,525	36,917,525	
P17106	25/01/2023	A	mxn	893,778,249			893,778,249
SDW954	06/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SDW962	03/03/2023	A	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
P17107	25/01/2023	A	mxn	893,778,249			893,778,249
P17120	27/01/2023	A	mxn	350,000,000			350,000,000
P17121	27/01/2023	A	mxn	350,000,000			350,000,000
P17122	27/01/2023	A	mxn	350,000,000			350,000,000
P17123	27/01/2023	A	mxn	350,000,000			350,000,000
P17124	27/01/2023	A	mxn	350,000,000			350,000,000
P17125	27/01/2023	A	mxn	350,000,000			350,000,000
SDX034	10/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SDX035	10/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
MNF387	28/02/2023	A	usd	5,000,000		5,000,000	
P17138	16/03/2023	A	mxn	600,000,000			600,000,000
P17139	16/03/2023	A	mxn	600,000,000			600,000,000
SDX100	09/02/2023	A	mxn	5,250,000	5,250,000	5,250,000	
SDX103	09/02/2023	A	mxn	5,250,000	5,250,000	5,250,000	
MNF388	28/02/2023	A	usd	5,000,000		5,000,000	
P17145	02/03/2023	A	mxn	12,000,000			12,000,000
P17184	02/03/2023	A	mxn	12,000,000			12,000,000
P17185	02/03/2023	A	mxn	12,000,000			12,000,000
P17186	02/03/2023	A	mxn	12,000,000			12,000,000
MNF491	26/01/2023	A	mxn	100,000,000		100,000,000	
P17225	15/03/2023	A	mxn	20,000,000			20,000,000
P17226	15/03/2023	A	mxn	20,000,000			20,000,000
P17227	15/03/2023	A	mxn	20,000,000			20,000,000
P17280	30/03/2023	A	mxn	25,000,000			25,000,000
P17281	30/03/2023	A	mxn	25,000,000			25,000,000
SDX181	09/02/2023	A	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SDX294	15/02/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SFD189	08/03/2023	A	mxn	375,000,000	375,000,000	375,000,000	
SFD203	08/03/2023	A	mxn	375,000,000	375,000,000	375,000,000	
SFD218	08/03/2023	A	mxn	375,000,000	375,000,000	375,000,000	
MQY475	08/03/2023	A	mxn	375,000,000		375,000,000	
C74440	28/02/2023	A	usd/mxn		55,030,087	1,141,048,854	
C74490	28/02/2023	A	mxn/usd		1,141,048,854	55,030,087	
SFS691	02/01/2023	A	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SFS692	02/01/2023	A	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SFS993	05/01/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SFU015	06/01/2023	A	usd	6,500,000	6,500,000	6,500,000	
SFU022	06/01/2023	A	usd	6,500,000	6,500,000	6,500,000	
SFU990	24/01/2023	A	mxn	210,000,000	210,000,000	210,000,000	
SFV206	20/01/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SFV222	20/01/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
P17676	20/03/2023	A	mxn	80,000,000			80,000,000
P17677	20/03/2023	A	mxn	80,000,000			80,000,000
SFW774	26/01/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SFW776	26/01/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SFW781	26/01/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SFW782	26/01/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SFX769	03/02/2023	A	mxn	635,000,000	635,000,000	635,000,000	
SFY647	10/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SFY789	10/01/2023	A	usd	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SFY816	10/01/2023	A	usd	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SFY848	03/02/2023	A	usd	4,500,000	4,500,000	4,500,000	
SFY862	03/02/2023	A	usd	4,500,000	4,500,000	4,500,000	
SFZ152	15/02/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SFZ231	15/02/2023	A	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SFZ232	15/02/2023	A	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SFZ584	17/02/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SFZ898	22/02/2023	A	mxn	1,510,000,000	1,510,000,000	1,510,000,000	
SGD723	09/03/2023	A	usd	3,000,000	3,000,000	3,000,000	
SGD832	14/03/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SGD841	09/03/2023	A	usd	3,000,000	3,000,000	3,000,000	
SGF179	23/03/2023	A	mxn	600,000,000	600,000,000	600,000,000	
SGF180	23/03/2023	A	mxn	600,000,000	600,000,000	600,000,000	
SGH182	30/03/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGH185	30/03/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGH415	30/03/2023	A	mxn	410,000,000	410,000,000	410,000,000	
P17796	01/02/2023	A	mxn	10,688,050			10,688,050
P17799	01/02/2023	A	mxn	10,688,050			10,688,050
P17891	31/03/2023	A	mxn	37,119,887			37,119,887
P17892	31/03/2023	A	mxn	37,119,887			37,119,887
SGP529	31/03/2023	A	usd	700,000	700,000	700,000	
SGP573	31/03/2023	A	usd	700,000	700,000	700,000	
SGR088	31/01/2023	A	mxn	176,000,000	176,000,000	176,000,000	
SGT620	10/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SGV173	20/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SGV265	21/02/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGV266	21/02/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGV348	21/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SGV351	04/01/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SGV353	09/01/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SGV407	04/01/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SGV408	09/01/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SGV585	22/02/2023	A	mxn	305,000,000	305,000,000	305,000,000	
SGW187	27/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SGW188	27/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SGW539	01/03/2023	A	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	1,500,000,000	
SGW840	02/03/2023	A	mxn	600,000,000	600,000,000	600,000,000	
SGX040	03/03/2023	A	mxn	1,480,000,000	1,480,000,000	1,480,000,000	
SGX048	03/03/2023	A	mxn	1,480,000,000	1,480,000,000	1,480,000,000	
SGX220	06/03/2023	A	mxn	885,000,000	885,000,000	885,000,000	
SGZ874	30/03/2023	A	mxn	1,220,000,000	1,220,000,000	1,220,000,000	
C80134	31/01/2023	A	mxn/usd		207,482,440	10,033,000	
C80135	31/01/2023	A	usd/mxn		10,033,000	207,482,440	
SHA255	09/01/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SHE866	14/02/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHE872	14/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SHF131	16/02/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHF132	16/02/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHF196	16/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SHF492	17/02/2023	A	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SHF875	03/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SHF898	03/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
E81337	13/02/2023	A	mxn	193,050,000			193,050,000
E81366	13/02/2023	A	mxn	193,050,000			193,050,000
E81367	13/02/2023	A	mxn	193,050,000			193,050,000
E81368	13/02/2023	A	mxn	193,050,000			193,050,000
SHG365	24/02/2023	A	mxn	885,000,000	885,000,000	885,000,000	
SHG448	08/03/2023	A	mxn	5,900,000	5,900,000	5,900,000	
SHG481	08/03/2023	A	mxn	5,900,000	5,900,000	5,900,000	
SHG685	10/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SHG702	10/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SHG813	01/03/2023	A	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SHG985	13/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SHG992	14/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SHG993	15/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SHG995	17/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SHH006	12/01/2023	A	mxn	4,000,000	4,000,000	4,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SHH008	12/01/2023	A	mxn	12,000,000	12,000,000	12,000,000	
SHH009	12/01/2023	A	mxn	14,000,000	14,000,000	14,000,000	
SHH011	28/03/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SHH015	02/03/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHH049	13/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SHH050	14/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SHH051	15/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SHH052	17/03/2023	A	mxn	1,000,000	1,000,000	1,000,000	
SHH053	12/01/2023	A	mxn	4,000,000	4,000,000	4,000,000	
SHH054	28/03/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SHH057	12/01/2023	A	mxn	12,000,000	12,000,000	12,000,000	
SHH058	12/01/2023	A	mxn	14,000,000	14,000,000	14,000,000	
SHH089	13/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SHH135	13/01/2023	A	mxn	30,000,000	30,000,000	30,000,000	
SHH144	14/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SHH173	14/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SHH222	14/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SHH224	14/03/2023	A	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SHH249	06/03/2023	A	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SHH762	17/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SHH774	17/03/2023	A	mxn	5,000,000	5,000,000	5,000,000	
SHI070	17/02/2023	A	mxn	3,389,831	3,389,831	3,389,831	
SHI081	17/02/2023	A	mxn	3,389,831	3,389,831	3,389,831	
SHI112	10/03/2023	A	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SHI254	20/02/2023	A	mxn	3,389,831	3,389,831	3,389,831	
SHI256	20/02/2023	A	mxn	3,389,831	3,389,831	3,389,831	
SHI345	20/02/2023	A	mxn	10,169,492	10,169,492	10,169,492	
SHI487	20/02/2023	A	mxn	10,169,492	10,169,492	10,169,492	
SHI994	30/03/2023	A	usd	20,300,000	20,300,000	20,300,000	
SHJ373	28/03/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SHJ389	28/03/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SHK029	23/03/2023	A	mxn	890,000,000	890,000,000	890,000,000	
SHK191	04/01/2023	A	usd	4,000,000	4,000,000	4,000,000	
SHK193	04/01/2023	A	usd	4,000,000	4,000,000	4,000,000	
SHK268	04/02/2023	A	mxn	1,480,000	1,480,000	1,480,000	
SHK284	04/02/2023	A	mxn	1,480,000	1,480,000	1,480,000	
SHL561	17/02/2023	A	mxn	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
SHL567	17/02/2023	A	mxn	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
SHM797	28/02/2023	A	mxn	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
SHM799	28/02/2023	A	mxn	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
SHN297	01/02/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SHN313	01/02/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SHN344	27/01/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHN826	08/03/2023	A	mxn	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
SHN834	08/03/2023	A	mxn	2,000,000	2,000,000	2,000,000	
SHO239	03/02/2023	A	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHO471	10/02/2023	A	mxn	4,200,000	4,200,000	4,200,000	
SHO498	10/02/2023	A	mxn	4,200,000	4,200,000	4,200,000	
SHO731	15/03/2023	A	mxn	1,900,000	1,900,000	1,900,000	
SHO739	15/03/2023	A	mxn	1,900,000	1,900,000	1,900,000	
SHP349	15/02/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SHP364	15/02/2023	A	mxn	10,000,000	10,000,000	10,000,000	
SHP860	23/03/2023	A	mxn	1,900,000	1,900,000	1,900,000	
SHP970	23/03/2023	A	mxn	1,900,000	1,900,000	1,900,000	
SHQ585	30/03/2023	A	mxn	1,900,000	1,900,000	1,900,000	
SHQ595	30/03/2023	A	mxn	1,900,000	1,900,000	1,900,000	
SHR964	13/03/2023	A	mxn	750,000,000	750,000,000	750,000,000	
SHS427	13/01/2023	A	usd	3,000,000	3,000,000	3,000,000	
SHS430	13/01/2023	A	usd	3,000,000	3,000,000	3,000,000	
SHU680	08/02/2023	A	mxn	750,000,000	750,000,000	750,000,000	
E85172	21/03/2023	A	mxn	647,191,000			647,191,000
E85390	21/03/2023	A	mxn	645,691,000			645,691,000
E85391	21/03/2023	A	mxn	645,691,000			645,691,000
E85392	21/03/2023	A	mxn	645,691,000			645,691,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021083003100	S	MXNUSD	02/03/2023	(90,553,609)	21.74	4,165,967
2021083003102	S	MXNUSD	02/03/2023	(82,219,036)	21.74	3,782,777
2021083003104	S	MXNUSD	01/04/2023	(8,334,573)	21.64	385,235
2021083003106	S	MXNUSD	01/04/2023	(90,553,609)	21.63	4,185,674
2021083003108	S	MXNUSD	01/04/2023	(68,506,470)	21.63	3,166,564
2021083003463	BO	USDMXN	01/04/2023	157,830	21.63	(3,413,944)
2021083003464	BO	USDMXN	02/03/2023	200,217	21.74	(4,352,976)
2021090803227	B	EURMXN	01/31/2023	1,900,000	25.71	(48,848,910)
2021100403407	BO	USDMXN	01/04/2023	49,584	22.08	(1,094,586)
2021100403408	BO	USDMXN	02/03/2023	50,893	22.21	(1,130,157)
2021100403409	BO	USDMXN	01/03/2023	284	22.07	(6,263)
2021100403411	S	USDMXN	01/03/2023	(284)	22.06	6,261
2021100403412	B	USDMXN	02/03/2023	284	22.21	(6,304)
2021100603036	SO	USDMXN	03/23/2023	(100,000)	22.58	2,257,556
2021100603190	S	USDMXN	03/03/2023	(100,000)	22.49	2,249,175
2021100603191	B	USDMXN	03/23/2023	100,000	22.58	(2,258,044)
2021100603198	S	USDMXN	03/03/2023	(100,000)	22.49	2,249,175
2021100603199	B	USDMXN	03/23/2023	100,000	22.58	(2,258,044)
2021100603204	S	USDMXN	03/03/2023	(100,000)	22.49	2,249,175
2021100603205	B	USDMXN	03/23/2023	100,000	22.58	(2,258,044)
2021112503083	SO	USDMXN	02/15/2023	(90,000)	23.29	2,095,933
2021112503084	SO	USDMXN	01/30/2023	(65,000)	23.22	1,509,433
2021112503085	SO	USDMXN	02/28/2023	(65,000)	23.34	1,517,220
2021112503093	SO	USDMXN	01/13/2023	(90,000)	23.15	2,083,665
2022012703319	B	USDMXN	01/18/2023	977,760	22.22	(21,728,232)
2022012803192	B	USDMXN	01/18/2023	1,373,877	22.34	(30,686,303)
2022012803497	B	USDMXN	01/18/2023	334,663	22.32	(7,469,522)
2022012803565	B	USDMXN	01/18/2023	306,223	22.32	(6,835,215)
2022012803751	SO	USDMXN	01/18/2023	(20)	22.23	445
2022013103132	B	USDMXN	01/17/2023	668,462	22.10	(14,771,574)
2022013103136	B	USDMXN	02/15/2023	668,256	22.22	(14,848,129)
2022013103138	B	USDMXN	03/15/2023	668,274	22.34	(14,927,784)
2022013103477	B	USDMXN	01/18/2023	120,552	22.02	(2,655,122)
2022013103606	B	USDMXN	01/18/2023	34,686	22.04	(764,471)
2022020203212	B	USDMXN	01/18/2023	120,825	21.97	(2,655,036)
2022020203462	B	USDMXN	01/18/2023	154,614	21.94	(3,391,888)
2022020403032	B	USDMXN	01/18/2023	265,926	22.01	(5,852,303)
2022020403035	B	USDMXN	02/15/2023	82,530	22.12	(1,825,530)
2022020803489	B	USDMXN	01/18/2023	66,727	21.96	(1,465,520)
2022020803491	B	USDMXN	02/15/2023	66,747	22.08	(1,473,532)
2022021403296	SO	USDMXN	03/07/2023	(2,700,000)	21.94	59,248,800
2022021403337	B	USDMXN	02/16/2023	3,000,000	21.88	(65,634,000)
2022021403356	B	USDMXN	02/16/2023	3,000,000	21.88	(65,634,000)
2022021603321	B	USDMXN	01/23/2023	3,035,000	21.65	(65,711,286)
2022021703616	B	USDMXN	01/18/2023	89,057	21.62	(1,925,217)
2022021703618	B	USDMXN	02/15/2023	89,084	21.72	(1,935,007)
2022021803005	S	USDMXN	01/23/2023	(3,035,000)	21.57	65,461,423
2022021803006	B	USDMXN	01/26/2023	3,035,000	21.59	(65,513,003)
2022022303610	B	USDMXN	02/15/2023	2,507,464	21.65	(54,294,457)
2022022303612	B	USDMXN	01/18/2023	3,848,102	21.54	(82,891,961)
2022022503525	B	USDMXN	01/18/2023	406,397	21.69	(8,815,071)
2022022503528	B	USDMXN	02/15/2023	110,978	21.81	(2,420,503)
2022030703245	SO	USDMXN	01/13/2023	(100,000)	22.37	2,237,385
2022030703246	SO	USDMXN	01/30/2023	(75,000)	22.45	1,683,784
2022030703249	SO	USDMXN	02/15/2023	(100,000)	22.52	2,252,217
2022030703250	SO	USDMXN	03/15/2023	(100,000)	22.64	2,264,401
2022030703251	SO	USDMXN	02/28/2023	(75,000)	22.58	1,693,552
2022030703252	SO	USDMXN	03/30/2023	(75,000)	22.70	1,702,611
2022030703500	SO	USDMXN	01/31/2023	(935,000)	22.68	21,206,384

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022030703547	S	USDMXN	01/06/2023	(39,688)	22.60	896,800
2022030703549	S	USDMXN	01/13/2023	(39,688)	22.64	898,657
2022030703551	S	USDMXN	01/20/2023	(39,688)	22.67	899,906
2022030703553	S	USDMXN	01/27/2023	(39,688)	22.70	901,015
2022030703555	S	USDMXN	02/03/2023	(39,688)	22.74	902,316
2022030703557	S	USDMXN	02/10/2023	(39,688)	22.77	903,577
2022030703559	S	USDMXN	02/17/2023	(39,688)	22.80	904,821
2022030703561	S	USDMXN	02/24/2023	(39,688)	22.83	906,073
2022031603543	B	USDMXN	03/17/2023	30,000,000	22.14	(664,245,000)
2022032203625	B	USDMXN	03/17/2023	20,000,000	21.77	(435,362,660)
2022032403636	B	USDMXN	01/17/2023	739,348	21.28	(15,734,452)
2022032403639	B	USDMXN	02/15/2023	704,199	21.41	(15,073,800)
2022032403641	B	USDMXN	03/15/2023	671,725	21.53	(14,459,648)
2022032503254	BO	USDMXN	02/16/2023	298,000	21.24	(6,329,705)
2022032503441	BO	USDMXN	02/16/2023	525,000	21.25	(11,157,595)
2022032903482	B	USDMXN	03/31/2023	15,000,000	21.43	(321,480,000)
2022032903577	SO	USDMXN	01/12/2023	(354,851)	21.07	7,477,685
2022032903578	SO	USDMXN	01/26/2023	(353,793)	21.13	7,476,223
2022032903579	SO	USDMXN	02/09/2023	(430,506)	21.19	9,122,835
2022032903580	SO	USDMXN	02/23/2023	(420,850)	21.25	8,943,257
2022032903581	SO	USDMXN	02/23/2023	(8,482)	21.25	180,223
2022033103394	B	USDMXN	01/18/2023	157,663	21.03	(3,315,330)
2022033103396	B	USDMXN	02/15/2023	207,709	21.14	(4,391,855)
2022033103398	B	USDMXN	03/22/2023	199,710	21.29	(4,252,228)
2022040103583	B	USDMXN	01/18/2023	941,544	20.98	(19,752,692)
2022040103585	B	USDMXN	02/15/2023	1,137,840	21.09	(24,001,401)
2022040103589	B	USDMXN	03/22/2023	1,509,031	21.24	(32,044,835)
2022040103602	BO	USDMXN	01/17/2023	280,000	20.98	(5,873,541)
2022040103603	BO	USDMXN	01/17/2023	50	20.97	(1,048)
2022040103610	BO	USDMXN	03/15/2023	286,000	21.21	(6,066,394)
2022040103613	SO	USDMXN	03/15/2023	(5,456)	21.19	115,606
2022040103614	BO	USDMXN	02/15/2023	260,000	21.10	(5,485,813)
2022040103615	BO	USDMXN	02/15/2023	6,565	21.09	(138,479)
2022040503265	SO	USDMXN	01/26/2023	(355,661)	21.02	7,477,423
2022040503359	S	USDMXN	03/23/2023	(461,755)	21.30	9,835,030
2022040503433	S	USDMXN	01/04/2023	(276,678)	20.96	5,797,929
2022040503449	SO	USDMXN	03/01/2023	(185,231)	21.21	3,929,345
2022040503450	SO	USDMXN	03/15/2023	(184,778)	21.27	3,930,786
2022040503451	SO	USDMXN	03/29/2023	(184,345)	21.33	3,931,835
2022040603388	S	USDMXN	03/31/2023	(127,000)	21.51	2,731,815
2022040603430	B	USDMXN	01/18/2023	48,231	21.28	(1,026,419)
2022040603432	B	USDMXN	02/15/2023	62,075	21.40	(1,328,215)
2022040603435	B	USDMXN	03/22/2023	71,435	21.55	(1,539,071)
2022040703255	BO	USDMXN	01/18/2023	142,726	21.28	(3,036,512)
2022040703256	BO	USDMXN	02/15/2023	143,630	21.39	(3,072,955)
2022040703257	BO	USDMXN	03/22/2023	208,288	21.54	(4,487,148)
2022041203482	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	20.87	1,251,966
2022041203484	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	20.87	1,252,002
2022041203486	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	20.86	1,251,853
2022041203490	S	USDMXN	01/12/2023	(50,000)	20.87	1,043,345
2022041203492	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	20.87	1,251,907
2022041203495	S	USDMXN	01/26/2023	(210,000)	20.92	4,393,327
2022041203497	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	20.87	1,251,904
2022041203499	S	USDMXN	01/26/2023	(60,000)	20.93	1,255,537
2022041203501	S	USDMXN	01/26/2023	(50,000)	20.93	1,046,350
2022041203503	S	USDMXN	02/23/2023	(60,000)	21.04	1,262,202
2022041203505	S	USDMXN	02/23/2023	(60,000)	21.03	1,262,001
2022041203508	SO	USDMXN	01/12/2023	(8,132)	20.86	169,625
2022041203515	S	USDMXN	01/26/2023	(37,293)	20.93	780,538

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022041203517	B	MXNUSD	02/23/2023	313,576	21.04	(14,904)
2022041203519	S	USDMXN	03/09/2023	(465,694)	21.09	9,823,623
2022041203521	S	USDMXN	02/23/2023	(298,672)	21.04	6,282,615
2022041203523	S	USDMXN	03/15/2023	(186,213)	21.12	3,932,409
2022041203526	S	USDMXN	03/23/2023	(464,659)	21.15	9,827,306
2022041203528	S	USDMXN	03/29/2023	(185,712)	21.18	3,932,536
2022041903210	SO	USDMXN	03/15/2023	(184,215)	21.34	3,931,435
2022041903213	SO	USDMXN	01/04/2023	(275,561)	21.04	5,796,738
2022041903214	SO	USDMXN	02/01/2023	(307,183)	21.15	6,497,140
2022041903282	SO	USDMXN	03/29/2023	(183,725)	21.41	3,932,775
2022042103149	B	USDMXN	01/25/2023	5,000,000	21.22	(106,112,500)
2022042103152	B	USDMXN	01/25/2023	5,000,000	21.22	(106,112,500)
2022042203459	S	USDMXN	01/26/2023	(5,000,000)	21.31	106,540,000
2022042703297	SO	USDMXN	02/09/2023	(423,393)	21.55	9,122,575
2022042703302	SO	USDMXN	03/24/2023	(127,000)	21.86	2,776,416
2022042703306	SO	USDMXN	02/24/2023	(119,063)	21.74	2,588,680
2022042703311	SO	USDMXN	01/12/2023	(348,775)	21.44	7,476,542
2022042703312	SO	USDMXN	01/26/2023	(347,948)	21.49	7,478,765
2022042703313	SO	USDMXN	02/23/2023	(422,080)	21.61	9,122,657
2022042703314	SO	USDMXN	03/09/2023	(451,197)	21.67	9,778,795
2022042703315	SO	USDMXN	03/09/2023	(938)	21.80	20,436
2022042703319	SO	USDMXN	03/23/2023	(450,000)	21.74	9,784,252
2022042703321	SO	USDMXN	03/09/2023	(1,354)	21.68	29,360
2022042703324	SO	USDMXN	03/23/2023	(2,111)	21.73	45,882
2022042703385	SO	USDMXN	03/29/2023	(180,000)	21.71	3,908,611
2022042703387	SO	USDMXN	01/04/2023	(271,408)	21.37	5,799,655
2022042703388	SO	USDMXN	02/15/2023	(298,592)	21.54	6,432,769
2022042703390	SO	USDMXN	03/01/2023	(182,109)	21.63	3,938,761
2022042703392	SO	USDMXN	02/15/2023	(3,172)	21.57	68,422
2022042703393	SO	USDMXN	03/29/2023	(911)	21.75	19,807
2022050203329	BO	USDMXN	03/16/2023	4,590,000	21.79	(99,995,427)
2022050303173	SO	USDMXN	02/01/2023	(319,000)	21.43	6,834,944
2022050303243	BO	USDMXN	02/01/2023	15,573	21.44	(333,879)
2022050303261	SO	USDMXN	02/09/2023	(424,000)	21.46	9,099,532
2022050303323	SO	USDMXN	01/12/2023	(350,254)	21.34	7,475,422
2022050303324	SO	USDMXN	01/18/2023	(271,510)	21.37	5,801,488
2022050303325	SO	USDMXN	01/26/2023	(349,436)	21.40	7,478,035
2022050303326	SO	USDMXN	02/09/2023	(1,129)	21.46	24,231
2022050303327	SO	USDMXN	02/23/2023	(12,671)	21.52	272,645
2022050303410	S	USDMXN	02/23/2023	(177,690)	21.48	3,816,222
2022050303413	S	USDMXN	02/23/2023	(25,000)	21.47	536,835
2022050303418	S	USDMXN	02/23/2023	(25,000)	21.47	536,865
2022050303423	S	USDMXN	02/23/2023	(121,500)	21.48	2,609,254
2022050303426	S	USDMXN	02/23/2023	(46,200)	21.47	991,910
2022050303431	S	USDMXN	02/23/2023	(15,784)	21.47	338,872
2022050303435	S	USDMXN	03/09/2023	(455,622)	21.53	9,810,128
2022050303439	S	USDMXN	03/15/2023	(181,756)	21.56	3,918,002
2022050303442	S	USDMXN	03/23/2023	(454,306)	21.59	9,807,051
2022050303444	S	USDMXN	03/29/2023	(181,361)	21.61	3,919,482
2022051003247	SO	USDMXN	01/04/2023	(272,000)	21.34	5,803,544
2022051003376	SO	USDMXN	03/09/2023	(455,084)	21.58	9,819,879
2022051003377	BO	USDMXN	01/04/2023	95	21.33	(2,032)
2022051303436	S	USDMXN	02/17/2023	(1,300,000)	21.23	27,598,493
2022051303536	B	USDMXN	01/18/2023	135,905	21.14	(2,873,155)
2022051303538	B	USDMXN	02/15/2023	129,303	21.26	(2,749,175)
2022051303540	B	USDMXN	03/22/2023	151,341	21.41	(3,239,706)
2022051703176	S	USDMXN	03/15/2023	(12,006,139)	21.18	254,230,000
2022051703423	B	USDMXN	03/15/2023	11,997,640	21.19	(254,230,000)
2022051903170	BO	USDMXN	01/17/2023	280,000	20.92	(5,858,676)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022051903420	BO	USDMXN	01/17/2023	50	20.87	(1,044)
2022052703139	B	USDMXN	01/30/2023	76,772,597	20.56	(1,578,137,500)
2022052703393	S	USDMXN	01/30/2023	(75,000,000)	20.59	1,543,987,500
2022052703681	BO	USDMXN	01/04/2023	168,056	20.48	(3,442,325)
2022052703682	BO	USDMXN	01/11/2023	168,056	20.51	(3,447,272)
2022052703683	BO	USDMXN	01/18/2023	168,056	20.54	(3,452,163)
2022052703685	BO	USDMXN	01/25/2023	168,056	20.57	(3,457,115)
2022052703810	BO	USDMXN	01/11/2023	84,028	20.49	(1,722,028)
2022052703811	BO	USDMXN	01/25/2023	84,028	20.55	(1,726,966)
2022052703812	BO	USDMXN	01/18/2023	84,028	20.52	(1,724,497)
2022052703813	BO	USDMXN	01/04/2023	84,028	20.46	(1,719,559)
2022053003411	BO	USDMXN	01/06/2023	230,000	20.42	(4,695,835)
2022053003441	BO	USDMXN	01/04/2023	336,112	20.37	(6,846,738)
2022053003442	BO	USDMXN	01/11/2023	336,112	20.40	(6,856,541)
2022053003443	BO	USDMXN	01/18/2023	336,112	20.43	(6,866,350)
2022053003444	BO	USDMXN	01/25/2023	336,112	20.46	(6,876,160)
2022053003471	BO	USDMXN	01/04/2023	252,084	20.37	(5,134,970)
2022053003472	BO	USDMXN	01/11/2023	252,084	20.40	(5,142,319)
2022053003473	BO	USDMXN	01/25/2023	252,084	20.46	(5,157,028)
2022053003474	BO	USDMXN	01/18/2023	252,368	20.43	(5,155,479)
2022053103021	SO	USDMXN	01/18/2023	(279)	20.51	5,726
2022060203390	BO	USDMXN	01/05/2023	55,000	20.41	(1,122,546)
2022060203391	BO	USDMXN	02/03/2023	55,000	20.53	(1,129,178)
2022060203392	BO	USDMXN	03/03/2023	55,000	20.65	(1,135,636)
2022060603103	BO	USDMXN	01/03/2023	100,834	20.31	(2,047,899)
2022060603104	BO	USDMXN	01/10/2023	100,834	20.34	(2,050,803)
2022060603105	BO	USDMXN	01/24/2023	100,834	20.40	(2,056,625)
2022060603106	BO	USDMXN	01/17/2023	100,834	20.37	(2,053,714)
2022062203446	B	USDMXN	01/18/2023	43,142	20.87	(900,401)
2022062203450	B	USDMXN	02/15/2023	43,229	20.99	(907,344)
2022062203452	B	USDMXN	03/22/2023	33,184	21.14	(701,547)
2022062303454	B	USDMXN	01/18/2023	556,936	20.85	(11,612,509)
2022062303458	B	USDMXN	02/15/2023	469,376	20.96	(9,838,651)
2022062303471	B	USDMXN	03/22/2023	342,609	21.12	(7,235,240)
2022062403430	B	USDMXN	01/17/2023	168,058	20.71	(3,479,886)
2022062403432	B	USDMXN	01/24/2023	168,058	20.74	(3,485,370)
2022062403451	B	USDMXN	01/03/2023	168,058	20.65	(3,471,052)
2022062403454	B	USDMXN	01/10/2023	168,058	20.68	(3,476,105)
2022062703023	BO	USDMXN	01/03/2023	84,029	20.57	(1,728,551)
2022062703024	BO	USDMXN	01/10/2023	84,029	20.60	(1,731,042)
2022062703025	BO	USDMXN	01/17/2023	84,029	20.63	(1,733,532)
2022062703026	BO	USDMXN	01/24/2023	84,029	20.66	(1,736,023)
2022062803490	SO	USDMXN	01/18/2023	(556,936)	20.88	11,627,209
2022062803491	SO	USDMXN	02/15/2023	(469,376)	21.00	9,854,596
2022062803492	SO	USDMXN	03/22/2023	(342,609)	21.14	7,243,585
2022062803579	B	USDMXN	01/18/2023	56,947	20.95	(1,193,223)
2022062803581	B	USDMXN	02/15/2023	57,064	21.07	(1,202,463)
2022062803583	B	USDMXN	03/22/2023	43,805	21.22	(929,616)
2022062903553	SO	USDMXN	01/04/2023	(229,528)	20.86	4,787,899
2022062903554	SO	USDMXN	03/01/2023	(198,676)	21.10	4,191,439
2022062903555	SO	USDMXN	03/29/2023	(197,717)	21.22	4,194,606
2022070603176	BO	EURUSD	01/20/2023	200,000	1.03	(206,623)
2022070603177	BO	EURUSD	02/16/2023	250,000	1.04	(258,812)
2022070603178	BO	EURUSD	03/24/2023	50,000	1.04	(51,900)
2022070603452	SO	USDMXN	01/20/2023	(917)	21.45	19,673
2022070603453	SO	USDMXN	02/16/2023	(1,163)	21.55	25,060
2022070603455	SO	USDMXN	03/24/2023	(235)	21.70	5,106
2022071203056	SO	USDMXN	02/17/2023	(120,000)	21.72	2,606,047
2022071203274	BO	USDMXN	02/17/2023	938	21.62	(20,270)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022071303132	SO	USDMXN	01/20/2023	(120,000)	21.68	2,601,620
2022071303133	SO	USDMXN	03/03/2023	(127,000)	21.86	2,776,840
2022071303310	BO	USDMXN	01/20/2023	938	21.44	(20,098)
2022071403296	SO	USDMXN	01/13/2023	(120,000)	21.72	2,606,394
2022071403468	BO	USDMXN	01/13/2023	938	21.54	(20,191)
2022072203308	S	USDMXN	03/15/2023	(14,000,000)	21.42	299,924,422
2022072203324	S	USDMXN	03/15/2023	(14,000,000)	21.43	299,965,442
2022072203479	S	USDMXN	03/15/2023	(2,000,000)	21.46	42,911,600
2022072703052	BO	EURMXN	01/09/2023	737,315	21.68	(15,983,548)
2022072703053	BO	EURMXN	03/06/2023	565,560	21.99	(12,435,097)
2022072703076	SO	EURMXN	01/09/2023	(737,315)	21.70	16,001,063
2022072703077	SO	EURMXN	03/06/2023	(555,880)	22.01	12,233,192
2022072903401	B	USDMXN	03/15/2023	130,000,000	21.24	(2,761,395,000)
2022081003514	S	USDMXN	02/13/2023	(10,000,000)	20.66	206,644,700
2022081003621	BO	USDMXN	01/06/2023	200,000	20.59	(4,117,082)
2022081003622	BO	USDMXN	01/13/2023	200,000	20.61	(4,122,121)
2022081003623	BO	USDMXN	01/20/2023	200,000	20.64	(4,127,265)
2022081003624	BO	USDMXN	01/27/2023	200,000	20.66	(4,132,409)
2022081003625	BO	USDMXN	02/03/2023	200,000	20.69	(4,137,553)
2022081003626	BO	USDMXN	02/10/2023	200,000	20.71	(4,142,697)
2022081003627	BO	USDMXN	02/17/2023	200,000	20.74	(4,148,021)
2022081003628	BO	USDMXN	02/24/2023	200,000	20.77	(4,153,480)
2022081003637	BO	USDMXN	01/03/2023	92,431	20.54	(1,898,771)
2022081003638	BO	USDMXN	01/10/2023	92,431	20.57	(1,901,089)
2022081003639	BO	USDMXN	01/17/2023	92,431	20.59	(1,903,447)
2022081003640	BO	USDMXN	01/24/2023	92,431	20.62	(1,905,823)
2022081003647	BO	USDMXN	01/03/2023	92,431	20.48	(1,892,996)
2022081003648	BO	USDMXN	01/10/2023	92,431	20.51	(1,895,303)
2022081003649	BO	USDMXN	01/17/2023	92,431	20.53	(1,897,649)
2022081003651	BO	USDMXN	01/24/2023	92,431	20.56	(1,900,013)
2022081003666	BO	USDMXN	01/06/2023	50,000	20.57	(1,028,435)
2022081003667	BO	USDMXN	01/13/2023	50,000	20.59	(1,029,694)
2022081003668	BO	USDMXN	01/20/2023	50,000	20.62	(1,030,980)
2022081003669	BO	USDMXN	01/27/2023	50,000	20.65	(1,032,265)
2022081003670	BO	USDMXN	02/03/2023	50,000	20.67	(1,033,551)
2022081003671	BO	USDMXN	02/10/2023	50,000	20.70	(1,034,836)
2022081003672	BO	USDMXN	02/17/2023	50,000	20.72	(1,036,167)
2022081003673	BO	USDMXN	02/24/2023	50,000	20.75	(1,037,531)
2022081003747	BO	USDMXN	01/17/2023	270,000	20.64	(5,573,750)
2022081003749	BO	USDMXN	02/15/2023	266,000	20.75	(5,520,751)
2022081003757	BO	USDMXN	03/15/2023	280,544	20.86	(5,851,520)
2022081003801	BO	USDMXN	01/17/2023	10,049	20.65	(207,532)
2022081003803	BO	USDMXN	02/15/2023	565	20.76	(11,728)
2022081103276	S	USDMXN	03/15/2023	(30,000,000)	20.74	622,140,000
2022081203029	BO	USDMXN	01/06/2023	100,000	20.45	(2,045,207)
2022081203030	BO	USDMXN	01/20/2023	100,000	20.50	(2,050,256)
2022081203031	BO	USDMXN	01/13/2023	100,000	20.48	(2,047,701)
2022081203032	BO	USDMXN	01/27/2023	100,000	20.53	(2,052,893)
2022081203033	BO	USDMXN	02/03/2023	100,000	20.56	(2,055,530)
2022081203034	BO	USDMXN	02/10/2023	100,000	20.58	(2,058,166)
2022081203035	BO	USDMXN	02/17/2023	100,000	20.61	(2,060,801)
2022081203036	BO	USDMXN	02/24/2023	100,000	20.63	(2,063,424)
2022081203250	BO	USDMXN	01/27/2023	100,000	20.53	(2,052,885)
2022081203251	BO	USDMXN	01/20/2023	100,000	20.50	(2,050,226)
2022081203252	BO	USDMXN	01/06/2023	100,000	20.45	(2,045,178)
2022081203253	BO	USDMXN	01/13/2023	100,000	20.48	(2,047,664)
2022081203254	BO	USDMXN	02/03/2023	100,000	20.56	(2,055,544)
2022081203255	BO	USDMXN	02/10/2023	100,000	20.58	(2,058,203)
2022081203256	BO	USDMXN	02/17/2023	100,000	20.61	(2,060,850)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022081203257	BO	USDMXN	02/24/2023	100,000	20.63	(2,063,419)
2022081203458	BO	USDMXN	01/10/2023	92,431	20.44	(1,888,881)
2022081203459	BO	USDMXN	01/03/2023	92,431	20.41	(1,886,552)
2022081203460	BO	USDMXN	01/17/2023	92,431	20.46	(1,891,209)
2022081203461	BO	USDMXN	01/24/2023	92,431	20.49	(1,893,666)
2022081703441	S	USDMXN	02/21/2023	(20,000,000)	20.78	415,560,000
2022081703446	S	USDMXN	02/21/2023	(20,000,000)	20.78	415,560,000
2022082203337	SO	USDMXN	02/21/2023	(10,000,000)	20.87	208,704,360
2022082203354	S	USDMXN	02/21/2023	(10,000,000)	20.87	208,740,900
2022082203355	S	USDMXN	02/21/2023	(9,337,000)	20.87	194,875,253
2022082203356	B	USDMXN	02/21/2023	29,337,000	20.87	(612,233,853)
2022082203359	B	USDMXN	02/21/2023	29,337,000	20.87	(612,233,853)
2022082303203	S	USDMXN	03/27/2023	(40,000,000)	20.88	835,000,000
2022082303341	B	USDMXN	02/24/2023	50,000	20.76	(1,038,028)
2022082303343	B	USDMXN	02/17/2023	50,000	20.74	(1,036,914)
2022082303346	B	USDMXN	02/10/2023	50,000	20.71	(1,035,451)
2022082303351	B	USDMXN	02/03/2023	50,000	20.68	(1,033,757)
2022082303353	B	USDMXN	01/27/2023	50,000	20.65	(1,032,525)
2022082303358	B	USDMXN	01/20/2023	50,000	20.62	(1,031,122)
2022082303364	B	USDMXN	01/13/2023	50,000	20.59	(1,029,656)
2022082303366	B	USDMXN	01/06/2023	50,000	20.57	(1,028,252)
2022082403507	BO	USDMXN	01/03/2023	13,562	20.46	(277,467)
2022082403510	B	USDMXN	01/03/2023	297,027	20.43	(6,068,781)
2022082403512	B	USDMXN	01/10/2023	310,859	20.46	(6,359,911)
2022082403514	B	USDMXN	01/17/2023	310,859	20.48	(6,366,616)
2022082403516	B	USDMXN	01/24/2023	310,859	20.51	(6,375,190)
2022082403518	SO	USDMXN	01/10/2023	(270)	20.45	5,520
2022082403519	SO	USDMXN	01/17/2023	(270)	20.47	5,527
2022082403520	SO	USDMXN	01/24/2023	(270)	20.50	5,535
2022082403602	BO	USDMXN	02/21/2023	29,337,000	20.87	(612,233,853)
2022082403604	SO	USDMXN	02/21/2023	(9,337,000)	20.87	194,875,253
2022082403605	SO	USDMXN	02/21/2023	(10,000,000)	20.87	208,740,900
2022082503269	BO	USDMXN	01/04/2023	1,000,000	20.46	(20,460,441)
2022082503274	BO	USDMXN	02/01/2023	1,000,000	20.58	(20,578,594)
2022082503277	BO	USDMXN	03/01/2023	1,000,000	20.69	(20,690,563)
2022083003421	S	USDMXN	03/01/2023	(10,000,000)	20.89	208,925,000
2022090903154	S	USDMXN	03/13/2023	(50,000,000)	20.57	1,028,350,000
2022090903325	BO	USDMXN	03/02/2023	2,400,000	20.53	(49,273,863)
2022090903404	S	USDMXN	03/15/2023	(48,480,000)	20.77	1,006,968,384
2022090903474	B	USDMXN	01/11/2023	1,000,000	20.36	(20,356,863)
2022090903476	B	USDMXN	02/08/2023	1,000,000	20.47	(20,466,287)
2022090903478	B	USDMXN	03/08/2023	1,000,000	20.57	(20,570,147)
2022090903562	B	USDMXN	03/02/2023	24,600	20.56	(505,774)
2022090903718	B	USDMXN	03/27/2023	25,000,000	20.59	(514,812,500)
2022091203096	B	USDMXN	01/03/2023	1,242,354	20.21	(25,107,967)
2022091203246	B	USDMXN	01/05/2023	100,000	20.21	(2,020,724)
2022091203248	B	USDMXN	01/12/2023	100,000	20.23	(2,023,307)
2022091203250	B	USDMXN	01/19/2023	100,000	20.27	(2,026,766)
2022091203252	B	USDMXN	01/26/2023	100,000	20.30	(2,029,625)
2022091203255	B	USDMXN	02/07/2023	100,000	20.34	(2,034,315)
2022091203257	B	USDMXN	02/14/2023	100,000	20.37	(2,036,945)
2022091203259	B	USDMXN	02/21/2023	100,000	20.40	(2,039,817)
2022091203261	B	USDMXN	02/28/2023	100,000	20.43	(2,042,538)
2022091203467	B	USDMXN	01/04/2023	120,000	20.28	(2,433,106)
2022091203469	B	USDMXN	01/11/2023	120,000	20.30	(2,436,109)
2022091203471	B	USDMXN	01/18/2023	120,000	20.33	(2,439,480)
2022091203473	B	USDMXN	01/25/2023	120,000	20.36	(2,442,749)
2022091203475	B	USDMXN	02/01/2023	120,000	20.38	(2,445,770)
2022091203477	B	USDMXN	02/08/2023	120,000	20.41	(2,448,862)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022091203479	B	USDMXN	02/15/2023	120,000	20.43	(2,452,050)
2022091203481	B	USDMXN	02/22/2023	120,000	20.46	(2,455,365)
2022091203491	S	USDMXN	03/14/2023	(30,000,000)	20.55	616,470,000
2022091303418	B	USDMXN	03/15/2023	20,000,000	20.70	(413,950,000)
2022091403275	B	USDMXN	02/21/2023	25,000,000	20.56	(513,875,000)
2022091403426	BO	USDMXN	02/15/2023	246,000	20.49	(5,039,642)
2022091403431	BO	USDMXN	03/15/2023	280,000	20.59	(5,765,833)
2022091403503	BO	USDMXN	02/15/2023	20,565	20.52	(422,007)
2022091403504	BO	USDMXN	03/15/2023	544	20.63	(11,221)
2022091403524	B	USDMXN	02/21/2023	20,000,000	20.53	(410,580,000)
2022091903258	B	USDMXN	03/21/2023	10,000,000	20.64	(206,380,000)
2022092103543	S	USDMXN	01/05/2023	(5,000,000)	20.28	101,390,000
2022092103545	S	USDMXN	01/12/2023	(5,000,000)	20.30	101,515,000
2022092103549	S	USDMXN	01/19/2023	(5,000,000)	20.33	101,645,000
2022092103551	S	USDMXN	01/26/2023	(5,000,000)	20.36	101,775,000
2022092103553	S	USDMXN	02/02/2023	(5,000,000)	20.38	101,905,000
2022092203065	B	USDMXN	01/17/2023	36,991	20.34	(752,369)
2022092603415	B	USDMXN	01/30/2023	10,000,000	20.88	(208,840,000)
2022092703061	SO	USDMXN	01/25/2023	(3,004,400)	20.77	62,410,401
2022092703062	BO	USDMXN	01/25/2023	3,004,400	20.77	(62,397,026)
2022092903349	SO	USDMXN	01/05/2023	(36,000)	20.48	737,152
2022093003111	B	USDMXN	01/04/2023	30,000,000	20.45	(613,590,000)
2022100503281	BO	USDMXN	01/13/2023	36,000	20.47	(736,800)
2022100503462	SO	USDMXN	01/13/2023	(72,000)	20.38	1,467,642
2022101003265	S	USDMXN	01/23/2023	(25,000,000)	20.31	507,845,000
2022101003267	B	USDMXN	01/23/2023	25,000,000	20.36	(509,000,000)
2022101103106	S	USDMXN	01/13/2023	(10,000,000)	20.32	203,205,000
2022101103305	SO	USDMXN	01/13/2023	(35,000)	20.31	710,748
2022101103373	SO	USDMXN	01/13/2023	(20,000)	20.34	406,764
2022101403005	SON	USDMXN	01/18/2023	(200,000,000)	20.35	4,069,560,000
2022101403007	BON	USDMXN	01/18/2023	200,000,000	20.35	(4,070,000,000)
2022101403369	SO	USDMXN	01/12/2023	(1,500)	20.39	30,583
2022101403370	BO	USDMXN	01/12/2023	1,500	20.40	(30,601)
2022101803158	BON	USDMXN	01/20/2023	40,000,000	20.35	(814,000,000)
2022101803175	S	USDMXN	01/20/2023	(30,000,000)	20.33	609,840,000
2022101803198	S	USDMXN	01/20/2023	(10,000,000)	20.38	203,840,000
2022101803438	B	USDMXN	01/12/2023	1,519,028	20.36	(30,924,696)
2022101903210	S	USDMXN	02/21/2023	(10,000,000)	20.58	205,845,000
2022101903452	SO	USDMXN	01/19/2023	(83,000)	20.46	1,698,335
2022102103508	B	USDMXN	01/06/2023	250,000	20.22	(5,056,157)
2022102103516	B	USDMXN	01/13/2023	250,000	20.25	(5,062,614)
2022102103518	B	USDMXN	01/20/2023	250,000	20.28	(5,068,949)
2022102103521	B	USDMXN	01/27/2023	250,000	20.30	(5,075,506)
2022102103524	B	USDMXN	02/03/2023	250,000	20.33	(5,081,405)
2022102103528	B	USDMXN	02/10/2023	250,000	20.35	(5,088,101)
2022102103531	B	USDMXN	02/17/2023	250,000	20.38	(5,095,155)
2022102103533	B	USDMXN	02/24/2023	250,000	20.41	(5,101,902)
2022102403139	B	USDMXN	02/03/2023	1,760,234	20.34	(35,806,155)
2022102403142	B	USDMXN	02/10/2023	1,319,522	20.37	(26,878,820)
2022102403145	B	USDMXN	02/17/2023	1,111,769	20.40	(22,676,024)
2022102503110	S	USDMXN	01/27/2023	(35,000,000)	20.20	707,122,500
2022102503233	BON	USDMXN	01/27/2023	37,000,000	20.23	(748,602,500)
2022102503291	SON	USDMXN	01/18/2023	(200,000,000)	20.35	4,069,560,000
2022102503381	BON	USDMXN	01/18/2023	200,000,000	20.35	(4,070,000,000)
2022102503503	BO	USDMXN	03/16/2023	4,900,000	20.41	(99,990,831)
2022102503578	BO	USDMXN	01/10/2023	20,000	20.15	(403,005)
2022102503579	BO	USDMXN	01/24/2023	20,000	20.20	(403,948)
2022102503656	B	USDMXN	01/26/2023	3,067,363	20.23	(62,050,731)
2022102503659	B	USDMXN	01/30/2023	2,677,240	20.24	(54,188,401)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022102503664	B	USDMXN	02/23/2023	4,927,565	20.33	(100,168,173)
2022102603153	B	USDMXN	01/05/2023	60,000	20.11	(1,206,845)
2022102603487	S	USDMXN	01/18/2023	(23,500,000)	20.26	476,086,500
2022102603489	S	USDMXN	02/15/2023	(500,000)	20.37	10,183,500
2022102603491	S	USDMXN	03/15/2023	(500,000)	20.48	10,238,500
2022102703005	B	USDMXN	02/16/2023	4,927,565	20.31	(100,061,861)
2022102703006	S	USDMXN	02/23/2023	(4,927,565)	20.33	100,175,973
2022102703009	BO	USDMXN	03/16/2023	39	20.44	(801)
2022102703167	BO	USDMXN	01/17/2023	1,000,000	20.13	(20,125,432)
2022102703503	B	USDMXN	01/31/2023	20,000,000	20.18	(403,630,000)
2022102803730	BO	USDMXN	01/11/2023	36,212	20.07	(726,708)
2022102803737	BO	USDMXN	01/11/2023	2,793	20.07	(56,048)
2022103103203	B	USDMXN	02/01/2023	30,000,000	20.16	(604,759,260)
2022103103314	B	USDMXN	02/01/2023	5,000,000	20.13	(100,674,772)
2022103103432	B	USDMXN	01/05/2023	60,000	20.05	(1,203,151)
2022103103434	B	USDMXN	01/12/2023	60,000	20.08	(1,204,971)
2022103103437	B	USDMXN	01/19/2023	60,000	20.11	(1,206,638)
2022103103439	B	USDMXN	01/26/2023	60,000	20.14	(1,208,271)
2022110103218	BO	USDMXN	03/03/2023	250,000	20.17	(5,041,782)
2022110103219	BO	USDMXN	03/10/2023	250,000	20.19	(5,048,461)
2022110103220	BO	USDMXN	03/17/2023	250,000	20.22	(5,055,204)
2022110103221	BO	USDMXN	03/24/2023	250,000	20.25	(5,061,947)
2022110103222	BO	USDMXN	03/31/2023	250,000	20.27	(5,068,687)
2022110103233	BO	USDMXN	02/03/2023	1,000,000	20.08	(20,077,886)
2022110103383	SO	USDMXN	03/29/2023	(177,000)	20.29	3,590,791
2022110103384	SO	USDMXN	03/29/2023	(496)	20.27	10,046
2022110103385	SO	USDMXN	01/04/2023	(210,000)	19.97	4,194,602
2022110103386	SO	USDMXN	01/04/2023	(324)	19.96	6,463
2022110103505	S	USDMXN	02/21/2023	(24,000,000)	20.09	482,145,600
2022110303039	BO	USDMXN	02/23/2023	2,889,000	20.07	(57,970,316)
2022110303422	B	USDMXN	03/28/2023	1,831,955	20.20	(37,005,353)
2022110303424	BO	USDMXN	01/18/2023	650,000	19.93	(12,953,968)
2022110303425	BO	USDMXN	01/18/2023	500	19.94	(9,971)
2022110303431	B	USDMXN	03/30/2023	34,228	20.21	(691,837)
2022110303725	BO	USDMXN	01/05/2023	60,000	19.84	(1,190,591)
2022110303726	BO	USDMXN	01/12/2023	60,000	19.87	(1,192,447)
2022110303727	BO	USDMXN	01/19/2023	60,000	19.90	(1,194,112)
2022110303728	BO	USDMXN	01/26/2023	60,000	19.93	(1,195,784)
2022110303733	BO	USDMXN	02/15/2023	66,000	20.00	(1,320,239)
2022110303736	BO	USDMXN	02/23/2023	741	20.04	(14,856)
2022110303789	B	USDMXN	03/22/2023	20,000,000	20.15	(403,093,960)
2022110403353	B	USDMXN	01/11/2023	2,000,000	19.76	(39,523,328)
2022110403355	B	USDMXN	02/08/2023	2,000,000	19.87	(39,749,246)
2022110403357	B	USDMXN	03/08/2023	2,000,000	19.98	(39,951,780)
2022110403365	S	USDMXN	02/21/2023	(20,000,000)	19.84	396,820,000
2022110403371	B	USDMXN	02/21/2023	20,000,000	19.92	(398,355,200)
2022110403375	BO	USDMXN	03/15/2023	340,000	19.93	(6,776,003)
2022110403380	B	USDMXN	01/23/2023	500,000	19.82	(9,907,895)
2022110403383	B	USDMXN	01/03/2023	350,000	19.74	(6,908,521)
2022110403386	B	USDMXN	02/02/2023	350,000	19.86	(6,949,289)
2022110403486	B	USDMXN	01/10/2023	400,000	19.80	(7,919,428)
2022110403488	B	USDMXN	01/25/2023	400,000	19.86	(7,942,640)
2022110403490	B	USDMXN	02/08/2023	400,000	19.91	(7,964,609)
2022110403503	B	USDMXN	01/18/2023	50,000	19.82	(991,197)
2022110403506	B	USDMXN	01/25/2023	50,000	19.85	(992,565)
2022110403508	B	USDMXN	02/07/2023	50,000	19.90	(995,111)
2022110403511	B	USDMXN	02/14/2023	50,000	19.93	(996,455)
2022110403513	B	USDMXN	03/07/2023	50,000	20.01	(1,000,511)
2022110403517	B	USDMXN	03/30/2023	50,000	20.10	(1,005,079)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022110403596	BO	USDMXN	03/15/2023	1,000	20.01	(20,012)
2022110403658	BO	USDMXN	01/05/2023	44,756	19.75	(883,714)
2022110703283	B	USDMXN	01/05/2023	60,000	19.66	(1,179,565)
2022110703288	B	USDMXN	01/12/2023	60,000	19.69	(1,181,154)
2022110703290	B	USDMXN	01/19/2023	60,000	19.72	(1,182,901)
2022110703293	B	USDMXN	01/26/2023	60,000	19.74	(1,184,305)
2022110703335	B	USDMXN	01/09/2023	20,000,000	19.67	(393,470,000)
2022110703339	B	USDMXN	03/09/2023	20,000,000	19.90	(397,940,000)
2022110703456	B	USDMXN	01/03/2023	25,000	19.64	(490,999)
2022110703520	S	USDMXN	01/09/2023	(10,000,000)	19.65	196,490,000
2022110703613	BO	USDMXN	02/28/2023	140,000	19.86	(2,780,906)
2022110703614	BO	USDMXN	02/15/2023	190,000	19.81	(3,764,768)
2022110703615	BO	USDMXN	03/15/2023	100,000	19.92	(1,992,120)
2022110703616	BO	USDMXN	03/30/2023	75,000	19.98	(1,498,332)
2022110703638	BO	USDMXN	01/18/2023	350,000	19.69	(6,891,074)
2022110703642	B	USDMXN	01/18/2023	2,250,000	19.68	(44,288,062)
2022110803035	S	USDMXN	01/10/2023	(30,000,000)	19.68	590,250,000
2022110803316	B	USDMXN	02/14/2023	4,889,235	19.83	(96,958,504)
2022110903105	B	USDMXN	02/14/2023	20,000,000	19.89	(397,820,000)
2022110903315	B	USDMXN	01/17/2023	30,000,000	19.78	(593,295,000)
2022111003381	B	USDMXN	01/05/2023	60,000	19.63	(1,177,881)
2022111003385	B	USDMXN	01/12/2023	120,000	19.66	(2,358,869)
2022111003387	B	USDMXN	01/19/2023	120,000	19.68	(2,361,849)
2022111003389	B	USDMXN	01/26/2023	120,000	19.71	(2,365,014)
2022111003391	B	USDMXN	02/02/2023	300,000	19.73	(5,920,387)
2022111003419	B	USDMXN	01/10/2023	250,000	19.64	(4,909,928)
2022111003470	B	USDMXN	02/02/2023	3,783,089	19.70	(74,522,995)
2022111003661	BO	USDMXN	01/17/2023	379,735	19.56	(7,428,133)
2022111003662	BO	USDMXN	02/15/2023	405,265	19.67	(7,970,666)
2022111003702	BO	USDMXN	01/17/2023	479	19.58	(9,379)
2022111003715	BO	USDMXN	03/15/2023	415,000	19.78	(8,208,040)
2022111003723	BO	USDMXN	03/15/2023	913	19.78	(18,061)
2022111003732	B	USDMXN	01/05/2023	150,000	19.52	(2,928,670)
2022111003734	B	USDMXN	01/12/2023	150,000	19.55	(2,932,323)
2022111003736	B	USDMXN	01/19/2023	150,000	19.57	(2,936,034)
2022111003737	BO	USDMXN	01/26/2023	150,000	19.60	(2,939,460)
2022111003738	BO	USDMXN	02/02/2023	150,000	19.62	(2,943,298)
2022111003739	BO	USDMXN	02/16/2023	150,000	19.67	(2,950,993)
2022111003740	BO	USDMXN	02/09/2023	150,000	19.65	(2,947,136)
2022111003741	BO	USDMXN	02/23/2023	150,000	19.70	(2,954,968)
2022111003742	BO	USDMXN	03/02/2023	150,000	19.73	(2,958,943)
2022111003743	BO	USDMXN	03/09/2023	150,000	19.75	(2,962,918)
2022111003744	BO	USDMXN	03/16/2023	150,000	19.78	(2,966,882)
2022111003745	BO	USDMXN	03/23/2023	150,000	19.81	(2,970,780)
2022111003746	BO	USDMXN	03/30/2023	150,000	19.83	(2,974,678)
2022111003761	B	USDMXN	02/15/2023	500,000	19.66	(9,831,860)
2022111003763	B	USDMXN	03/15/2023	500,000	19.77	(9,884,860)
2022111103372	B	USDMXN	01/20/2023	300,000	19.75	(5,924,254)
2022111103374	B	USDMXN	02/24/2023	300,000	19.88	(5,963,475)
2022111103376	BO	USDMXN	03/24/2023	300,000	19.99	(5,996,902)
2022111103583	B	USDMXN	01/03/2023	50,000	19.67	(983,405)
2022111103585	B	USDMXN	01/06/2023	50,000	19.68	(983,971)
2022111103631	BO	USDMXN	01/04/2023	75,600	19.68	(1,487,598)
2022111103632	BO	USDMXN	01/11/2023	37,800	19.70	(744,547)
2022111403518	BO	USDMXN	01/03/2023	25,000	19.51	(487,796)
2022111403519	BO	USDMXN	01/10/2023	30,000	19.54	(586,056)
2022111403520	BO	USDMXN	01/10/2023	50,000	19.55	(977,281)
2022111503184	BON	USDMXN	02/15/2023	30,000,000	19.68	(590,527,500)
2022111503192	S	USDMXN	02/17/2023	(40,000,000)	19.67	786,740,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022111503245	BO	USDMXN	01/12/2023	50,000	19.48	(973,827)
2022111503246	BO	USDMXN	01/13/2023	50,000	19.48	(973,998)
2022111503538	S	USDMXN	02/17/2023	(40,000,000)	19.70	788,140,000
2022111503574	B	USDMXN	01/04/2023	58,920	19.54	(1,151,150)
2022111503576	BO	USDMXN	01/04/2023	44,280	19.53	(864,815)
2022111503577	BO	USDMXN	01/25/2023	41,005	19.60	(803,867)
2022111503629	B	USDMXN	03/15/2023	341,108	19.78	(6,748,556)
2022111503771	BON	USDMXN	02/15/2023	30,000,000	19.68	(590,529,000)
2022111603419	B	USDMXN	02/14/2023	2,687,821	19.62	(52,737,745)
2022111703215	B	USDMXN	02/15/2023	1,125,134	19.75	(22,224,538)
2022111703224	B	USDMXN	03/15/2023	869,813	19.85	(17,268,426)
2022111703273	S	USDMXN	01/23/2023	(10,000,000)	19.66	196,640,000
2022111703719	B	USDMXN	02/15/2023	59,659	19.72	(1,176,272)
2022111703722	B	USDMXN	03/15/2023	1,499,328	19.82	(29,720,047)
2022111803328	S	USDMXN	03/23/2023	(10,000,000)	19.91	199,115,000
2022111803563	B	USDMXN	03/17/2023	304,168	19.85	(6,037,933)
2022111803573	B	USDMXN	03/15/2023	269,629	19.85	(5,350,869)
2022111803575	B	USDMXN	02/15/2023	209,936	19.74	(4,144,209)
2022111803682	S	USDMXN	03/17/2023	(304,168)	19.84	6,035,148
2022111803696	B	USDMXN	01/17/2023	1,100,000	19.63	(21,589,156)
2022112203182	BON	USDMXN	01/25/2023	30,000,000	19.67	(590,070,000)
2022112203197	S	USDMXN	01/25/2023	(30,000,000)	19.73	591,810,000
2022112203287	BO	USDMXN	01/04/2023	40,400	19.59	(791,457)
2022112203326	B	USDMXN	01/12/2023	1,649,572	19.61	(32,351,253)
2022112303213	B	USDMXN	03/24/2023	1,000,000	19.79	(19,793,998)
2022112303236	B	USDMXN	03/09/2023	1,000,000	19.73	(19,734,900)
2022112303239	B	USDMXN	02/24/2023	1,400,000	19.69	(27,561,414)
2022112303245	B	USDMXN	02/09/2023	1,400,000	19.63	(27,486,172)
2022112303247	B	USDMXN	01/24/2023	2,250,000	19.58	(44,048,860)
2022112303249	B	USDMXN	01/09/2023	2,250,000	19.53	(43,934,180)
2022112303334	BO	USDMXN	01/19/2023	50,000	19.57	(978,568)
2022112303335	BO	USDMXN	01/13/2023	50,000	19.55	(977,521)
2022112303411	B	USDMXN	01/17/2023	75,245,700	19.54	(1,470,000,000)
2022112303422	S	USDMXN	01/17/2023	(75,138,009)	19.56	1,470,000,000
2022112403151	BO	USDMXN	01/25/2023	250,000	19.58	(4,894,225)
2022112403425	BO	USDMXN	01/04/2023	102,400	19.53	(2,000,301)
2022112403429	BO	USDMXN	01/04/2023	800	19.53	(15,628)
2022112503281	B	USDMXN	01/26/2023	3,684,938	19.54	(71,993,310)
2022112503502	BO	USDMXN	01/04/2023	84,000	19.46	(1,634,305)
2022112503544	BO	USDMXN	01/20/2023	50,000	19.51	(975,715)
2022112503633	BO	USDMXN	01/04/2023	41,600	19.47	(809,817)
2022112803218	B	USDMXN	03/01/2023	25,000,000	19.63	(490,805,000)
2022112803220	S	USDMXN	02/27/2023	(557,009)	19.63	10,934,087
2022112803321	BO	USDMXN	01/20/2023	50,000	19.48	(974,240)
2022112803465	B	USDMXN	02/28/2023	20,000,000	19.62	(392,320,000)
2022112803490	BO	USDMXN	01/10/2023	30,000	19.45	(583,507)
2022112803491	BO	USDMXN	01/24/2023	30,000	19.50	(584,933)
2022112803492	BO	USDMXN	01/31/2023	30,000	19.52	(585,644)
2022112803493	BO	USDMXN	02/07/2023	25,000	19.55	(488,659)
2022112803505	BO	USDMXN	01/23/2023	50,000	19.50	(974,779)
2022112803525	SO	USDMXN	02/27/2023	(557,009)	19.63	10,934,087
2022112803530	BO	USDMXN	02/27/2023	557,009	19.62	(10,926,091)
2022112903146	BO	USDMXN	02/22/2023	155,000	19.42	(3,010,145)
2022112903210	BO	USDMXN	02/22/2023	345,000	19.49	(6,725,630)
2022112903380	BO	USDMXN	01/19/2023	10,000	19.30	(192,968)
2022112903381	BO	USDMXN	01/23/2023	10,000	19.31	(193,108)
2022112903382	BO	USDMXN	01/24/2023	60,000	19.31	(1,158,856)
2022112903383	BO	USDMXN	01/25/2023	20,000	19.32	(386,355)
2022112903384	BO	USDMXN	01/26/2023	60,000	19.47	(1,168,218)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022112903385	BO	USDMXN	01/27/2023	40,000	19.47	(778,953)
2022112903395	BO	USDMXN	02/15/2023	400,000	19.49	(7,797,798)
2022112903398	BO	USDMXN	01/31/2023	400,000	19.44	(7,777,310)
2022112903519	BO	USDMXN	02/09/2023	60,000	19.38	(1,162,899)
2022112903520	BO	USDMXN	02/16/2023	60,000	19.41	(1,164,353)
2022112903575	B	USDMXN	01/12/2023	1,614,778	19.39	(31,311,261)
2022112903711	B	USDMXN	02/15/2023	81,504	19.49	(1,588,216)
2022112903714	B	USDMXN	03/15/2023	84,801	19.59	(1,660,880)
2022113003217	BON	USDMXN	01/03/2023	30,000,000	19.48	(584,325,000)
2022113003268	S	USDMXN	01/03/2023	(30,000,000)	19.47	584,235,000
2022113003368	B	USDMXN	01/05/2023	1,595,231	19.48	(31,082,664)
2022113003370	B	USDMXN	01/12/2023	1,595,231	19.51	(31,123,068)
2022113003372	B	USDMXN	01/19/2023	1,595,231	19.53	(31,157,569)
2022113003375	B	USDMXN	01/26/2023	1,595,231	19.56	(31,196,921)
2022113003379	B	USDMXN	02/02/2023	1,537,929	19.59	(30,127,248)
2022113003383	B	USDMXN	02/09/2023	1,537,929	19.62	(30,171,410)
2022113003385	B	USDMXN	02/16/2023	1,537,929	19.65	(30,213,787)
2022113003388	B	USDMXN	02/23/2023	1,537,929	19.67	(30,251,397)
2022113003391	B	USDMXN	03/02/2023	1,340,965	19.69	(26,409,589)
2022113003393	B	USDMXN	03/09/2023	1,340,965	19.72	(26,441,615)
2022113003395	B	USDMXN	03/16/2023	1,340,965	19.74	(26,472,721)
2022113003399	B	USDMXN	03/23/2023	1,340,965	19.77	(26,508,758)
2022113003402	B	USDMXN	03/30/2023	1,340,965	19.80	(26,544,392)
2022120103250	B	USDMXN	02/08/2023	2,000,000	19.37	(38,742,610)
2022120103343	B	USDMXN	01/05/2023	10,000,000	19.25	(192,495,000)
2022120103414	BO	USDMXN	03/07/2023	370,000	19.46	(7,199,615)
2022120103428	B	USDMXN	01/03/2023	1,181,000	19.25	(22,734,821)
2022120103433	B	USDMXN	01/10/2023	30,000	19.27	(578,130)
2022120103435	B	USDMXN	01/24/2023	30,000	19.32	(579,615)
2022120103450	S	USDMXN	03/06/2023	(30,000,000)	19.48	584,310,000
2022120103459	BON	USDMXN	03/03/2023	30,000,000	19.44	(583,200,000)
2022120103516	B	USDMXN	03/14/2023	370,000	19.52	(7,222,152)
2022120103518	B	USDMXN	03/21/2023	370,000	19.55	(7,231,732)
2022120103520	B	USDMXN	03/28/2023	370,000	19.57	(7,241,621)
2022120103523	B	USDMXN	01/25/2023	500,000	19.35	(9,676,906)
2022120103525	B	USDMXN	02/22/2023	500,000	19.45	(9,725,728)
2022120103527	B	USDMXN	03/22/2023	500,000	19.55	(9,775,014)
2022120103535	B	USDMXN	01/30/2023	350,000	19.37	(6,779,749)
2022120103537	B	USDMXN	03/01/2023	350,000	19.47	(6,814,117)
2022120103564	B	USDMXN	01/06/2023	100,000	19.28	(1,928,123)
2022120103584	BO	USDMXN	01/04/2023	81,400	19.27	(1,568,655)
2022120203265	B	USDMXN	01/31/2023	935,000	19.53	(18,263,739)
2022120203292	BON	USDMXN	01/05/2023	30,000,000	19.46	(583,890,000)
2022120203366	B	USDMXN	02/23/2023	126,438	19.69	(2,489,541)
2022120203385	S	USDMXN	01/06/2023	(30,000,000)	19.53	585,825,000
2022120203391	B	USDMXN	01/03/2023	1,181,000	19.52	(23,057,016)
2022120203394	S	USDMXN	03/06/2023	(10,000,000)	19.73	197,320,000
2022120203493	B	USDMXN	02/02/2023	150,000	19.61	(2,941,376)
2022120203495	B	USDMXN	02/09/2023	150,000	19.63	(2,945,061)
2022120203497	B	USDMXN	02/16/2023	150,000	19.66	(2,948,679)
2022120203499	B	USDMXN	02/23/2023	150,000	19.68	(2,952,281)
2022120203501	B	USDMXN	03/02/2023	150,000	19.71	(2,955,899)
2022120203504	B	USDMXN	03/09/2023	150,000	19.73	(2,959,683)
2022120203506	B	USDMXN	03/16/2023	150,000	19.76	(2,963,518)
2022120203508	B	USDMXN	03/23/2023	150,000	19.78	(2,967,333)
2022120203510	B	USDMXN	03/30/2023	150,000	19.81	(2,971,170)
2022120203523	BO	USDMXN	01/04/2023	79,200	19.51	(1,545,544)
2022120203530	S	USDMXN	02/07/2023	(25,459,545)	19.64	500,000,000
2022120203567	BO	USDMXN	01/10/2023	40,000	19.53	(781,205)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022120203568	BO	USDMXN	01/03/2023	25,000	19.51	(487,651)
2022120203569	BO	USDMXN	02/21/2023	30,000	19.68	(590,317)
2022120203624	BO	USDMXN	01/04/2023	28,400	19.49	(553,427)
2022120503207	BON	USDMXN	01/06/2023	40,000,000	19.85	(794,040,000)
2022120503214	BO	USDMXN	01/11/2023	38,400	19.86	(762,788)
2022120503252	S	USDMXN	01/03/2023	(350,000)	19.88	6,956,339
2022120503270	BO	USDMXN	01/11/2023	40,000	19.89	(795,486)
2022120503378	BO	USDMXN	01/03/2023	590,500	19.86	(11,728,112)
2022120603146	B	USDMXN	01/18/2023	46,800	19.95	(933,482)
2022120603378	BO	USDMXN	01/03/2023	590,000	19.90	(11,738,607)
2022120603380	BO	USDMXN	01/03/2023	500	19.87	(9,935)
2022120603395	B	USDMXN	01/30/2023	1,585,660	19.97	(31,669,343)
2022120603397	B	USDMXN	02/14/2023	254,664	20.03	(5,100,480)
2022120603437	BO	USDMXN	01/18/2023	38,400	19.92	(764,974)
2022120603492	BO	USDMXN	01/11/2023	156,800	19.89	(3,119,188)
2022120703083	S	USDMXN	01/09/2023	(20,000,000)	19.78	395,660,000
2022120703251	BO	USDMXN	01/11/2023	39,000	19.75	(770,442)
2022120703254	BO	USDMXN	01/03/2023	590,500	19.77	(11,675,843)
2022120703256	B	USDMXN	01/03/2023	590,500	19.73	(11,648,488)
2022120703322	S	USDMXN	02/02/2023	(350,000)	19.86	6,951,352
2022120803140	S	USDMXN	03/15/2023	(50,000,000)	19.99	999,700,000
2022120803144	B	USDMXN	03/15/2023	50,000,000	19.98	(999,125,000)
2022120803386	BO	USDMXN	01/04/2023	17,200	19.73	(339,306)
2022120803389	BO	USDMXN	01/03/2023	590,500	19.74	(11,656,925)
2022120803391	B	USDMXN	01/03/2023	590,500	19.72	(11,644,524)
2022120803430	S	USDMXN	03/13/2023	(30,000,000)	19.97	598,965,000
2022120803435	S	USDMXN	01/11/2023	(149,004)	19.75	2,942,242
2022120803436	B	USDMXN	01/27/2023	149,004	19.80	(2,950,895)
2022120803439	SO	USDMXN	01/11/2023	(148,017)	19.75	2,923,035
2022120803459	S	USDMXN	01/23/2023	(102,000)	19.81	2,020,602
2022120903509	B	USDMXN	01/03/2023	1,181,000	19.84	(23,436,683)
2022120903512	BO	USDMXN	01/11/2023	22,500	19.87	(447,131)
2022121303087	B	USDMXN	01/17/2023	20,000,000	19.80	(395,900,000)
2022121303095	BO	USDMXN	01/11/2023	26,100	19.77	(515,892)
2022121303107	BO	USDMXN	01/18/2023	115,000	19.78	(2,274,364)
2022121303219	BON	USDMXN	03/15/2023	30,000,000	19.94	(598,110,000)
2022121303338	BO	USDMXN	01/18/2023	200	19.74	(3,949)
2022121303357	B	USDMXN	01/03/2023	1,181,000	19.70	(23,264,278)
2022121303364	B	USDMXN	03/31/2023	105,053	20.01	(2,102,045)
2022121303388	B	USDMXN	03/15/2023	50,000,000	19.92	(995,875,000)
2022121303422	BO	USDMXN	01/11/2023	78,000	19.68	(1,534,858)
2022121303513	BO	USDMXN	01/11/2023	400	19.67	(7,869)
2022121303530	BO	USDMXN	01/18/2023	80,000	19.71	(1,576,622)
2022121303623	BO	USDMXN	02/15/2023	50,300	19.80	(995,802)
2022121403114	BO	USDMXN	01/03/2023	590,500	19.71	(11,641,184)
2022121403414	B	USDMXN	01/03/2023	590,500	19.74	(11,653,953)
2022121403436	SO	USDMXN	03/29/2023	(209,612)	20.04	4,200,274
2022121403562	BO	USDMXN	01/04/2023	48,000	19.72	(946,583)
2022121403601	BO	USDMXN	01/24/2023	25,000	19.81	(495,217)
2022121403602	BO	USDMXN	02/21/2023	25,000	19.91	(497,800)
2022121403603	BO	USDMXN	02/07/2023	25,000	19.86	(496,511)
2022121403604	BO	USDMXN	01/04/2023	800	19.72	(15,775)
2022121503182	SO	USDMXN	01/06/2023	(700,000)	19.89	13,920,037
2022121503288	SO	USDMXN	01/03/2023	(423,000)	19.88	8,410,489
2022121503347	B	USDMXN	01/19/2023	14,700,000	19.92	(292,772,550)
2022121503563	BO	USDMXN	01/04/2023	72,000	19.82	(1,426,934)
2022121503566	S	USDMXN	01/11/2023	(112,972)	19.83	2,240,708
2022121503567	B	USDMXN	01/27/2023	112,972	19.89	(2,247,451)
2022121503568	BO	USDMXN	01/27/2023	64,920	19.90	(1,291,683)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022121503569	BO	USDMXN	02/14/2023	118,410	19.96	(2,363,600)
2022121503770	BO	USDMXN	01/04/2023	176,000	19.80	(3,485,288)
2022121603348	BO	USDMXN	01/31/2023	1,181,000	19.94	(23,551,123)
2022121603369	S	USDMXN	01/03/2023	(10,000,000)	19.83	198,260,000
2022121603542	BO	USDMXN	01/18/2023	227,544	19.89	(4,526,594)
2022121603544	BO	USDMXN	01/18/2023	456	19.92	(9,082)
2022121603546	SO	USDMXN	01/27/2023	(30,000)	19.94	598,215
2022121603596	S	USDMXN	01/20/2023	(30,000,000)	19.92	597,675,000
2022121903125	SO	USDMXN	01/05/2023	(115,000)	19.87	2,284,858
2022121903126	SO	USDMXN	01/06/2023	(328,000)	19.87	6,518,139
2022121903354	BO	USDMXN	01/31/2023	1,181,000	19.93	(23,536,872)
2022121903561	SO	USDMXN	01/06/2023	(18,000)	19.83	356,870
2022122003046	BO	USDMXN	01/04/2023	117,952	19.77	(2,332,190)
2022122003047	BO	USDMXN	01/18/2023	47,048	19.82	(932,528)
2022122003048	BO	USDMXN	01/18/2023	952	19.82	(18,870)
2022122003296	BO	USDMXN	01/18/2023	26,050	19.93	(519,053)
2022122003336	SO	USDMXN	01/13/2023	(1,000,000)	19.96	19,959,486
2022122003373	BO	USDMXN	01/31/2023	590,500	19.83	(11,711,515)
2022122003374	BO	USDMXN	01/31/2023	590,500	19.94	(11,771,812)
2022122003375	SO	USDMXN	01/09/2023	(325,000)	19.89	6,465,264
2022122003376	SO	USDMXN	01/10/2023	(111,000)	19.90	2,208,551
2022122003411	B	USDMXN	01/23/2023	36,404,720	19.92	(725,000,000)
2022122003420	S	USDMXN	01/23/2023	(36,459,643)	19.89	725,000,000
2022122003562	S	USDMXN	01/23/2023	(221,000)	19.89	4,396,222
2022122003563	BO	USDMXN	01/11/2023	51,200	19.86	(1,016,594)
2022122003567	BO	USDMXN	02/14/2023	1,578,974	19.97	(31,534,077)
2022122103088	SON	USDMXN	01/18/2023	(200,000,000)	19.80	3,960,300,000
2022122103090	BON	USDMXN	01/18/2023	200,000,000	19.85	(3,970,240,000)
2022122103201	B	USDMXN	01/23/2023	10,000,000	19.79	(197,925,000)
2022122103431	BO	USDMXN	01/31/2023	590,500	19.81	(11,695,616)
2022122103433	S	USDMXN	03/23/2023	(10,000,000)	19.98	199,775,000
2022122103434	BO	USDMXN	01/31/2023	590,500	19.86	(11,726,721)
2022122103436	BO	USDMXN	01/04/2023	38,644	19.74	(762,756)
2022122103437	BO	USDMXN	01/25/2023	140,800	19.82	(2,789,982)
2022122103438	BO	USDMXN	01/03/2023	20,000	19.68	(393,597)
2022122103440	BO	USDMXN	01/17/2023	30,000	19.73	(592,046)
2022122103445	BO	USDMXN	01/31/2023	30,000	19.79	(593,594)
2022122203025	BO	USDMXN	01/18/2023	46,050	19.67	(906,022)
2022122203127	BO	USDMXN	02/10/2023	50,000	19.73	(986,474)
2022122203185	B	USDMXN	03/27/2023	20,000,000	19.90	(398,010,000)
2022122203197	BO	USDMXN	01/31/2023	590,500	19.72	(11,643,884)
2022122203199	BO	USDMXN	01/31/2023	590,500	19.69	(11,628,367)
2022122203208	BO	USDMXN	02/09/2023	60,000	19.72	(1,182,951)
2022122203209	BO	USDMXN	02/23/2023	60,000	19.77	(1,186,078)
2022122203210	BO	USDMXN	02/16/2023	60,000	19.74	(1,184,515)
2022122203211	BO	USDMXN	03/02/2023	60,000	19.79	(1,187,667)
2022122203212	BO	USDMXN	03/09/2023	60,000	19.82	(1,189,292)
2022122203213	BO	USDMXN	03/16/2023	60,000	19.85	(1,190,916)
2022122203321	BON	USDMXN	01/24/2023	30,000,000	19.66	(589,830,000)
2022122203334	S	USDMXN	01/27/2023	(30,000,000)	19.70	590,955,000
2022122203357	BO	USDMXN	03/22/2023	3,000,000	19.90	(59,707,038)
2022122203392	BO	USDMXN	01/11/2023	2,500,000	19.62	(49,059,383)
2022122203403	S	USDMXN	01/17/2023	(20,000,000)	19.65	392,910,000
2022122203444	B	USDMXN	03/08/2023	3,000,000	19.83	(59,487,912)
2022122203492	BO	USDMXN	01/11/2023	244,500	19.65	(4,803,954)
2022122203498	SO	USDMXN	02/14/2023	(421,912)	19.76	8,338,770
2022122203510	BO	USDMXN	01/04/2023	113,004	19.62	(2,216,915)
2022122203511	BO	USDMXN	01/11/2023	19	19.65	(374)
2022122303340	B	USDMXN	01/31/2023	590,500	19.53	(11,530,416)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022122303345	B	USDMXN	01/31/2023	590,500	19.53	(11,530,296)
2022122303392	B	USDMXN	01/05/2023	100,000	19.39	(1,938,673)
2022122303395	BO	USDMXN	01/17/2023	30,000	19.44	(583,144)
2022122303397	B	USDMXN	01/23/2023	100,000	19.46	(1,945,883)
2022122303399	B	USDMXN	01/25/2023	21,300	19.47	(414,646)
2022122303408	B	USDMXN	02/07/2023	30,000	19.52	(585,450)
2022122303410	B	USDMXN	01/04/2023	70,706	19.40	(1,371,866)
2022122303412	B	USDMXN	01/06/2023	50,000	19.41	(970,519)
2022122303414	B	USDMXN	01/11/2023	35,372	19.43	(687,193)
2022122303416	B	USDMXN	01/13/2023	36,361	19.43	(706,645)
2022122303418	B	USDMXN	01/18/2023	67,674	19.45	(1,316,342)
2022122303421	B	USDMXN	02/17/2023	11,275	19.56	(220,566)
2022122303424	B	USDMXN	02/23/2023	400,000	19.59	(7,834,083)
2022122303427	B	USDMXN	03/07/2023	30,000	19.63	(588,926)
2022122303527	BO	USDMXN	01/04/2023	108,304	19.42	(2,102,802)
2022122603286	BO	USDMXN	02/01/2023	59,700	19.50	(1,163,914)
2022122603308	BO	USDMXN	02/23/2023	60,000	19.58	(1,174,678)
2022122603309	BO	USDMXN	02/16/2023	60,000	19.55	(1,173,097)
2022122603310	BO	USDMXN	02/09/2023	60,000	19.53	(1,171,517)
2022122603311	BO	USDMXN	03/02/2023	60,000	19.60	(1,176,256)
2022122603312	BO	USDMXN	03/09/2023	60,000	19.63	(1,177,826)
2022122603313	BO	USDMXN	03/16/2023	60,000	19.66	(1,179,397)
2022122603362	BO	USDMXN	01/11/2023	74,000	19.46	(1,440,388)
2022122603363	BO	USDMXN	01/11/2023	468	19.49	(9,122)
2022122703265	BO	USDMXN	01/31/2023	590,000	19.53	(11,523,545)
2022122703511	S	USDMXN	01/12/2023	(1,031,361)	19.53	20,139,488
2022122703512	B	USDMXN	02/14/2023	1,031,361	19.64	(20,260,713)
2022122703513	BO	USDMXN	01/31/2023	500	19.60	(9,801)
2022122703525	S	USDMXN	01/12/2023	(2,686,313)	19.52	52,423,794
2022122703526	B	USDMXN	03/29/2023	2,686,313	19.79	(53,168,583)
2022122703528	S	USDMXN	01/12/2023	(10,437,662)	19.51	203,664,227
2022122703557	BO	EURMXN	01/12/2023	86,636	20.83	(1,804,747)
2022122803052	B	USDMXN	02/09/2023	430,000	19.61	(8,430,674)
2022122803054	B	USDMXN	02/24/2023	430,000	19.66	(8,453,851)
2022122803056	B	USDMXN	03/09/2023	870,000	19.71	(17,143,962)
2022122803058	B	USDMXN	03/24/2023	870,000	19.76	(17,195,005)
2022122803396	B	USDMXN	01/31/2023	1,181,000	19.51	(23,045,517)
2022122903042	S	USDMXN	01/03/2023	(4,000,000)	19.35	77,386,000
2022122903044	S	USDMXN	01/03/2023	(133,760)	19.34	2,586,807
2022122903207	BON	USDMXN	01/31/2023	30,000,000	19.42	(582,495,000)
2022122903221	SON	USDMXN	01/03/2023	(30,000,000)	19.48	584,325,000
2022122903222	BO	USDMXN	01/03/2023	0	19.32	(4,695,000)
2022122903224	B	USDMXN	01/03/2023	20,000,000	19.32	(386,300,000)
2022122903225	S	USDMXN	02/03/2023	(20,000,000)	19.42	388,460,000
2022122903229	B	USDMXN	01/03/2023	10,000,000	19.33	(193,300,000)
2022122903231	S	USDMXN	02/03/2023	(10,000,000)	19.44	194,380,000
2022122903314	S	USDMXN	01/03/2023	(6,000,000)	19.39	116,319,600
2022122903413	S	USDMXN	01/03/2023	(10,074,923)	19.45	195,915,945
2022122903414	B	USDMXN	02/23/2023	10,074,923	19.63	(197,737,330)
2022122903418	BO	USDMXN	01/31/2023	590,500	19.45	(11,483,596)
2022122903476	BO	USDMXN	01/30/2023	20,000	19.44	(388,783)
2022122903477	BO	USDMXN	01/31/2023	10,000	19.44	(194,425)
2022122903478	BO	USDMXN	02/03/2023	20,000	19.45	(389,047)
2022122903479	BO	USDMXN	02/27/2023	350,000	19.52	(6,833,117)
2022122903491	BO	USDMXN	02/17/2023	50,000	19.60	(979,875)
2022122903492	BO	USDMXN	02/28/2023	30,000	19.64	(589,109)
2022122903493	BO	USDMXN	03/07/2023	30,000	19.66	(589,873)
2022122903494	BO	USDMXN	03/14/2023	30,000	19.69	(590,640)
2022123003096	B	USDMXN	01/03/2023	14,000,000	19.42	(271,880,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022123003097	S	USDMXN	01/04/2023	(14,000,000)	19.42	271,924,800
2022123003100	B	USDMXN	01/03/2023	133,760	19.43	(2,598,973)
2022123003101	S	USDMXN	01/04/2023	(133,760)	19.43	2,599,368
2022123003271	BO	USDMXN	02/14/2023	35,000	19.56	(684,483)
2022123003272	BO	USDMXN	02/21/2023	30,000	19.58	(587,464)
2022123003273	BO	USDMXN	03/21/2023	30,000	19.69	(590,552)
2023010203201	BO	USDMXN	02/01/2023	26,300	19.59	(515,233)
2023010303075	S	USDMXN	01/04/2023	(15,000,000)	19.43	291,450,000
2023010303076	B	USDMXN	01/05/2023	15,000,000	19.43	(291,502,500)
2023010303084	S	USDMXN	01/04/2023	(866,240)	19.43	16,829,318
2023010303085	B	USDMXN	01/05/2023	866,240	19.43	(16,832,420)
2023010303280	B	USDMXN	01/05/2023	10,000,000	19.45	(194,450,000)
2023010303281	S	USDMXN	02/07/2023	(10,000,000)	19.56	195,605,000
2023010303284	BON	USDMXN	02/07/2023	30,000,000	19.54	(586,236,000)
2023010303285	SON	USDMXN	01/05/2023	(30,000,000)	19.46	583,890,000
2023010303286	BO	USDMXN	01/05/2023	0	19.43	(1,095,000)
2023010303310	BO	USDMXN	02/01/2023	527,000	19.52	(10,286,431)
2023010303311	BO	USDMXN	02/01/2023	527,500	19.53	(10,303,885)
2023010303318	BO	USDMXN	01/26/2023	10,000	19.47	(194,680)
2023010303319	BO	USDMXN	01/25/2023	10,000	19.46	(194,644)
2023010303320	BO	USDMXN	02/02/2023	10,000	19.49	(194,926)
2023010303321	BO	USDMXN	02/13/2023	20,000	19.53	(390,645)
2023010303331	BO	USDMXN	01/25/2023	37,600	19.51	(733,621)
2023010303332	BO	USDMXN	01/18/2023	150,400	19.49	(2,930,753)
2023010303333	BO	USDMXN	02/08/2023	24,000	19.56	(469,463)
2023010303335	BO	USDMXN	02/01/2023	500	19.51	(9,756)
2023010303336	BO	USDMXN	02/08/2023	800	19.53	(15,628)
2023010303356	BO	USDMXN	01/25/2023	72,000	19.47	(1,401,483)
2023010303389	S	USDMXN	01/12/2023	(2,127,233)	19.42	41,319,401
2023010303390	B	USDMXN	02/14/2023	2,127,233	19.54	(41,571,119)
2023010303392	S	USDMXN	01/12/2023	(203,050)	19.42	3,944,107
2023010303393	B	USDMXN	02/24/2023	203,050	19.58	(3,975,610)
2023010303394	S	USDMXN	01/12/2023	(591,163)	19.42	11,482,711
2023010303395	B	USDMXN	03/14/2023	591,163	19.65	(11,613,707)
2023010303396	S	USDMXN	01/30/2023	(3,565,688)	19.49	69,485,319
2023010303398	B	USDMXN	01/05/2023	2,468,058	19.40	(47,889,701)
2023010303399	S	USDMXN	01/12/2023	(2,468,058)	19.43	47,949,181
2023010303400	B	USDMXN	01/05/2023	255,605	19.40	(4,959,303)
2023010303401	S	USDMXN	01/30/2023	(255,605)	19.49	4,981,473
2023010303404	B	USDMXN	01/05/2023	319,192	19.40	(6,192,159)
2023010303406	B	USDMXN	01/05/2023	202,431	19.40	(3,927,296)
2023010303409	B	USDMXN	01/05/2023	358,938	19.40	(6,963,635)
2023010303419	BO	USDMXN	01/24/2023	68,551	19.47	(1,334,527)
2023010303420	BO	USDMXN	01/27/2023	32,975	19.48	(642,290)
2023010303483	BO	USDMXN	02/21/2023	50,000	19.57	(978,262)
2023010303525	BO	USDMXN	02/07/2023	79,400	19.52	(1,550,125)
2023010403031	S	USDMXN	01/04/2023	(29,600,000)	19.29	570,836,000
2023010403032	B	USDMXN	01/05/2023	29,600,000	19.29	(570,933,680)
2023010403033	S	USDMXN	01/04/2023	(400,000)	19.27	7,709,398
2023010403034	B	USDMXN	01/05/2023	400,000	19.28	(7,710,749)
2023010403154	S	USDMXN	01/05/2023	(30,000,000)	19.37	580,950,000
2023010403155	B	USDMXN	01/06/2023	30,000,000	19.37	(581,051,250)
2023010403159	S	USDMXN	01/05/2023	(866,240)	19.39	16,793,235
2023010403160	B	USDMXN	01/06/2023	866,240	19.39	(16,796,297)
2023010403178	B	USDMXN	01/06/2023	69,303,752	19.33	(1,339,295,000)
2023010403185	S	USDMXN	01/06/2023	(50,000,000)	19.33	966,250,000
2023010403234	S	USDMXN	01/06/2023	(30,000,000)	19.35	580,350,000
2023010403235	B	USDMXN	01/13/2023	30,000,000	19.37	(581,085,000)
2023010403251	BON	USDMXN	02/08/2023	40,000,000	19.48	(779,232,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023010403252	SON	USDMXN	01/06/2023	(40,000,000)	19.85	794,040,000
2023010403253	BO	USDMXN	01/06/2023	0	19.37	(19,390,000)
2023010403300	B	USDMXN	01/06/2023	40,000,000	19.34	(773,400,000)
2023010403301	S	USDMXN	02/07/2023	(40,000,000)	19.45	777,880,000
2023010403309	S	USDMXN	01/06/2023	(1,055,000)	19.35	20,411,507
2023010403310	B	USDMXN	02/01/2023	1,055,000	19.44	(20,508,503)
2023010403348	S	USDMXN	01/06/2023	(738,719)	19.36	14,298,867
2023010403350	S	USDMXN	01/06/2023	(738,718)	19.36	14,298,699
2023010403359	BO	USDMXN	02/03/2023	100,000	19.40	(1,939,811)
2023010403392	BO	USDMXN	02/21/2023	10,000	19.50	(194,959)
2023010403393	BO	USDMXN	02/17/2023	20,000	19.48	(389,627)
2023010403394	BO	USDMXN	02/23/2023	60,000	19.50	(1,170,193)
2023010403395	BO	USDMXN	02/24/2023	110,000	19.51	(2,145,753)
2023010403437	B	USDMXN	01/06/2023	6,000,000	19.38	(116,280,000)
2023010403454	BO	USDMXN	02/09/2023	60,000	19.46	(1,167,315)
2023010403455	BO	USDMXN	02/23/2023	60,000	19.51	(1,170,389)
2023010403456	BO	USDMXN	02/16/2023	60,000	19.48	(1,168,846)
2023010403457	BO	USDMXN	03/02/2023	60,000	19.53	(1,171,934)
2023010403458	BO	USDMXN	03/09/2023	60,000	19.56	(1,173,474)
2023010403459	BO	USDMXN	03/16/2023	60,000	19.58	(1,175,007)
2023010403460	BO	USDMXN	03/23/2023	60,000	19.61	(1,176,541)
2023010403461	BO	USDMXN	03/30/2023	60,000	19.63	(1,178,075)
2023010403563	BO	USDMXN	02/07/2023	28,850	19.49	(562,402)
2023010403581	BO	USDMXN	02/15/2023	584,665	19.52	(11,412,825)
2023010403582	BO	USDMXN	03/15/2023	602,998	19.62	(11,832,938)
2023010403588	S	USDMXN	01/06/2023	(548,871)	19.37	10,633,333
2023010403592	S	USDMXN	01/06/2023	(559,750)	19.37	10,844,037
2023010403600	S	USDMXN	01/06/2023	(735,304)	19.37	14,245,927
2023010403611	BO	USDMXN	01/25/2023	208,800	19.45	(4,060,444)
2023010503043	S	USDMXN	01/06/2023	(16,000,000)	19.41	310,560,000
2023010503044	B	USDMXN	01/09/2023	16,000,000	19.42	(310,724,800)
2023010503047	S	USDMXN	01/06/2023	(866,240)	19.40	16,806,056
2023010503048	B	USDMXN	01/09/2023	866,240	19.41	(16,815,701)
2023010503081	B	USDMXN	01/09/2023	1,000,000	19.39	(19,390,000)
2023010503086	S	USDMXN	01/09/2023	(30,000,000)	19.39	581,760,000
2023010503087	B	USDMXN	02/09/2023	30,000,000	19.50	(585,015,000)
2023010503147	S	USDMXN	01/09/2023	(1,000,000)	19.39	19,390,000
2023010503297	S	USDMXN	01/09/2023	(1,000,000)	19.35	19,351,430
2023010503337	BO	USDMXN	03/13/2023	119,570	19.53	(2,335,442)
2023010503339	BO	USDMXN	02/01/2023	527,000	19.42	(10,232,756)
2023010503340	BO	USDMXN	02/01/2023	527,000	19.44	(10,243,631)
2023010503348	BO	USDMXN	02/01/2023	1,000	19.39	(19,386)
2023010503371	B	USDMXN	01/09/2023	1,000,000	19.31	(19,312,820)
2023010503385	SO	USDMXN	01/24/2023	(326,800)	19.38	6,332,187
2023010503406	S	USDMXN	01/09/2023	(3,000,000)	19.32	57,954,000
2023010503409	S	USDMXN	01/09/2023	(4,000,000)	19.32	77,261,280
2023010503410	B	USDMXN	03/22/2023	4,000,000	19.57	(78,294,032)
2023010503434	BO	USDMXN	01/25/2023	33,600	19.38	(651,161)
2023010503435	BO	USDMXN	03/03/2023	50,000	19.49	(974,643)
2023010503483	BO	USDMXN	02/01/2023	104,000	19.42	(2,019,882)
2023010503510	S	USDMXN	01/09/2023	(120,000)	19.34	2,321,233
2023010503511	B	USDMXN	02/23/2023	120,000	19.50	(2,340,484)
2023010503512	S	USDMXN	01/09/2023	(60,000)	19.34	1,160,602
2023010503513	B	USDMXN	02/16/2023	60,000	19.48	(1,168,719)
2023010503516	S	USDMXN	01/09/2023	(60,000)	19.34	1,160,583
2023010503517	B	USDMXN	02/09/2023	60,000	19.45	(1,167,195)
2023010603035	S	USDMXN	01/06/2023	(10,000,000)	19.23	192,300,000
2023010603036	B	USDMXN	01/09/2023	10,000,000	19.24	(192,403,500)
2023010603037	S	USDMXN	01/06/2023	(20,000,000)	19.23	384,600,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023010603038	B	USDMXN	01/09/2023	20,000,000	19.24	(384,807,000)
2023010603044	B	USDMXN	01/10/2023	1,000,000	19.21	(19,205,080)
2023010603074	B	USDMXN	01/09/2023	133,760	19.18	(2,566,192)
2023010603075	S	USDMXN	01/10/2023	(133,760)	19.19	2,566,623
2023010603087	B	USDMXN	01/09/2023	26,000,000	19.18	(498,550,000)
2023010603088	S	USDMXN	01/10/2023	(26,000,000)	19.18	498,638,400
2023010603265	BO	USDMXN	03/03/2023	30,000	19.41	(582,250)
2023010603266	BO	USDMXN	03/06/2023	20,000	19.42	(388,383)
2023010603283	BO	USDMXN	02/21/2023	10,000	19.43	(194,252)
2023010603284	BO	USDMXN	02/27/2023	10,000	19.45	(194,470)
2023010603285	BO	USDMXN	02/28/2023	10,000	19.45	(194,506)
2023010603286	BO	USDMXN	02/23/2023	10,000	19.43	(194,325)
2023010603287	BO	USDMXN	03/02/2023	30,000	19.46	(583,735)
2023010603288	BO	USDMXN	03/03/2023	30,000	19.46	(583,844)
2023010603290	BO	USDMXN	02/07/2023	100,000	19.33	(1,933,492)
2023010603295	BO	USDMXN	02/21/2023	100,000	19.31	(1,931,125)
2023010603300	BO	USDMXN	02/01/2023	527,500	19.29	(10,174,023)
2023010603303	S	USDMXN	01/10/2023	(400,000)	19.16	7,662,480
2023010603304	B	USDMXN	02/03/2023	400,000	19.24	(7,695,657)
2023010603324	S	USDMXN	01/10/2023	(1,274,293)	19.16	24,413,542
2023010603326	S	USDMXN	01/10/2023	(1,274,293)	19.16	24,413,288
2023010603333	BO	EURUSD	01/09/2023	12,800,000	1.06	(13,590,758)
2023010603370	BO	USDMXN	02/09/2023	350,000	19.34	(6,769,954)
2023010603419	BO	USDMXN	03/16/2023	60,000	19.38	(1,163,097)
2023010603420	BO	USDMXN	03/09/2023	60,000	19.36	(1,161,567)
2023010603421	BO	USDMXN	03/02/2023	60,000	19.33	(1,160,060)
2023010603422	BO	USDMXN	03/23/2023	60,000	19.41	(1,164,619)
2023010603423	BO	USDMXN	03/30/2023	60,000	19.44	(1,166,141)
2023010603511	B	USDMXN	01/10/2023	1,800,000	19.14	(34,459,200)
2023010603512	B	USDMXN	01/10/2023	527,500	19.14	(10,097,553)
2023010603567	BO	USDMXN	03/06/2023	200,000	19.33	(3,866,054)
2023010603592	BO	USDMXN	02/08/2023	29,200	19.24	(561,734)
2023010603594	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.13	2,869,905
2023010603610	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,710
2023010603614	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,605
2023010603616	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,620
2023010603618	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,665
2023010603620	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,740
2023010603622	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,740
2023010603624	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,770
2023010603626	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,710
2023010603628	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,725
2023010603631	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,658
2023010603633	S	USDMXN	01/10/2023	(150,000)	19.15	2,872,581
2023010603637	S	USDMXN	01/10/2023	(527,500)	19.15	10,101,467
2023010603638	B	USDMXN	02/01/2023	527,500	19.23	(10,141,794)
2023010603685	B	USDMXN	01/10/2023	3,000,000	19.15	(57,450,000)
2023010603698	S	USDMXN	01/10/2023	(3,000,000)	19.15	57,459,000
2023010603700	S	USDMXN	01/10/2023	(6,223,700)	19.15	119,204,518
2023010603702	S	USDMXN	01/10/2023	(6,223,700)	19.15	119,207,878
2023010603704	BO	USDMXN	03/10/2023	50,000	19.37	(968,588)
2023010603725	B	USDMXN	01/10/2023	1,000,000	19.16	(19,156,560)
2023010603727	B	USDMXN	01/10/2023	1,000,000	19.15	(19,153,000)
2023010603728	B	USDMXN	01/10/2023	1,000,000	19.15	(19,153,560)
2023010603729	B	USDMXN	01/10/2023	1,000,000	19.15	(19,153,950)
2023010603730	B	USDMXN	01/10/2023	2,000,000	19.15	(38,306,000)
2023010603731	B	USDMXN	01/10/2023	447,400	19.15	(8,569,303)
2023010603739	BO	USDMXN	01/18/2023	37,000	19.17	(709,444)
2023010603765	BO	USDMXN	01/18/2023	384	19.17	(7,360)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023010903005	S	USDMXN	01/11/2023	(1,000,000)	19.17	19,173,600
2023010903096	S	USDMXN	01/09/2023	(58,000,000)	19.16	1,111,454,000
2023010903097	B	USDMXN	01/10/2023	58,000,000	19.17	(1,111,657,000)
2023010903140	B	USDMXN	01/10/2023	6,133,760	19.16	(117,496,672)
2023010903141	S	USDMXN	01/11/2023	(6,133,760)	19.16	117,517,944
2023010903161	S	USDMXN	01/11/2023	(1,000,000)	19.18	19,180,000
2023010903211	B	USDMXN	01/11/2023	1,000,000	19.16	(19,160,000)
2023010903265	S	USDMXN	01/11/2023	(1,000,000)	19.18	19,181,110
2023010903350	B	USDMXN	01/11/2023	1,000,000	19.16	(19,161,170)
2023010903360	S	USDMXN	01/10/2023	(6,133,760)	19.16	117,496,672
2023010903361	B	USDMXN	01/11/2023	6,133,760	19.16	(117,517,944)
2023010903364	B	USDMXN	01/10/2023	6,133,760	19.16	(117,499,736)
2023010903365	S	USDMXN	01/11/2023	(6,133,760)	19.16	117,519,171
2023010903367	B	USDMXN	01/10/2023	6,133,760	19.15	(117,462,933)
2023010903368	S	USDMXN	01/11/2023	(6,133,760)	19.15	117,482,368
2023010903393	S	USDMXN	01/11/2023	(527,500)	19.15	10,101,572
2023010903394	B	USDMXN	02/01/2023	527,500	19.22	(10,139,248)
2023010903416	SO	USDMXN	01/27/2023	(213,000)	19.21	4,092,078
2023010903462	S	USDMXN	01/11/2023	(2,000,000)	19.14	38,280,200
2023010903463	B	USDMXN	01/19/2023	2,000,000	19.17	(38,334,720)
2023010903502	BO	USDMXN	01/25/2023	107,112	19.16	(2,051,814)
2023010903506	B	USDMXN	01/11/2023	15,000,000	19.11	(286,575,000)
2023010903507	S	USDMXN	02/13/2023	(15,000,000)	19.22	288,232,500
2023010903511	S	USDMXN	01/11/2023	(527,500)	19.11	10,079,417
2023010903512	B	USDMXN	02/01/2023	527,500	19.18	(10,117,169)
2023010903518	B	USDMXN	01/11/2023	15,000,000	19.11	(286,575,000)
2023010903519	S	USDMXN	02/13/2023	(15,000,000)	19.22	288,235,500
2023010903583	BO	USDMXN	01/25/2023	32,400	19.20	(622,202)
2023011003052	S	USDMXN	01/10/2023	(18,500,000)	19.12	353,720,000
2023011003053	B	USDMXN	01/11/2023	18,500,000	19.12	(353,781,975)
2023011003054	B	USDMXN	01/10/2023	400,000	19.12	(7,647,945)
2023011003055	S	USDMXN	01/11/2023	(400,000)	19.12	7,649,331
2023011003058	S	USDMXN	01/10/2023	(400,000)	19.12	7,647,945
2023011003059	B	USDMXN	01/11/2023	400,000	19.12	(7,649,331)
2023011003060	B	USDMXN	01/11/2023	133,760	19.14	(2,559,728)
2023011003061	S	USDMXN	01/12/2023	(133,760)	19.14	2,560,149
2023011003080	B	USDMXN	01/11/2023	41,000,000	19.13	(784,125,000)
2023011003081	S	USDMXN	01/12/2023	(41,000,000)	19.13	784,262,350
2023011003116	S	USDMXN	01/12/2023	(527,500)	19.12	10,087,857
2023011003117	B	USDMXN	02/01/2023	527,500	19.19	(10,123,547)
2023011003125	B	USDMXN	01/12/2023	3,000,000	19.13	(57,375,000)
2023011003166	BO	USDMXN	01/19/2023	84,000	19.15	(1,608,739)
2023011003177	B	USDMXN	01/12/2023	1,000,000	19.12	(19,120,000)
2023011003248	S	USDMXN	01/12/2023	(527,500)	19.11	10,081,738
2023011003249	B	USDMXN	02/01/2023	527,500	19.18	(10,117,418)
2023011003258	S	USDMXN	01/12/2023	(50,000)	19.10	955,225
2023011003259	B	USDMXN	03/10/2023	50,000	19.30	(965,081)
2023011003375	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	19.07	1,144,470
2023011003376	B	USDMXN	03/02/2023	60,000	19.24	(1,154,619)
2023011003377	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	19.07	1,144,482
2023011003378	B	USDMXN	03/10/2023	60,000	19.27	(1,156,352)
2023011003379	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	19.08	1,144,500
2023011003380	B	USDMXN	03/17/2023	60,000	19.30	(1,157,966)
2023011003381	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	19.08	1,144,530
2023011003382	B	USDMXN	03/23/2023	60,000	19.32	(1,159,328)
2023011003383	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	19.08	1,144,518
2023011003384	B	USDMXN	03/30/2023	60,000	19.35	(1,160,871)
2023011003385	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	19.08	1,144,518
2023011003408	S	USDMXN	01/30/2023	(2,106,024)	19.13	40,295,312

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023011003409	B	USDMXN	03/14/2023	2,106,024	19.28	(40,613,989)
2023011003440	B	USDMXN	01/12/2023	15,406,127	19.07	(293,805,632)
2023011003441	S	USDMXN	01/30/2023	(15,406,127)	19.13	294,738,165
2023011003450	B	USDMXN	01/12/2023	10,000,000	19.07	(190,680,000)
2023011003451	S	USDMXN	02/13/2023	(10,000,000)	19.18	191,759,000
2023011003478	S	USDMXN	01/12/2023	(930,000)	19.06	17,727,009
2023011003483	S	USDMXN	01/12/2023	(1,000,000)	19.06	19,061,600
2023011003495	S	USDMXN	01/12/2023	(50,000)	19.06	952,815
2023011003496	B	USDMXN	03/10/2023	50,000	19.25	(962,723)
2023011003497	S	USDMXN	01/12/2023	(50,000)	19.06	952,815
2023011003498	B	USDMXN	03/13/2023	50,000	19.27	(963,252)
2023011003548	S	USDMXN	01/12/2023	(1,000,000)	19.06	19,060,800
2023011003549	B	USDMXN	02/14/2023	1,000,000	19.17	(19,173,076)
2023011003550	S	USDMXN	01/12/2023	(1,000,000)	19.06	19,060,800
2023011003551	B	USDMXN	03/14/2023	1,000,000	19.27	(19,274,018)
2023011003579	S	USDMXN	01/12/2023	(199,000)	19.07	3,794,592
2023011003581	S	USDMXN	01/12/2023	(172,000)	19.07	3,279,696
2023011003583	S	USDMXN	01/12/2023	(138,000)	19.07	2,631,384
2023011003587	S	USDMXN	01/12/2023	(788,000)	19.07	15,025,584
2023011003590	S	USDMXN	01/12/2023	(272,000)	19.07	5,186,469
2023011003593	S	USDMXN	01/12/2023	(454,000)	19.07	8,656,781
2023011003595	S	USDMXN	01/12/2023	(267,000)	19.07	5,091,129
2023011003597	S	USDMXN	01/12/2023	(494,000)	19.07	9,419,444
2023011003599	S	USDMXN	01/12/2023	(331,000)	19.07	6,311,409
2023011003609	S	USDMXN	01/12/2023	(30,000)	19.07	572,013
2023011003610	B	USDMXN	02/28/2023	30,000	19.23	(576,884)
2023011003613	S	USDMXN	01/12/2023	(30,000)	19.06	571,929
2023011003614	B	USDMXN	03/07/2023	30,000	19.25	(577,552)
2023011003615	S	USDMXN	01/12/2023	(30,000)	19.06	571,923
2023011003616	B	USDMXN	03/14/2023	30,000	19.28	(578,313)
2023011003617	S	USDMXN	01/12/2023	(30,000)	19.06	571,923
2023011003618	B	USDMXN	03/21/2023	30,000	19.30	(579,103)
2023011003619	S	USDMXN	01/12/2023	(60,000)	19.06	1,143,828
2023011003620	B	USDMXN	03/28/2023	60,000	19.33	(1,159,730)
2023011003635	S	USDMXN	01/12/2023	(68,552)	19.06	1,306,352
2023011003636	B	USDMXN	01/24/2023	68,552	19.10	(1,309,180)
2023011003637	S	USDMXN	01/12/2023	(32,975)	19.06	628,376
2023011003638	B	USDMXN	01/27/2023	32,975	19.11	(630,070)
2023011003639	S	USDMXN	01/12/2023	(71,737)	19.06	1,367,009
2023011003640	B	USDMXN	02/02/2023	71,737	19.13	(1,372,171)
2023011003641	S	USDMXN	01/12/2023	(35,375)	19.06	674,112
2023011003642	B	USDMXN	02/03/2023	35,375	19.13	(676,776)
2023011003722	BO	USDMXN	01/25/2023	35,288	19.12	(674,874)
2023011003726	BO	USDMXN	03/10/2023	100,000	19.27	(1,926,891)
2023011103042	B	USDMXN	01/13/2023	1,000,000	19.06	(19,060,000)
2023011103075	B	USDMXN	01/13/2023	527,500	19.07	(10,059,425)
2023011103082	B	USDMXN	01/12/2023	33,000,000	19.07	(629,310,000)
2023011103083	S	USDMXN	01/13/2023	(33,000,000)	19.07	629,420,550
2023011103089	B	USDMXN	01/12/2023	133,760	19.07	(2,550,524)
2023011103090	S	USDMXN	01/13/2023	(133,760)	19.07	2,550,946
2023011103104	S	USDMXN	01/13/2023	(20,000,000)	19.65	393,000,000
2023011103144	BO	USDMXN	02/01/2023	500,000	19.07	(9,535,981)
2023011103167	BO	USDMXN	01/25/2023	33,600	19.06	(640,386)
2023011103168	BO	USDMXN	02/01/2023	27,500	19.08	(524,814)
2023011103200	S	USDMXN	01/13/2023	(500,000)	19.02	9,510,400
2023011103201	B	USDMXN	02/09/2023	500,000	19.11	(9,556,973)
2023011103245	S	USDMXN	01/13/2023	(527,500)	18.98	10,013,955
2023011103246	B	USDMXN	02/01/2023	527,500	19.05	(10,048,791)
2023011103336	S	USDMXN	01/13/2023	(254,400)	18.95	4,820,193

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023011103337	B	USDMXN	01/25/2023	254,400	18.99	(4,830,804)
2023011103340	S	USDMXN	01/13/2023	(54,400)	18.95	1,030,929
2023011103341	B	USDMXN	02/15/2023	54,400	19.06	(1,037,116)
2023011103344	S	USDMXN	01/13/2023	(67,600)	18.95	1,281,223
2023011103345	B	USDMXN	03/01/2023	67,600	19.12	(1,292,294)
2023011103363	BO	USDMXN	03/21/2023	40,000	19.25	(770,125)
2023011103406	SO	USDMXN	01/30/2023	(159,000)	19.02	3,023,758
2023011103440	SO	USDMXN	01/24/2023	(20,000)	19.00	379,955
2023011103495	BO	USDMXN	02/15/2023	84,500	19.07	(1,611,409)
2023011103518	BO	USDMXN	02/01/2023	31,200	19.01	(593,266)
2023011103521	BO	USDMXN	03/13/2023	100,000	19.16	(1,915,699)
2023011103522	BO	USDMXN	03/23/2023	50,000	19.20	(960,082)
2023011103576	BO	USDMXN	02/15/2023	27,200	19.07	(518,684)
2023011203087	S	USDMXN	01/17/2023	(1,582,135)	18.88	29,874,506
2023011203088	B	USDMXN	02/07/2023	1,582,135	18.95	(29,989,035)
2023011203089	S	USDMXN	01/17/2023	(1,582,135)	18.89	29,883,208
2023011203090	B	USDMXN	02/13/2023	1,582,135	18.98	(30,030,268)
2023011203091	S	USDMXN	01/17/2023	(2,766,701)	18.89	52,262,152
2023011203092	B	USDMXN	03/07/2023	2,766,701	19.06	(52,736,890)
2023011203095	S	USDMXN	01/17/2023	(341,644)	18.91	6,459,169
2023011203098	S	USDMXN	01/17/2023	(667,253)	18.90	12,610,755
2023011203100	S	USDMXN	01/17/2023	(466,288)	18.90	8,812,232
2023011203102	S	USDMXN	01/17/2023	(766,219)	18.90	14,482,014
2023011203104	S	USDMXN	01/17/2023	(1,620,784)	18.90	30,639,122
2023011203106	S	USDMXN	01/17/2023	(2,787,232)	18.91	52,694,516
2023011203108	S	USDMXN	01/17/2023	(4,570,140)	18.90	86,386,340
2023011203110	S	USDMXN	01/17/2023	(2,658,731)	18.91	50,265,995
2023011203112	S	USDMXN	01/17/2023	(2,953,101)	18.91	55,830,589
2023011203117	S	USDMXN	01/17/2023	(2,953,101)	18.91	55,832,922
2023011203119	S	USDMXN	01/13/2023	(17,000,000)	18.90	321,232,000
2023011203120	B	USDMXN	01/17/2023	17,000,000	18.91	(321,458,950)
2023011203121	S	USDMXN	01/17/2023	(2,766,701)	18.90	52,286,444
2023011203122	B	USDMXN	03/14/2023	2,766,701	19.09	(52,827,981)
2023011203125	B	USDMXN	01/13/2023	133,760	18.91	(2,528,785)
2023011203126	S	USDMXN	01/17/2023	(133,760)	18.92	2,530,481
2023011203245	B	USDMXN	01/17/2023	500,000	18.85	(9,426,260)
2023011203251	S	USDMXN	01/17/2023	(500,000)	18.85	9,423,575
2023011203293	BO	USDMXN	03/01/2023	12,800	19.02	(243,460)
2023011203294	BO	USDMXN	02/01/2023	76,000	18.92	(1,438,140)
2023011203295	BO	USDMXN	03/15/2023	12,800	19.07	(244,099)
2023011203296	BO	USDMXN	03/29/2023	12,400	19.12	(237,104)
2023011203297	BO	USDMXN	03/29/2023	400	19.13	(7,652)
2023011203305	BO	USDMXN	03/16/2023	10,000	19.11	(191,105)
2023011203306	BO	USDMXN	03/13/2023	10,000	19.10	(190,997)
2023011203307	BO	USDMXN	03/21/2023	20,000	19.13	(382,575)
2023011203308	BO	USDMXN	03/14/2023	10,000	19.10	(191,033)
2023011203309	BO	USDMXN	03/22/2023	30,000	19.13	(573,973)
2023011203310	BO	USDMXN	03/23/2023	20,000	19.14	(382,722)
2023011203399	S	USDMXN	01/17/2023	(7,000,000)	18.87	132,104,000
2023011203445	SO	USDMXN	01/31/2023	(166,000)	18.91	3,138,647
2023011203475	BO	USDMXN	03/24/2023	50,000	19.12	(955,893)
2023011203503	S	USDMXN	01/17/2023	(527,500)	18.83	9,935,357
2023011203504	B	USDMXN	02/01/2023	527,500	18.89	(9,962,401)
2023011203531	BO	USDMXN	01/27/2023	348,000	18.87	(6,567,312)
2023011203535	BO	USDMXN	02/23/2023	380,000	18.96	(7,205,288)
2023011203616	BO	USDMXN	02/07/2023	300,000	18.91	(5,674,326)
2023011203617	BO	USDMXN	03/03/2023	300,000	19.00	(5,699,763)
2023011203677	BO	USDMXN	01/20/2023	10,000	18.85	(188,510)
2023011203678	BO	USDMXN	01/25/2023	10,000	18.87	(188,678)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023011203679	BO	USDMXN	02/07/2023	30,000	18.91	(567,392)
2023011203715	B	USDMXN	01/17/2023	1,000,000	18.85	(18,853,360)
2023011203717	B	USDMXN	01/17/2023	1,000,000	18.85	(18,850,000)
2023011203748	BO	USDMXN	01/25/2023	34,312	18.87	(647,519)
2023011203749	BO	USDMXN	02/15/2023	55,200	18.94	(1,045,736)
2023011203750	BO	USDMXN	02/22/2023	103,600	18.97	(1,965,225)
2023011203751	BO	USDMXN	02/23/2023	296	18.97	(5,611)
2023011203752	BO	USDMXN	01/27/2023	97	18.87	(1,833)
2023011303046	B	USDMXN	01/18/2023	1,000,000	18.85	(18,845,330)
2023011303094	S	USDMXN	01/17/2023	(9,000,000)	18.85	169,686,000
2023011303095	B	USDMXN	01/18/2023	9,000,000	18.86	(169,716,600)
2023011303097	S	USDMXN	01/17/2023	(973,931)	18.85	18,360,140
2023011303098	B	USDMXN	01/18/2023	973,931	18.86	(18,363,570)
2023011303132	S	USDMXN	01/18/2023	(1,000,000)	18.81	18,812,640
2023011303184	B	USDMXN	01/18/2023	800,000	18.79	(15,031,400)
2023011303185	B	USDMXN	01/18/2023	1,000,000	18.79	(18,788,000)
2023011303299	B	USDMXN	01/18/2023	100,000	18.79	(1,878,893)
2023011303306	S	USDMXN	01/18/2023	(1,874,373)	18.79	35,211,759
2023011303308	S	USDMXN	01/18/2023	(967,327)	18.79	18,172,083
2023011303360	B	USDMXN	02/21/2023	10,000,000	18.90	(189,035,000)
2023011303361	S	USDMXN	03/21/2023	(10,000,000)	19.00	190,030,000
2023011303404	SO	USDMXN	01/20/2023	(10,000,000)	18.78	187,775,202
2023011303423	S	USDMXN	01/18/2023	(100,000)	18.77	1,876,511
2023011303424	B	USDMXN	03/13/2023	100,000	18.96	(1,895,594)
2023011303427	S	USDMXN	01/18/2023	(100,000)	18.77	1,876,700
2023011303428	B	USDMXN	03/13/2023	100,000	18.96	(1,895,716)
2023011303430	S	USDMXN	01/18/2023	(300,000)	18.76	5,629,350
2023011303431	B	USDMXN	03/24/2023	300,000	18.99	(5,698,050)
2023011303432	S	USDMXN	01/18/2023	(1,000,000)	18.76	18,764,600
2023011303434	B	USDMXN	01/18/2023	41,700	18.77	(782,646)
2023011303494	S	USDMXN	01/18/2023	(637,147)	18.76	11,953,184
2023011303496	S	USDMXN	01/18/2023	(637,147)	18.76	11,951,138
2023011303498	S	USDMXN	01/18/2023	(369,360)	18.76	6,929,364
2023011303500	S	USDMXN	01/18/2023	(369,361)	18.76	6,930,505
2023011303502	S	USDMXN	01/18/2023	(745,866)	18.76	13,994,937
2023011303504	S	USDMXN	01/18/2023	(745,866)	18.76	13,994,937
2023011303656	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,583
2023011303657	B	USDMXN	01/25/2023	977,000	18.78	(18,345,304)
2023011303658	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,583
2023011303659	B	USDMXN	02/01/2023	977,000	18.80	(18,368,357)
2023011303662	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,583
2023011303663	B	USDMXN	02/08/2023	977,000	18.82	(18,391,848)
2023011303664	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,583
2023011303665	B	USDMXN	02/15/2023	977,000	18.85	(18,415,498)
2023011303666	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,583
2023011303667	B	USDMXN	02/22/2023	977,000	18.87	(18,439,318)
2023011303669	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,583
2023011303670	B	USDMXN	03/01/2023	977,000	18.90	(18,464,156)
2023011303671	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,583
2023011303672	B	USDMXN	03/08/2023	977,000	18.92	(18,488,994)
2023011303673	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,583
2023011303674	B	USDMXN	03/15/2023	977,000	18.95	(18,513,684)
2023011303675	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,681
2023011303676	B	USDMXN	03/22/2023	977,000	18.97	(18,537,365)
2023011303677	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,681
2023011303678	B	USDMXN	03/29/2023	977,000	19.00	(18,562,852)
2023011303679	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.75	18,321,681
2023011303681	S	USDMXN	01/18/2023	(977,000)	18.76	18,325,198
2023011303745	B	USDMXN	01/18/2023	500,000	18.77	(9,385,915)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023011303746	B	USDMXN	01/18/2023	500,000	18.77	(9,386,550)
2023011303747	B	USDMXN	01/18/2023	400,000	18.77	(7,508,244)
2023011303850	SO	USDMXN	02/03/2023	(210,000)	18.82	3,951,390
2023011303851	BO	USDMXN	03/31/2023	50,000	19.03	(951,310)
2023011303855	BO	USDMXN	02/08/2023	49,200	18.84	(927,094)
2023011303856	BO	USDMXN	02/15/2023	48,800	18.87	(920,749)
2023011303857	BO	USDMXN	03/08/2023	45,600	18.94	(863,827)
2023011303858	BO	USDMXN	01/25/2023	9,115	18.79	(171,309)
2023011303859	BO	USDMXN	03/28/2023	20,000	19.03	(380,510)
2023011303860	BO	USDMXN	03/29/2023	30,000	19.03	(570,874)
2023011303865	BO	USDMXN	01/25/2023	125,573	18.80	(2,361,201)
2023011603137	B	USDMXN	01/18/2023	1,500,000	18.81	(28,210,500)
2023011603188	BON	USDMXN	01/18/2023	200,000,000	20.35	(4,069,560,000)
2023011603189	SON	USDMXN	01/18/2023	(200,000,000)	20.35	4,070,000,000
2023011603190	BON	USDMXN	01/18/2023	200,000,000	19.80	(3,960,300,000)
2023011603191	SON	USDMXN	01/18/2023	(200,000,000)	19.85	3,970,240,000
2023011603192	SO	USDMXN	01/18/2023	0	18.80	201,200,000
2023011603193	BO	USDMXN	01/18/2023	0	18.80	(310,900,000)
2023011603194	SO	USDMXN	01/18/2023	0	18.80	310,460,000
2023011603195	BO	USDMXN	01/18/2023	0	18.80	(211,140,000)
2023011603316	BO	USDMXN	01/23/2023	1,300,000	18.80	(24,444,224)
2023011603347	BO	USDMXN	01/23/2023	31,560	18.80	(593,431)
2023011603413	BO	USDMXN	02/15/2023	56,500	18.89	(1,067,384)
2023011603414	S	USDMXN	01/18/2023	(20,000)	18.79	375,834
2023011603415	B	USDMXN	02/08/2023	20,000	18.87	(377,306)
2023011603417	S	USDMXN	01/18/2023	(10,000)	18.79	187,921
2023011603418	B	USDMXN	02/14/2023	10,000	18.89	(188,863)
2023011603419	S	USDMXN	01/18/2023	(10,000)	18.79	187,925
2023011603420	B	USDMXN	02/16/2023	10,000	18.89	(188,936)
2023011603421	S	USDMXN	01/18/2023	(10,000)	18.79	187,920
2023011603422	B	USDMXN	02/17/2023	10,000	18.90	(188,966)
2023011603456	BO	USDMXN	01/25/2023	92,496	18.82	(1,740,420)
2023011603457	BO	USDMXN	02/01/2023	102,400	18.84	(1,929,287)
2023011603458	BO	USDMXN	02/08/2023	165,600	18.86	(3,123,924)
2023011603460	BO	USDMXN	02/15/2023	32,400	18.89	(612,002)
2023011603487	BO	USDMXN	02/22/2023	64,800	18.91	(1,225,503)
2023011703048	S	USDMXN	01/19/2023	(1,000,000)	18.82	18,819,860
2023011703063	B	USDMXN	01/19/2023	1,000,000	18.79	(18,790,000)
2023011703065	S	USDMXN	01/17/2023	(50,000,000)	18.80	940,000,000
2023011703066	B	USDMXN	01/18/2023	50,000,000	18.80	(940,175,000)
2023011703067	S	USDMXN	01/19/2023	(500,000)	18.79	9,395,930
2023011703070	S	USDMXN	01/19/2023	(500,000)	18.79	9,394,825
2023011703073	S	USDMXN	01/19/2023	(500,000)	18.79	9,394,995
2023011703143	B	USDMXN	01/18/2023	526,069	18.78	(9,880,324)
2023011703144	S	USDMXN	01/19/2023	(526,069)	18.78	9,882,045
2023011703158	S	USDMXN	01/17/2023	(53,191,489)	18.80	1,000,000,000
2023011703159	B	USDMXN	01/18/2023	53,181,589	18.80	(1,000,000,000)
2023011703172	B	USDMXN	01/17/2023	3,000,000	18.78	(56,340,000)
2023011703173	S	USDMXN	01/18/2023	(3,000,000)	18.78	56,350,800
2023011703179	B	USDMXN	01/17/2023	191,489	18.77	(3,593,954)
2023011703180	S	USDMXN	01/18/2023	(191,489)	18.77	3,594,607
2023011703207	B	USDMXN	01/18/2023	9,901	18.77	(185,817)
2023011703208	S	USDMXN	01/19/2023	(9,901)	18.77	185,849
2023011703248	S	USDMXN	01/19/2023	(2,600,000)	18.74	48,727,952
2023011703250	S	USDMXN	01/19/2023	(1,600,000)	18.74	29,982,576
2023011703262	S	USDMXN	01/19/2023	(1,000,000)	18.75	18,746,600
2023011703273	B	USDMXN	01/20/2023	30,686,356	18.77	(575,829,470)
2023011703274	S	USDMXN	01/27/2023	(30,647,159)	18.79	575,829,470
2023011703287	S	USDMXN	01/20/2023	(30,698,626)	18.76	575,829,470

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023011703289	B	USDMXN	01/27/2023	30,659,234	18.78	(575,829,470)
2023011703309	S	USDMXN	01/19/2023	(1,055,000)	18.74	19,774,920
2023011703310	B	USDMXN	02/28/2023	1,055,000	18.88	(19,921,871)
2023011703358	BON	USDMXN	02/21/2023	30,000,000	18.88	(566,265,000)
2023011703363	S	USDMXN	01/19/2023	(26,000,000)	18.76	487,851,000
2023011703486	BO	USDMXN	02/22/2023	12,800	18.82	(240,837)
2023011703487	BO	USDMXN	03/01/2023	20,000	18.84	(376,759)
2023011703509	B	USDMXN	01/19/2023	292,427	18.70	(5,468,973)
2023011703511	B	USDMXN	01/19/2023	291,836	18.71	(5,458,786)
2023011703574	S	USDMXN	01/19/2023	(1,000,000)	18.69	18,687,270
2023011703580	S	USDMXN	01/19/2023	(5,000,000)	18.67	93,346,700
2023011703596	S	USDMXN	01/19/2023	(3,429,000)	18.67	64,033,626
2023011703633	BO	USDMXN	02/15/2023	250,000	18.79	(4,696,399)
2023011703690	S	USDMXN	01/30/2023	(341,819)	18.73	6,402,216
2023011703691	B	USDMXN	02/24/2023	341,819	18.82	(6,432,023)
2023011703692	S	USDMXN	01/30/2023	(2,350,961)	18.73	44,042,586
2023011703693	B	USDMXN	03/14/2023	2,350,961	18.89	(44,398,800)
2023011703694	S	USDMXN	01/30/2023	(1,595,103)	18.73	29,881,874
2023011703700	B	USDMXN	01/19/2023	10,432,546	18.69	(195,035,395)
2023011703701	S	USDMXN	01/30/2023	(10,432,546)	18.73	195,420,168
2023011703704	BO	USDMXN	03/06/2023	10,000	18.87	(188,748)
2023011703705	BO	USDMXN	03/07/2023	10,000	18.88	(188,782)
2023011703706	BO	USDMXN	03/09/2023	10,000	18.89	(188,853)
2023011803036	S	USDMXN	01/18/2023	(50,000,000)	18.61	930,700,000
2023011803037	B	USDMXN	01/19/2023	50,000,000	18.62	(930,877,500)
2023011803104	B	USDMXN	01/19/2023	835,970	18.63	(15,577,257)
2023011803105	S	USDMXN	01/20/2023	(835,970)	18.64	15,580,050
2023011803106	S	USDMXN	01/20/2023	(1,000,000)	18.64	18,638,280
2023011803107	S	USDMXN	01/20/2023	(1,000,000)	18.65	18,648,370
2023011803123	B	USDMXN	01/20/2023	2,000,000	18.70	(37,402,000)
2023011803127	B	USDMXN	01/19/2023	33,000,000	18.69	(616,770,000)
2023011803128	S	USDMXN	01/20/2023	(33,000,000)	18.69	616,885,500
2023011803238	SON	USDMXN	01/20/2023	(40,000,000)	20.35	814,000,000
2023011803239	BO	USDMXN	01/20/2023	0	18.70	(65,840,000)
2023011803240	B	USDMXN	01/20/2023	40,000,000	18.63	(745,160,000)
2023011803273	B	USDMXN	01/20/2023	30,000,000	18.79	(563,700,000)
2023011803274	S	USDMXN	02/21/2023	(30,000,000)	18.90	567,030,000
2023011803346	S	USDMXN	01/20/2023	(1,055,000)	18.79	19,827,776
2023011803347	B	USDMXN	02/28/2023	1,055,000	18.93	(19,972,130)
2023011803380	B	USDMXN	01/20/2023	12,700,000	18.81	(238,845,090)
2023011803381	S	USDMXN	02/21/2023	(12,700,000)	18.92	240,241,138
2023011803499	SO	USDMXN	02/07/2023	(210,000)	18.89	3,965,871
2023011803628	S	USDMXN	01/20/2023	(1,000,000)	18.87	18,870,000
2023011903005	B	USDMXN	01/23/2023	1,000,000	18.92	(18,918,490)
2023011903057	B	USDMXN	01/23/2023	25,000,000	18.93	(473,125,000)
2023011903058	S	USDMXN	01/30/2023	(25,000,000)	18.95	473,742,500
2023011903061	S	USDMXN	01/23/2023	(1,000,000)	18.95	18,949,550
2023011903115	S	USDMXN	01/23/2023	(1,000,000)	18.98	18,980,870
2023011903165	B	USDMXN	01/23/2023	1,000,000	19.03	(19,025,580)
2023011903189	S	USDMXN	01/20/2023	(30,000,000)	19.00	570,000,000
2023011903190	B	USDMXN	01/23/2023	30,000,000	19.01	(570,327,000)
2023011903209	B	USDMXN	01/20/2023	50,000,000	18.98	(948,750,000)
2023011903210	S	USDMXN	01/23/2023	(50,000,000)	18.99	949,290,000
2023011903214	B	USDMXN	01/20/2023	13,000,000	18.97	(246,590,500)
2023011903215	S	USDMXN	01/23/2023	(13,000,000)	18.98	246,731,550
2023011903226	B	USDMXN	01/20/2023	848,239	19.03	(16,139,146)
2023011903227	S	USDMXN	01/23/2023	(848,239)	19.04	16,147,677
2023011903384	S	USDMXN	01/19/2023	(120,000,000)	19.02	2,282,824,608
2023011903385	B	USDMXN	01/20/2023	120,000,000	19.03	(2,283,329,820)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023011903506	B	USDMXN	01/23/2023	1,000,000	19.03	(19,030,000)
2023011903522	S	USDMXN	01/23/2023	(10,000,000)	19.03	190,300,000
2023011903527	S	USDMXN	01/23/2023	(10,000,000)	19.03	190,300,000
2023011903528	B	USDMXN	03/23/2023	10,000,000	19.24	(192,420,000)
2023011903561	BO	USDMXN	02/03/2023	300,000	19.07	(5,722,295)
2023011903562	SO	USDMXN	01/26/2023	(908,000)	19.07	17,316,001
2023011903563	BO	USDMXN	02/28/2023	527,500	19.19	(10,124,599)
2023011903587	B	USDMXN	01/23/2023	1,200,000	19.00	(22,800,000)
2023011903602	BO	USDMXN	01/26/2023	10,000	19.08	(190,767)
2023011903603	BO	USDMXN	02/16/2023	29,315	19.15	(561,448)
2023011903606	BO	USDMXN	02/22/2023	32,400	19.09	(618,560)
2023011903688	BO	USDMXN	03/15/2023	40,953	19.22	(787,002)
2023011903690	BO	USDMXN	02/15/2023	66,509	19.12	(1,271,382)
2023011903693	BO	USDMXN	02/15/2023	640	19.05	(12,192)
2023011903694	SO	USDMXN	01/26/2023	(2,404)	18.97	45,620
2023011903697	SO	USDMXN	01/27/2023	(314,509)	18.97	5,966,665
2023011903698	SO	USDMXN	02/07/2023	(216,000)	19.01	4,106,210
2023011903699	SO	USDMXN	02/22/2023	(329,300)	19.06	6,277,538
2023011903703	S	USDMXN	01/23/2023	(1,200,000)	18.98	22,778,016
2023012003015	S	USDMXN	01/20/2023	(50,000,000)	18.95	947,500,000
2023012003016	B	USDMXN	01/23/2023	50,000,000	18.96	(948,200,000)
2023012003102	B	USDMXN	01/23/2023	903,162	18.92	(17,091,813)
2023012003103	S	USDMXN	01/24/2023	(903,162)	18.93	17,095,144
2023012003230	B	USDMXN	01/23/2023	28,000,000	18.91	(529,340,000)
2023012003231	S	USDMXN	01/24/2023	(28,000,000)	18.91	529,442,200
2023012003242	BON	USDMXN	02/23/2023	30,000,000	19.02	(570,696,000)
2023012003244	SON	USDMXN	01/24/2023	(30,000,000)	19.66	589,830,000
2023012003245	BO	USDMXN	01/24/2023	0	18.92	(22,305,000)
2023012003381	SO	USDMXN	02/10/2023	(200,000)	18.91	3,781,654
2023012003418	BO	USDMXN	02/28/2023	527,500	19.05	(10,046,567)
2023012003586	SO	USDMXN	01/27/2023	(371,852)	18.90	7,027,339
2023012003589	SO	USDMXN	02/10/2023	(10,000)	18.95	189,484
2023012003615	SO	USDMXN	02/03/2023	(103,024)	18.91	1,948,002
2023012003624	BO	USDMXN	02/01/2023	93,132	18.91	(1,761,015)
2023012303004	S	USDMXN	01/23/2023	(30,000,000)	18.86	565,650,000
2023012303005	B	USDMXN	01/24/2023	30,000,000	18.86	(565,758,000)
2023012303099	B	USDMXN	01/24/2023	903,162	18.84	(17,013,481)
2023012303100	S	USDMXN	01/25/2023	(903,162)	18.84	17,016,569
2023012303124	B	USDMXN	01/25/2023	15,000,000	18.87	(283,050,000)
2023012303125	S	USDMXN	03/27/2023	(15,000,000)	19.08	286,272,000
2023012303222	BON	USDMXN	03/28/2023	30,000,000	19.03	(571,035,000)
2023012303224	SON	USDMXN	01/25/2023	(30,000,000)	19.67	590,070,000
2023012303225	BO	USDMXN	01/25/2023	0	18.82	(25,545,000)
2023012303387	B	USDMXN	01/25/2023	15,000,000	18.82	(282,300,000)
2023012303388	S	USDMXN	02/27/2023	(15,000,000)	18.93	284,017,500
2023012303433	BO	USDMXN	02/08/2023	213,200	18.87	(4,023,503)
2023012303434	BO	USDMXN	03/01/2023	40,200	18.94	(761,587)
2023012303435	BO	USDMXN	03/08/2023	83,600	18.97	(1,585,910)
2023012303436	BO	USDMXN	02/15/2023	51,100	18.90	(965,612)
2023012303437	BO	USDMXN	03/29/2023	44,900	19.05	(855,142)
2023012303439	S	USDMXN	02/15/2023	(51,100)	18.89	965,315
2023012303440	B	USDMXN	03/15/2023	51,100	18.99	(970,523)
2023012303443	BO	USDMXN	02/01/2023	32,044	18.84	(603,839)
2023012303444	BO	USDMXN	03/29/2023	700	19.04	(13,330)
2023012303604	BO	USDMXN	02/01/2023	62,000	18.84	(1,168,209)
2023012303605	BO	USDMXN	02/08/2023	227,324	18.87	(4,288,907)
2023012303607	BO	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.95	(9,994,263)
2023012303608	S	USDMXN	01/25/2023	(527,500)	18.81	9,924,216
2023012303609	B	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.94	(9,988,236)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023012403033	S	USDMXN	01/24/2023	(40,000,000)	18.83	753,220,000
2023012403034	B	USDMXN	01/25/2023	40,000,000	18.83	(753,358,000)
2023012403045	B	USDMXN	01/25/2023	903,162	18.87	(17,043,170)
2023012403046	S	USDMXN	01/26/2023	(903,162)	18.87	17,046,193
2023012403051	B	USDMXN	01/26/2023	1,000,000	18.87	(18,866,130)
2023012403124	B	USDMXN	01/26/2023	1,000,000	18.85	(18,846,390)
2023012403149	S	USDMXN	01/26/2023	(1,000,000)	18.82	18,817,060
2023012403150	S	USDMXN	01/26/2023	(1,000,000)	18.82	18,815,440
2023012403188	B	USDMXN	01/25/2023	18,000,000	18.82	(338,670,000)
2023012403189	S	USDMXN	01/26/2023	(18,000,000)	18.82	338,732,100
2023012403342	SO	USDMXN	02/02/2023	(1,100,000)	18.86	20,746,319
2023012403430	B	USDMXN	01/26/2023	1,100,000	18.83	(20,709,325)
2023012403431	S	USDMXN	02/03/2023	(1,100,000)	18.85	20,739,797
2023012403434	B	USDMXN	01/30/2023	688,457	18.84	(12,967,501)
2023012403435	S	USDMXN	02/24/2023	(688,457)	18.92	13,026,105
2023012403436	S	MXNUSD	01/30/2023	(97,627)	18.84	5,183
2023012403439	B	USDMXN	01/30/2023	92,585	18.84	(1,744,051)
2023012403442	S	USDMXN	01/26/2023	(5,718,177)	18.82	107,616,087
2023012403443	B	USDMXN	01/30/2023	5,718,177	18.83	(107,697,736)
2023012403444	BO	USDMXN	03/29/2023	1,528,171	19.06	(29,119,986)
2023012403447	B	USDMXN	01/26/2023	64,189	18.82	(1,208,236)
2023012403448	S	USDMXN	02/02/2023	(64,189)	18.85	1,209,783
2023012403450	B	USDMXN	01/26/2023	43,720	18.82	(822,938)
2023012403451	S	USDMXN	02/03/2023	(43,720)	18.85	824,143
2023012403597	B	USDMXN	01/27/2023	1,100,000	18.83	(20,709,325)
2023012403598	S	USDMXN	02/03/2023	(1,100,000)	18.85	20,735,882
2023012403601	S	USDMXN	01/26/2023	(205,320)	18.80	3,860,197
2023012403602	B	USDMXN	02/08/2023	205,320	18.85	(3,869,749)
2023012403603	S	USDMXN	01/26/2023	(106,920)	18.80	2,010,155
2023012403604	B	USDMXN	02/15/2023	106,920	18.87	(2,017,747)
2023012403605	S	USDMXN	01/26/2023	(106,920)	18.80	2,010,454
2023012403606	B	USDMXN	02/22/2023	106,920	18.90	(2,020,607)
2023012403607	S	USDMXN	01/26/2023	(71,280)	18.80	1,340,306
2023012403608	B	USDMXN	03/01/2023	71,280	18.92	(1,348,806)
2023012403609	S	USDMXN	01/26/2023	(249,480)	18.80	4,691,022
2023012403610	B	USDMXN	03/08/2023	249,480	18.95	(4,727,089)
2023012403611	S	USDMXN	01/26/2023	(249,480)	18.80	4,691,052
2023012403612	B	USDMXN	03/22/2023	249,480	19.00	(4,739,651)
2023012403613	S	USDMXN	01/26/2023	(166,320)	18.80	3,127,500
2023012403615	S	USDMXN	01/26/2023	(249,480)	18.80	4,691,082
2023012403616	B	USDMXN	03/29/2023	249,480	19.02	(4,745,972)
2023012403617	BO	MXNUSD	02/02/2023	35,873	18.83	(1,905)
2023012403618	SO	USDMXN	02/02/2023	(33,968)	18.83	639,539
2023012403619	S	USDMXN	01/26/2023	(1,000,000)	18.80	18,804,030
2023012403621	S	USDMXN	01/26/2023	(2,000,000)	18.81	37,610,000
2023012403654	BO	USDMXN	02/08/2023	126,572	18.85	(2,385,997)
2023012403655	BO	USDMXN	02/15/2023	15,390	18.88	(290,492)
2023012403656	BO	USDMXN	03/08/2023	71,820	18.95	(1,360,915)
2023012403657	BO	USDMXN	03/22/2023	35,218	19.00	(669,115)
2023012403658	BO	USDMXN	03/22/2023	692	18.99	(13,142)
2023012503106	B	USDMXN	01/27/2023	1,000,000	18.80	(18,795,610)
2023012503111	B	USDMXN	01/27/2023	15,000,000	18.80	(281,925,000)
2023012503112	S	USDMXN	02/27/2023	(15,000,000)	18.90	283,485,000
2023012503115	S	USDMXN	01/27/2023	(1,000,000)	18.81	18,805,840
2023012503120	B	USDMXN	01/27/2023	1,000,000	18.79	(18,786,530)
2023012503136	B	USDMXN	01/27/2023	1,000,000	18.79	(18,792,700)
2023012503138	S	USDMXN	01/26/2023	(1,096,838)	18.79	20,607,432
2023012503139	B	USDMXN	01/27/2023	1,096,838	18.79	(20,611,118)
2023012503159	S	USDMXN	01/27/2023	(1,000,000)	18.81	18,814,070

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023012503177	B	USDMXN	01/27/2023	20,000,000	18.80	(376,060,000)
2023012503199	B	USDMXN	01/27/2023	20,000,000	18.83	(376,540,000)
2023012503203	SON	USDMXN	01/27/2023	(37,000,000)	20.23	748,602,500
2023012503204	BO	USDMXN	01/27/2023	0	18.82	(52,133,000)
2023012503325	S	USDMXN	01/27/2023	(1,000,000)	18.84	18,835,000
2023012503326	B	USDMXN	01/27/2023	1,311,577	18.83	(24,700,339)
2023012503327	S	USDMXN	02/09/2023	(1,311,577)	18.88	24,757,842
2023012503336	S	USDMXN	01/27/2023	(311,577)	18.83	5,867,930
2023012503360	BO	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.90	(9,967,700)
2023012503450	S	USDMXN	01/27/2023	(283,000)	18.81	5,323,796
2023012503460	S	USDMXN	01/27/2023	(1,000,000)	18.82	18,815,520
2023012503507	BO	USDMXN	03/01/2023	145,600	18.92	(2,755,307)
2023012503510	B	USDMXN	01/27/2023	283,000	18.81	(5,323,502)
2023012503511	S	USDMXN	02/13/2023	(283,000)	18.87	5,339,612
2023012503578	BO	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.91	(9,973,164)
2023012503610	S	USDMXN	01/27/2023	(2,100,000)	18.78	39,444,888
2023012603007	B	USDMXN	01/30/2023	1,000,000	18.86	(18,855,670)
2023012603012	S	USDMXN	01/26/2023	(10,000,000)	18.86	188,630,000
2023012603013	B	USDMXN	01/27/2023	10,000,000	18.87	(188,663,000)
2023012603036	S	USDMXN	01/30/2023	(1,000,000)	18.84	18,841,940
2023012603088	B	USDMXN	01/30/2023	1,000,000	18.83	(18,833,420)
2023012603089	B	USDMXN	01/30/2023	10,000,000	18.86	(188,600,000)
2023012603090	S	USDMXN	02/28/2023	(10,000,000)	18.96	189,580,000
2023012603093	S	USDMXN	01/30/2023	(1,000,000)	18.86	18,860,680
2023012603094	B	USDMXN	01/27/2023	891,087	18.85	(16,799,442)
2023012603095	S	USDMXN	01/30/2023	(891,087)	18.86	16,807,596
2023012603099	B	USDMXN	01/27/2023	8,000,000	18.86	(150,880,000)
2023012603100	S	USDMXN	01/30/2023	(8,000,000)	18.87	150,956,800
2023012603112	B	USDMXN	01/30/2023	1,000,000	18.83	(18,825,070)
2023012603138	B	USDMXN	01/30/2023	10,000,000	18.82	(188,180,000)
2023012603139	S	USDMXN	02/28/2023	(10,000,000)	18.92	189,160,000
2023012603180	S	USDMXN	01/30/2023	(10,000,000)	18.84	188,435,000
2023012603184	BON	USDMXN	03/02/2023	35,000,000	18.95	(663,145,000)
2023012603206	S	USDMXN	01/30/2023	(1,000,000)	18.85	18,850,000
2023012603264	S	USDMXN	01/30/2023	(527,500)	18.85	9,943,375
2023012603265	B	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.95	(9,995,934)
2023012603308	B	USDMXN	01/30/2023	1,000,000	18.82	(18,818,050)
2023012603335	S	USDMXN	01/30/2023	(3,000,000)	18.82	56,467,470
2023012603353	B	USDMXN	01/30/2023	10,000,000	18.82	(188,150,000)
2023012603354	S	USDMXN	03/30/2023	(10,000,000)	19.02	190,200,000
2023012603367	B	USDMXN	01/30/2023	10,000,000	18.81	(188,130,000)
2023012603368	S	USDMXN	02/28/2023	(10,000,000)	18.91	189,112,000
2023012603386	S	USDMXN	01/30/2023	(1,000,000)	18.81	18,807,830
2023012603399	BO	USDMXN	03/01/2023	85,450	18.92	(1,616,297)
2023012603422	SO	USDMXN	02/02/2023	(200,000)	18.81	3,762,923
2023012603463	BO	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.91	(9,975,070)
2023012603517	SO	USDMXN	02/14/2023	(140,994)	18.86	2,659,092
2023012603518	SO	USDMXN	02/23/2023	(110,071)	18.89	2,079,199
2023012603519	SO	USDMXN	03/13/2023	(287,829)	18.95	5,455,252
2023012603520	SO	USDMXN	03/28/2023	(565,538)	19.01	10,748,475
2023012603523	BO	USDMXN	03/01/2023	69,600	18.91	(1,316,361)
2023012603532	B	USDMXN	01/30/2023	1,000,000	18.81	(18,805,390)
2023012603534	B	USDMXN	01/30/2023	2,300,000	18.80	(43,246,900)
2023012603535	S	USDMXN	01/30/2023	(360,358)	18.80	6,774,584
2023012603536	B	USDMXN	03/15/2023	360,358	18.95	(6,829,709)
2023012603537	S	USDMXN	01/30/2023	(381,524)	18.80	7,173,141
2023012603539	S	USDMXN	01/30/2023	(405,497)	18.80	7,623,964
2023012603541	S	USDMXN	01/30/2023	(391,568)	18.80	7,362,718
2023012603544	S	USDMXN	01/30/2023	(434,270)	18.80	8,164,927

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023012603546	S	USDMXN	01/30/2023	(434,650)	18.80	8,172,069
2023012603548	S	USDMXN	01/30/2023	(516,687)	18.80	9,715,186
2023012603550	S	USDMXN	01/30/2023	(432,358)	18.80	8,128,931
2023012603552	S	USDMXN	01/30/2023	(332,504)	18.80	6,251,771
2023012603554	S	USDMXN	01/30/2023	(366,430)	18.80	6,890,169
2023012603556	S	USDMXN	01/30/2023	(574,921)	18.81	10,811,613
2023012603558	S	USDMXN	01/30/2023	(650,785)	18.81	12,238,211
2023012603612	SO	USDMXN	02/02/2023	(200,000)	18.81	3,761,830
2023012603633	BO	USDMXN	02/16/2023	8,780	18.86	(165,548)
2023012603634	BO	USDMXN	02/23/2023	8,780	18.88	(165,753)
2023012603635	BO	USDMXN	02/02/2023	8,781	18.81	(165,139)
2023012603636	BO	USDMXN	03/02/2023	8,781	18.90	(165,989)
2023012603637	SO	USDMXN	02/02/2023	(8,781)	18.80	165,080
2023012703050	B	USDMXN	01/30/2023	100,000,000	18.75	(1,874,500,000)
2023012703051	S	USDMXN	01/31/2023	(100,000,000)	18.75	1,874,780,000
2023012703054	B	USDMXN	01/30/2023	100,000,000	18.75	(1,874,500,000)
2023012703055	S	USDMXN	01/31/2023	(100,000,000)	18.75	1,874,780,000
2023012703060	B	USDMXN	01/31/2023	200,000,000	18.74	(3,748,000,000)
2023012703080	B	USDMXN	01/27/2023	200,000,000	18.74	(3,748,000,000)
2023012703081	S	USDMXN	01/30/2023	(200,000,000)	18.75	3,749,800,000
2023012703098	S	USDMXN	01/27/2023	(200,000,000)	18.74	3,748,000,000
2023012703101	S	USDMXN	01/27/2023	(100,000,000)	18.74	1,874,000,000
2023012703103	S	USDMXN	01/31/2023	(100,000,000)	18.74	1,874,000,000
2023012703110	S	USDMXN	01/27/2023	(100,000,000)	18.74	1,874,000,000
2023012703153	S	USDMXN	01/27/2023	(50,000,000)	18.73	936,400,000
2023012703154	B	USDMXN	01/30/2023	50,000,000	18.74	(936,850,000)
2023012703156	B	USDMXN	01/30/2023	47,000,000	18.78	(882,425,000)
2023012703157	S	USDMXN	01/31/2023	(47,000,000)	18.78	882,554,250
2023012703158	B	USDMXN	01/30/2023	118,490	18.77	(2,224,071)
2023012703159	S	USDMXN	01/31/2023	(118,490)	18.77	2,224,383
2023012703180	B	USDMXN	01/30/2023	45,000,000	18.78	(844,875,000)
2023012703181	S	USDMXN	01/31/2023	(45,000,000)	18.78	844,998,750
2023012703185	B	USDMXN	01/30/2023	2,000,000	18.80	(37,595,112)
2023012703186	S	USDMXN	01/31/2023	(2,000,000)	18.80	37,600,600
2023012703188	B	USDMXN	01/31/2023	3,000,000	18.80	(56,391,000)
2023012703260	S	USDMXN	01/27/2023	(26,595,000)	18.80	499,986,000
2023012703261	B	USDMXN	01/30/2023	26,595,000	18.81	(500,229,344)
2023012703263	S	USDMXN	01/27/2023	(21,293,000)	18.79	399,989,005
2023012703264	B	USDMXN	01/30/2023	21,293,000	18.79	(400,191,289)
2023012703323	S	USDMXN	01/27/2023	(25,112,000)	18.78	471,653,584
2023012703324	B	USDMXN	01/30/2023	25,112,000	18.79	(471,904,704)
2023012703333	SON	USDMXN	01/31/2023	(30,000,000)	19.42	582,495,000
2023012703334	BO	USDMXN	01/31/2023	0	18.79	(18,720,000)
2023012703336	B	USDMXN	01/31/2023	20,000,000	18.79	(375,850,000)
2023012703429	S	USDMXN	01/31/2023	(6,700,000)	18.77	125,752,300
2023012703435	S	USDMXN	01/31/2023	(7,067,323)	18.77	132,645,875
2023012703497	SO	USDMXN	02/14/2023	(220,000)	18.81	4,138,047
2023012703498	BO	USDMXN	03/23/2023	60,000	18.98	(1,138,525)
2023012703500	BO	USDMXN	03/30/2023	60,000	19.00	(1,139,978)
2023012703584	SO	USDMXN	02/17/2023	(200,000)	18.81	3,762,937
2023012703585	BO	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.86	(9,948,898)
2023012703594	SO	USDMXN	02/03/2023	(600,000)	18.78	11,266,076
2023012703613	S	USDMXN	01/31/2023	(3,600,000)	18.77	67,573,080
2023012703614	B	USDMXN	02/24/2023	3,600,000	18.85	(67,862,473)
2023012703617	SO	USDMXN	02/17/2023	(10,000)	18.83	188,253
2023012703709	BO	USDMXN	02/08/2023	97,572	18.80	(1,834,393)
2023012703718	BO	USDMXN	02/24/2023	250,000	18.86	(4,715,534)
2023012703815	BO	USDMXN	02/08/2023	33,540	18.79	(630,059)
2023012703816	BO	USDMXN	02/15/2023	36,936	18.81	(694,751)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023012703820	BO	USDMXN	02/22/2023	18,468	18.83	(347,829)
2023012703821	BO	USDMXN	03/08/2023	86,184	18.88	(1,627,367)
2023012703822	BO	USDMXN	03/15/2023	86,184	18.91	(1,629,544)
2023012703823	BO	USDMXN	03/22/2023	43,092	18.93	(815,832)
2023013003097	SO	USDMXN	02/10/2023	(200,000)	18.82	3,764,235
2023013003127	B	USDMXN	01/30/2023	200,000,000	18.78	(3,756,000,000)
2023013003152	S	USDMXN	01/30/2023	(100,000,000)	18.80	1,880,000,000
2023013003153	S	USDMXN	01/30/2023	(100,000,000)	18.80	1,880,000,000
2023013003221	S	USDMXN	01/30/2023	(35,000,000)	18.78	657,300,000
2023013003222	B	USDMXN	01/31/2023	35,000,000	18.78	(657,405,000)
2023013003223	S	USDMXN	01/31/2023	(30,000,000)	18.78	563,340,000
2023013003224	B	USDMXN	02/01/2023	30,000,000	18.78	(563,427,000)
2023013003226	B	USDMXN	02/01/2023	10,000,000	18.77	(187,725,000)
2023013003252	S	USDMXN	01/31/2023	(2,881,510)	18.77	54,086,014
2023013003253	B	USDMXN	02/01/2023	2,881,510	18.77	(54,094,869)
2023013003263	B	USDMXN	02/01/2023	10,000,000	18.77	(187,700,000)
2023013003304	S	USDMXN	02/01/2023	(20,000,000)	18.79	375,712,000
2023013003305	B	USDMXN	02/13/2023	20,000,000	18.82	(376,499,600)
2023013003316	S	USDMXN	02/01/2023	(4,500,000)	18.78	84,519,000
2023013003317	B	USDMXN	03/24/2023	4,500,000	18.96	(85,302,923)
2023013003357	B	USDMXN	02/01/2023	10,000,000	18.78	(187,790,000)
2023013003401	S	USDMXN	02/01/2023	(3,300,000)	18.78	61,978,950
2023013003408	S	USDMXN	02/01/2023	(3,300,000)	18.78	61,977,630
2023013003411	S	USDMXN	02/01/2023	(3,500,000)	18.78	65,720,900
2023013003413	S	USDMXN	02/01/2023	(4,400,000)	18.78	82,622,232
2023013003416	S	USDMXN	02/01/2023	(4,520,000)	18.78	84,876,244
2023013003477	BO	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.87	(9,952,415)
2023013003495	BO	USDMXN	03/01/2023	25,700	18.87	(485,021)
2023013003517	S	USDMXN	02/01/2023	(527,500)	18.77	9,903,259
2023013003518	B	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.87	(9,951,367)
2023013003634	S	USDMXN	02/01/2023	(114,400)	18.76	2,145,931
2023013003635	B	USDMXN	03/08/2023	114,400	18.88	(2,159,559)
2023013003638	S	USDMXN	02/01/2023	(63,600)	18.76	1,193,034
2023013003639	B	USDMXN	03/15/2023	63,600	18.90	(1,202,170)
2023013003640	S	USDMXN	02/01/2023	(36,000)	18.76	675,302
2023013003641	B	USDMXN	03/22/2023	36,000	18.93	(681,347)
2023013003825	BO	USDMXN	02/08/2023	66,192	18.80	(1,244,283)
2023013103039	B	USDMXN	02/02/2023	1,000,000	18.75	(18,750,970)
2023013103040	S	USDMXN	02/02/2023	(1,000,000)	18.75	18,748,180
2023013103041	S	USDMXN	02/01/2023	(36,000,000)	18.77	675,720,000
2023013103042	B	USDMXN	02/02/2023	36,000,000	18.77	(675,831,600)
2023013103059	S	USDMXN	02/01/2023	(881,510)	18.75	16,529,660
2023013103060	B	USDMXN	02/02/2023	881,510	18.75	(16,532,626)
2023013103062	S	USDMXN	01/31/2023	(42,700,000)	18.74	799,984,500
2023013103063	B	USDMXN	02/01/2023	42,700,000	18.74	(800,121,140)
2023013103064	S	USDMXN	01/31/2023	(30,000,000)	18.80	564,000,000
2023013103065	B	USDMXN	02/01/2023	30,000,000	18.80	(564,093,000)
2023013103066	S	USDMXN	02/02/2023	(1,000,000)	18.76	18,760,000
2023013103067	S	USDMXN	02/01/2023	(120,000,000)	18.80	2,255,640,000
2023013103068	B	USDMXN	02/02/2023	120,000,000	18.80	(2,256,012,000)
2023013103074	B	USDMXN	02/02/2023	1,000,000	18.75	(18,750,000)
2023013103075	B	USDMXN	02/02/2023	1,000,000	18.75	(18,750,000)
2023013103077	B	USDMXN	02/02/2023	1,000,000	18.75	(18,749,900)
2023013103078	B	USDMXN	02/02/2023	1,000,000	18.75	(18,750,960)
2023013103088	B	USDMXN	02/02/2023	1,000,000	18.75	(18,745,000)
2023013103108	B	USDMXN	02/02/2023	2,000,000	18.77	(37,535,040)
2023013103120	S	USDMXN	02/01/2023	(65,000,000)	18.77	1,219,855,000
2023013103121	B	USDMXN	02/02/2023	65,000,000	18.77	(1,220,056,500)
2023013103172	B	USDMXN	02/02/2023	1,000,000	18.77	(18,772,540)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023013103175	B	USDMXN	02/02/2023	1,000,000	18.77	(18,773,700)
2023013103182	S	USDMXN	02/02/2023	(5,000,000)	18.76	93,822,000
2023013103183	B	USDMXN	02/13/2023	5,000,000	18.80	(94,003,485)
2023013103275	S	USDMXN	01/31/2023	(115,000,000)	18.81	2,163,150,000
2023013103276	B	USDMXN	02/01/2023	115,000,000	18.81	(2,163,552,500)
2023013103341	S	USDMXN	02/02/2023	(5,000,000)	18.81	94,036,050
2023013103342	B	USDMXN	02/13/2023	5,000,000	18.84	(94,222,265)
2023013103353	S	USDMXN	02/01/2023	(6,000,000)	18.80	112,800,000
2023013103354	B	USDMXN	02/02/2023	6,000,000	18.80	(112,819,080)
2023013103362	BO	USDMXN	03/29/2023	100,000	18.92	(1,891,504)
2023013103365	BO	USDMXN	02/16/2023	13,140	18.80	(247,062)
2023013103366	BO	USDMXN	02/23/2023	13,140	18.83	(247,376)
2023013103367	BO	USDMXN	03/02/2023	13,140	18.85	(247,686)
2023013103368	BO	USDMXN	03/09/2023	13,140	18.87	(248,006)
2023013103370	B	USDMXN	01/31/2023	150,000,000	18.80	(2,820,000,000)
2023013103371	S	USDMXN	02/02/2023	(150,000,000)	18.81	2,821,020,000
2023013103512	S	USDMXN	02/02/2023	(30,000,000)	18.82	564,450,000
2023013103597	S	USDMXN	02/02/2023	(527,500)	18.82	9,928,536
2023013103598	B	USDMXN	02/28/2023	527,500	18.91	(9,974,986)
2023013103607	S	USDMXN	02/01/2023	(35,000,000)	18.82	658,776,300
2023013103772	S	USDMXN	02/14/2023	(3,609,868)	18.87	68,117,224
2023013103775	B	USDMXN	02/02/2023	6,390,132	18.84	(120,385,039)
2023013103776	S	USDMXN	02/14/2023	(6,390,132)	18.88	120,624,892
2023013103792	S	USDMXN	02/02/2023	(5,000,000)	18.84	94,183,500
2023013103795	B	USDMXN	02/02/2023	1,000,000	18.84	(18,837,000)
2023013103796	B	USDMXN	02/02/2023	2,000,000	18.84	(37,674,000)
2023013103800	B	USDMXN	02/02/2023	2,000,000	18.84	(37,674,000)
2023013103802	BO	USDMXN	02/08/2023	35,260	18.86	(664,970)
2023013103804	BO	USDMXN	02/15/2023	57,600	18.88	(1,087,697)
2023020103101	B	USDMXN	02/02/2023	118,490	18.76	(2,222,318)
2023020103102	S	USDMXN	02/03/2023	(118,490)	18.76	2,222,602
2023020103106	S	USDMXN	02/02/2023	(150,000,000)	18.74	2,811,000,000
2023020103107	B	USDMXN	02/03/2023	150,000,000	18.74	(2,811,465,000)
2023020103111	S	USDMXN	02/02/2023	(150,000,000)	18.74	2,811,000,000
2023020103112	B	USDMXN	02/03/2023	150,000,000	18.74	(2,811,465,000)
2023020103119	B	USDMXN	02/02/2023	150,000,000	18.74	(2,811,000,000)
2023020103120	S	USDMXN	02/03/2023	(150,000,000)	18.74	2,811,495,000
2023020103168	B	USDMXN	02/03/2023	50,000,000	18.75	(937,350,000)
2023020103186	S	USDMXN	02/03/2023	(25,000,000)	18.75	468,831,250
2023020103218	S	USDMXN	02/03/2023	(2,800,000)	18.72	52,421,460
2023020103222	S	USDMXN	02/03/2023	(2,800,000)	18.72	52,421,488
2023020103224	S	USDMXN	02/03/2023	(2,400,000)	18.72	44,933,088
2023020103227	S	USDMXN	02/03/2023	(2,400,000)	18.72	44,935,080
2023020103233	S	USDMXN	02/03/2023	(1,800,000)	18.72	33,693,300
2023020103235	S	USDMXN	02/03/2023	(1,800,000)	18.72	33,693,516
2023020103379	BO	USDMXN	02/15/2023	99,600	18.75	(1,867,844)
2023020103380	BO	USDMXN	02/22/2023	32,400	18.78	(608,385)
2023020103397	BO	USDMXN	02/22/2023	800	18.79	(15,032)
2023020103506	SO	USDMXN	02/21/2023	(322,000)	18.80	6,052,577
2023020103507	S	USDMXN	02/03/2023	(322,000)	18.74	6,034,222
2023020103571	BO	USDMXN	02/17/2023	68,708	18.71	(1,285,724)
2023020103578	B	USDMXN	02/03/2023	20,000,000	18.66	(373,200,000)
2023020103579	S	USDMXN	03/03/2023	(20,000,000)	18.75	375,050,000
2023020103581	BO	USDMXN	02/21/2023	70,745	18.73	(1,324,807)
2023020103600	BO	USDMXN	02/24/2023	35,386	18.74	(663,221)
2023020103621	S	USDMXN	02/03/2023	(1,000,000)	18.66	18,660,100
2023020103622	B	USDMXN	03/03/2023	1,000,000	18.75	(18,754,800)
2023020103645	S	USDMXN	02/03/2023	(53,790)	18.62	1,001,555
2023020103646	B	USDMXN	03/15/2023	53,790	18.76	(1,008,870)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023020103647	S	USDMXN	02/03/2023	(57,451)	18.62	1,069,722
2023020103649	S	USDMXN	02/03/2023	(52,298)	18.62	973,714
2023020103651	S	USDMXN	02/03/2023	(51,791)	18.62	964,295
2023020103653	S	USDMXN	02/03/2023	(53,226)	18.62	991,269
2023020103655	S	USDMXN	02/03/2023	(59,370)	18.62	1,105,426
2023020103657	S	USDMXN	02/03/2023	(52,887)	18.62	984,743
2023020103659	S	USDMXN	02/03/2023	(46,940)	18.62	874,024
2023020103661	S	USDMXN	02/03/2023	(41,501)	18.62	772,688
2023020103663	S	USDMXN	02/03/2023	(43,157)	18.61	803,345
2023020103665	S	USDMXN	02/03/2023	(80,076)	18.62	1,490,621
2023020103667	S	USDMXN	02/03/2023	(18,997)	18.61	353,620
2023020103685	B	USDMXN	02/03/2023	20,000,000	18.67	(373,300,000)
2023020103686	S	USDMXN	03/03/2023	(20,000,000)	18.76	375,150,000
2023020103689	S	USDMXN	02/03/2023	(118,000)	18.61	2,195,770
2023020103690	B	USDMXN	03/01/2023	118,000	18.70	(2,206,169)
2023020203023	S	USDMXN	02/03/2023	(150,000,000)	18.54	2,780,250,000
2023020203024	B	USDMXN	02/07/2023	150,000,000	18.55	(2,782,027,500)
2023020203032	S	USDMXN	02/02/2023	(100,000,000)	18.51	1,851,000,000
2023020203033	B	USDMXN	02/03/2023	100,000,000	18.51	(1,851,305,000)
2023020203048	S	USDMXN	02/02/2023	(50,000,000)	18.55	927,368,000
2023020203049	B	USDMXN	02/03/2023	50,000,000	18.55	(927,523,000)
2023020203065	B	USDMXN	02/07/2023	30,000,000	18.58	(557,250,000)
2023020203066	S	USDMXN	03/07/2023	(30,000,000)	18.67	559,989,000
2023020203068	S	USDMXN	02/03/2023	(2,881,510)	18.59	53,567,870
2023020203069	B	USDMXN	02/07/2023	2,881,510	18.60	(53,604,465)
2023020203184	BON	USDMXN	03/07/2023	30,000,000	18.68	(560,511,000)
2023020203190	SON	USDMXN	02/07/2023	(30,000,000)	19.54	586,236,000
2023020203191	BO	USDMXN	02/07/2023	0	18.59	(28,416,000)
2023020203199	S	USDMXN	02/02/2023	(50,000,000)	18.58	929,000,000
2023020203200	B	USDMXN	02/03/2023	50,000,000	18.58	(929,167,500)
2023020203208	BO	USDMXN	03/01/2023	250,000	18.66	(4,665,781)
2023020203228	B	USDMXN	02/02/2023	100,000,000	18.58	(1,858,000,000)
2023020203229	S	USDMXN	02/03/2023	(100,000,000)	18.58	1,858,320,000
2023020203230	B	USDMXN	02/02/2023	100,000,000	18.58	(1,858,000,000)
2023020203231	S	USDMXN	02/03/2023	(100,000,000)	18.58	1,858,320,000
2023020203232	B	USDMXN	02/03/2023	150,000,000	18.58	(2,787,000,000)
2023020203233	S	USDMXN	02/07/2023	(150,000,000)	18.59	2,788,920,000
2023020203296	B	USDMXN	02/07/2023	1,000,000	18.62	(18,621,030)
2023020203297	S	USDMXN	02/21/2023	(1,000,000)	18.67	18,665,480
2023020203315	BO	USDMXN	03/01/2023	681,000	18.66	(12,704,614)
2023020203326	S	USDMXN	02/02/2023	(5,000,000)	18.60	93,015,000
2023020203437	BO	USDMXN	03/24/2023	2,974,000	18.83	(55,986,005)
2023020203443	B	USDMXN	02/07/2023	1,000,000	18.67	(18,673,490)
2023020203451	B	USDMXN	02/07/2023	1,700,000	18.68	(31,759,213)
2023020203487	S	USDMXN	02/07/2023	(300,000)	18.68	5,602,584
2023020203488	B	USDMXN	03/03/2023	300,000	18.76	(5,626,653)
2023020203489	S	USDMXN	02/07/2023	(300,000)	18.67	5,602,344
2023020203490	B	USDMXN	03/17/2023	300,000	18.80	(5,640,759)
2023020203492	S	USDMXN	02/07/2023	(300,000)	18.67	5,602,077
2023020203493	B	USDMXN	03/31/2023	300,000	18.85	(5,654,885)
2023020203494	S	USDMXN	02/07/2023	(300,000)	18.67	5,602,263
2023020203498	S	USDMXN	02/07/2023	(300,000)	18.67	5,602,332
2023020203502	S	USDMXN	02/07/2023	(300,000)	18.67	5,602,332
2023020203505	S	USDMXN	02/07/2023	(300,000)	18.67	5,602,473
2023020203507	S	USDMXN	02/07/2023	(300,000)	18.67	5,602,473
2023020203509	S	USDMXN	02/07/2023	(300,000)	18.67	5,602,479
2023020203524	S	USDMXN	02/07/2023	(13,018,527)	18.67	243,109,405
2023020203525	B	USDMXN	03/17/2023	13,018,527	18.80	(244,776,428)
2023020203542	S	USDMXN	02/23/2023	(131,021)	18.75	2,456,431

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023020203543	B	USDMXN	03/23/2023	131,021	18.84	(2,469,073)
2023020203545	S	USDMXN	02/23/2023	(131,000)	18.75	2,456,106
2023020203546	B	USDMXN	03/13/2023	131,000	18.81	(2,464,192)
2023020203555	BO	USDMXN	03/08/2023	76,000	18.79	(1,428,330)
2023020203559	BO	USDMXN	03/13/2023	59,869	18.81	(1,126,095)
2023020203560	S	MXNUSD	02/07/2023	(3,542,032)	18.70	189,459
2023020203561	B	MXNUSD	02/14/2023	3,542,032	18.72	(189,243)
2023020203562	B	USDMXN	02/07/2023	3,352,789	18.70	(62,681,700)
2023020203563	S	USDMXN	02/14/2023	(3,352,789)	18.72	62,753,449
2023020203585	BO	USDMXN	03/24/2023	500	18.85	(9,426)
2023020203589	BO	USDMXN	03/24/2023	250,000	18.77	(4,692,808)
2023020203590	BO	USDMXN	03/10/2023	250,000	18.72	(4,680,739)
2023020303009	S	USDMXN	02/03/2023	(74,000,000)	18.79	1,390,164,000
2023020303010	B	USDMXN	02/07/2023	74,000,000	18.80	(1,391,044,600)
2023020303011	SO	USDMXN	02/17/2023	(300,000)	18.83	5,649,530
2023020303045	S	USDMXN	02/03/2023	(100,000,000)	18.86	1,886,000,000
2023020303046	B	USDMXN	02/07/2023	100,000,000	18.87	(1,887,223,000)
2023020303048	S	USDMXN	02/07/2023	(110,000,000)	18.88	2,076,800,000
2023020303049	B	USDMXN	02/08/2023	110,000,000	18.88	(2,077,124,500)
2023020303057	S	USDMXN	02/03/2023	(50,000,000)	18.87	943,500,000
2023020303058	B	USDMXN	02/07/2023	50,000,000	18.88	(944,100,000)
2023020303140	S	USDMXN	02/03/2023	(50,000,000)	18.90	945,000,000
2023020303141	B	USDMXN	02/07/2023	50,000,000	18.91	(945,610,000)
2023020303169	B	USDMXN	02/03/2023	100,000,000	18.85	(1,885,000,000)
2023020303170	S	USDMXN	02/07/2023	(100,000,000)	18.86	1,886,280,000
2023020303171	B	USDMXN	02/03/2023	100,000,000	18.85	(1,885,000,000)
2023020303172	S	USDMXN	02/07/2023	(100,000,000)	18.86	1,886,280,000
2023020303173	B	USDMXN	02/07/2023	150,000,000	18.85	(2,827,500,000)
2023020303174	S	USDMXN	02/08/2023	(150,000,000)	18.85	2,827,980,000
2023020303204	B	USDMXN	02/07/2023	578,035	18.86	(10,904,395)
2023020303205	S	USDMXN	02/08/2023	(578,035)	18.87	10,905,840
2023020303235	SON	USDMXN	02/08/2023	(40,000,000)	19.48	779,232,000
2023020303236	BO	USDMXN	02/08/2023	0	18.87	(24,632,000)
2023020303240	B	USDMXN	02/08/2023	40,000,000	18.87	(754,600,000)
2023020303302	S	USDMXN	02/08/2023	(681,000)	18.87	12,849,394
2023020303303	B	USDMXN	03/01/2023	681,000	18.94	(12,897,745)
2023020303661	BO	USDMXN	03/08/2023	107,000	19.08	(2,041,452)
2023020303748	BO	USDMXN	02/15/2023	33,824	19.00	(642,619)
2023020703006	SO	USDMXN	02/17/2023	(200,000)	19.09	3,817,516
2023020703009	S	USDMXN	02/08/2023	(52,438,385)	19.07	1,000,000,000
2023020703010	B	USDMXN	02/09/2023	52,429,862	19.07	(1,000,000,000)
2023020703030	SO	USDMXN	02/21/2023	(200,000)	19.11	3,821,916
2023020703040	S	USDMXN	02/08/2023	(100,000,000)	19.08	1,908,300,000
2023020703041	B	USDMXN	02/09/2023	100,000,000	19.09	(1,908,610,000)
2023020703078	S	USDMXN	02/07/2023	(52,443,885)	19.07	1,000,000,000
2023020703079	B	USDMXN	02/08/2023	52,435,223	19.07	(1,000,000,000)
2023020703082	S	USDMXN	02/07/2023	(104,887,770)	19.07	2,000,000,000
2023020703083	B	USDMXN	02/08/2023	104,870,446	19.07	(2,000,000,000)
2023020703091	S	USDMXN	02/07/2023	(36,706,869)	19.07	700,000,000
2023020703092	B	USDMXN	02/08/2023	36,700,807	19.07	(700,000,000)
2023020703100	B	USDMXN	02/08/2023	150,000,000	19.07	(2,860,500,000)
2023020703101	S	USDMXN	02/09/2023	(150,000,000)	19.07	2,860,995,000
2023020703102	B	USDMXN	02/07/2023	100,000,000	19.07	(1,907,000,000)
2023020703103	S	USDMXN	02/08/2023	(100,000,000)	19.07	1,907,330,000
2023020703104	B	USDMXN	02/07/2023	100,000,000	19.07	(1,907,000,000)
2023020703105	S	USDMXN	02/08/2023	(100,000,000)	19.07	1,907,330,000
2023020703106	B	USDMXN	02/08/2023	2,578,035	19.08	(49,182,490)
2023020703107	S	USDMXN	02/09/2023	(2,578,035)	19.08	49,189,967
2023020703118	S	USDMXN	02/07/2023	(6,000,000)	19.10	114,600,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023020703119	B	USDMXN	02/08/2023	6,000,000	19.10	(114,620,100)
2023020703199	S	USDMXN	02/09/2023	(35,000,000)	19.06	667,222,500
2023020703221	BO	USDMXN	02/17/2023	44,000	19.12	(841,344)
2023020703232	B	USDMXN	02/09/2023	30,000,000	19.05	(571,350,000)
2023020703314	BO	EURMXN	02/24/2023	141,285	20.41	(2,884,203)
2023020703321	S	USDMXN	02/09/2023	(1,000,000)	18.94	18,939,840
2023020703323	S	USDMXN	02/09/2023	(1,000,000)	18.94	18,941,390
2023020703324	S	USDMXN	02/09/2023	(1,000,000)	18.94	18,943,990
2023020703325	S	USDMXN	02/09/2023	(1,000,000)	18.95	18,947,620
2023020703328	BO	USDMXN	03/29/2023	600,000	19.12	(11,470,498)
2023020703363	SO	USDMXN	02/15/2023	(490,000)	18.95	9,284,149
2023020703367	SO	USDMXN	02/27/2023	(160,000)	18.97	3,035,709
2023020703388	S	USDMXN	02/09/2023	(3,300,000)	18.94	62,504,409
2023020703389	B	USDMXN	02/21/2023	3,300,000	18.98	(62,637,284)
2023020703391	BO	USDMXN	02/15/2023	154	18.96	(2,924)
2023020703393	B	USDMXN	02/09/2023	9,000,000	18.95	(170,562,330)
2023020703394	S	USDMXN	02/24/2023	(9,000,000)	19.00	171,003,843
2023020703395	S	USDMXN	02/24/2023	(1,000,000)	19.00	19,003,823
2023020703396	B	USDMXN	03/29/2023	1,000,000	19.12	(19,123,247)
2023020703397	BO	USDMXN	03/29/2023	1,458	19.12	(27,884)
2023020703398	SO	USDMXN	02/27/2023	(3,000)	19.01	57,034
2023020703400	S	MXNUSD	02/09/2023	(125,000)	18.98	6,587
2023020703401	B	MXNUSD	03/03/2023	125,000	19.05	(6,562)
2023020703402	B	USDMXN	02/09/2023	118,439	18.98	(2,247,608)
2023020703403	S	USDMXN	03/03/2023	(118,439)	19.05	2,256,335
2023020703408	SO	USDMXN	02/15/2023	(293,339)	18.98	5,566,193
2023020703524	BO	USDMXN	03/14/2023	24,600	19.00	(467,349)
2023020703541	BO	USDMXN	02/15/2023	168,936	18.91	(3,193,879)
2023020703542	BO	USDMXN	02/22/2023	65,344	18.93	(1,236,934)
2023020803095	S	USDMXN	02/09/2023	(42,000,000)	18.92	794,430,000
2023020803096	B	USDMXN	02/10/2023	42,000,000	18.92	(794,565,450)
2023020803119	S	USDMXN	02/08/2023	(300,000,000)	18.92	5,674,500,000
2023020803120	B	USDMXN	02/09/2023	300,000,000	18.92	(5,675,460,000)
2023020803121	S	USDMXN	02/09/2023	(380,000,000)	18.94	7,195,680,000
2023020803122	B	USDMXN	02/10/2023	380,000,000	18.94	(7,196,915,000)
2023020803124	B	USDMXN	02/08/2023	150,000,000	18.90	(2,835,000,000)
2023020803125	S	USDMXN	02/10/2023	(150,000,000)	18.91	2,836,020,000
2023020803126	B	USDMXN	02/08/2023	150,000,000	18.90	(2,835,000,000)
2023020803127	S	USDMXN	02/10/2023	(150,000,000)	18.91	2,836,020,000
2023020803128	B	USDMXN	02/09/2023	150,000,000	18.90	(2,835,000,000)
2023020803129	S	USDMXN	02/10/2023	(150,000,000)	18.90	2,835,510,000
2023020803130	S	USDMXN	02/09/2023	(421,965)	18.94	7,992,382
2023020803131	B	USDMXN	02/10/2023	421,965	18.94	(7,993,817)
2023020803190	BO	USDMXN	03/01/2023	681,000	19.00	(12,941,435)
2023020803204	BO	USDMXN	02/15/2023	440,000	18.96	(8,342,006)
2023020803207	BO	USDMXN	03/15/2023	1,500,000	19.06	(28,584,588)
2023020803214	S	USDMXN	02/09/2023	(50,000,000)	18.92	945,750,000
2023020803215	B	USDMXN	02/10/2023	50,000,000	18.92	(945,911,250)
2023020803299	B	USDMXN	02/09/2023	150,000,000	18.90	(2,835,000,000)
2023020803300	S	USDMXN	02/10/2023	(150,000,000)	18.90	2,835,510,000
2023020803306	BO	USDMXN	03/15/2023	68,094	19.07	(1,298,390)
2023020803359	BO	USDMXN	02/17/2023	443,002	18.98	(8,406,319)
2023020803360	BO	USDMXN	02/22/2023	136,998	18.99	(2,602,020)
2023020803361	BO	USDMXN	02/15/2023	550	18.97	(10,433)
2023020803362	BO	USDMXN	02/22/2023	6,773	18.99	(128,646)
2023020803405	SO	USDMXN	02/27/2023	(229,000)	19.00	4,350,251
2023020803473	BO	USDMXN	02/16/2023	232,000	18.96	(4,399,360)
2023020803551	BO	USDMXN	03/08/2023	61,600	19.03	(1,172,103)
2023020803552	BO	USDMXN	03/22/2023	61,200	19.08	(1,167,599)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023020803559	SO	USDMXN	02/15/2023	(25,000)	18.95	473,756
2023020803560	BO	USDMXN	03/14/2023	70,650	19.05	(1,345,844)
2023020803561	BO	USDMXN	03/07/2023	32,900	19.02	(625,890)
2023020803562	SO	USDMXN	02/16/2023	(222,000)	18.96	4,208,365
2023020903003	B	USDMXN	02/10/2023	150,000,000	18.90	(2,835,000,000)
2023020903004	S	USDMXN	02/13/2023	(150,000,000)	18.91	2,836,492,500
2023020903005	B	USDMXN	02/10/2023	150,000,000	18.90	(2,835,000,000)
2023020903006	S	USDMXN	02/13/2023	(150,000,000)	18.91	2,836,492,500
2023020903007	B	USDMXN	02/10/2023	150,000,000	18.90	(2,835,000,000)
2023020903008	S	USDMXN	02/13/2023	(150,000,000)	18.91	2,836,492,500
2023020903009	S	USDMXN	02/10/2023	(200,000,000)	18.89	3,778,000,000
2023020903010	B	USDMXN	02/13/2023	200,000,000	18.90	(3,779,960,000)
2023020903013	S	USDMXN	02/10/2023	(250,000,000)	18.89	4,722,500,000
2023020903014	B	USDMXN	02/13/2023	250,000,000	18.90	(4,724,950,000)
2023020903015	S	USDMXN	02/10/2023	(421,965)	18.86	7,958,874
2023020903016	B	USDMXN	02/13/2023	421,965	18.87	(7,963,263)
2023020903019	S	USDMXN	02/10/2023	(22,000,000)	18.87	415,030,000
2023020903020	B	USDMXN	02/13/2023	22,000,000	18.87	(415,245,600)
2023020903021	S	USDMXN	02/10/2023	(200,000,000)	18.88	3,776,400,000
2023020903022	B	USDMXN	02/13/2023	200,000,000	18.89	(3,778,360,000)
2023020903024	S	USDMXN	02/13/2023	(20,000,000)	18.87	377,300,000
2023020903025	B	USDMXN	03/13/2023	20,000,000	18.96	(379,224,000)
2023020903239	SO	USDMXN	02/16/2023	(200,000)	18.99	3,798,928
2023020903328	B	USDMXN	02/13/2023	1,000,000	18.96	(18,956,320)
2023020903345	S	USDMXN	02/13/2023	(1,000,000)	18.94	18,938,540
2023020903395	BO	USDMXN	02/23/2023	200,000	18.93	(3,785,219)
2023020903396	BO	USDMXN	02/16/2023	200,000	18.90	(3,780,464)
2023020903428	SO	USDMXN	02/27/2023	(221,000)	19.00	4,198,807
2023020903447	S	USDMXN	02/13/2023	(681,000)	18.95	12,907,524
2023020903448	B	USDMXN	03/01/2023	681,000	19.01	(12,944,919)
2023020903517	B	USDMXN	02/13/2023	20,000,000	18.77	(375,300,000)
2023020903518	S	USDMXN	03/13/2023	(20,000,000)	18.86	377,264,000
2023020903536	B	USDMXN	02/13/2023	20,000,000	18.78	(375,500,000)
2023020903559	B	USDMXN	02/13/2023	20,000,000	18.76	(375,200,000)
2023020903560	S	USDMXN	03/13/2023	(20,000,000)	18.86	377,164,000
2023020903590	S	USDMXN	02/13/2023	(10,000,000)	18.77	187,680,000
2023020903595	BO	USDMXN	02/21/2023	500,000	18.80	(9,400,020)
2023020903597	BO	USDMXN	03/14/2023	53,050	18.88	(1,001,373)
2023021003067	B	USDMXN	02/13/2023	2,578,035	18.73	(48,298,688)
2023021003068	S	USDMXN	02/14/2023	(2,578,035)	18.74	48,306,938
2023021003069	S	USDMXN	02/13/2023	(200,000,000)	18.73	3,745,000,000
2023021003070	B	USDMXN	02/14/2023	200,000,000	18.73	(3,745,680,000)
2023021003074	B	USDMXN	02/14/2023	1,000,000	18.72	(18,723,370)
2023021003079	B	USDMXN	02/14/2023	1,000,000	18.70	(18,699,600)
2023021003090	S	USDMXN	03/28/2023	(572,730)	18.84	10,789,755
2023021003093	S	USDMXN	02/14/2023	(482,639)	18.68	9,016,901
2023021003096	S	USDMXN	02/14/2023	(1,000,000)	18.67	18,668,010
2023021003223	S	USDMXN	02/13/2023	(100,000,000)	18.68	1,868,000,000
2023021003224	B	USDMXN	02/14/2023	100,000,000	18.68	(1,868,340,000)
2023021003226	S	USDMXN	02/13/2023	(50,000,000)	18.73	936,500,000
2023021003227	B	USDMXN	02/14/2023	50,000,000	18.73	(936,670,000)
2023021003230	S	USDMXN	02/13/2023	(100,000,000)	18.69	1,868,500,000
2023021003231	B	USDMXN	02/14/2023	100,000,000	18.69	(1,868,840,000)
2023021003234	B	USDMXN	02/13/2023	150,000,000	18.70	(2,805,000,000)
2023021003235	S	USDMXN	02/14/2023	(150,000,000)	18.70	2,805,532,500
2023021003236	B	USDMXN	02/13/2023	150,000,000	18.70	(2,805,000,000)
2023021003237	S	USDMXN	02/14/2023	(150,000,000)	18.70	2,805,532,500
2023021003239	B	USDMXN	02/13/2023	150,000,000	18.70	(2,805,000,000)
2023021003240	S	USDMXN	02/14/2023	(150,000,000)	18.70	2,805,532,500

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023021003309	BO	USDMXN	03/15/2023	18,468	18.85	(348,047)
2023021003310	BO	USDMXN	03/08/2023	36,936	18.82	(695,083)
2023021003324	BO	USDMXN	03/01/2023	681,000	18.77	(12,784,270)
2023021003475	BO	USDMXN	03/24/2023	250,000	18.82	(4,704,612)
2023021003553	SO	USDMXN	03/03/2023	(318,000)	18.75	5,963,853
2023021003554	BO	USDMXN	03/01/2023	681,000	18.75	(12,767,134)
2023021003556	S	USDMXN	02/14/2023	(30,000,000)	18.69	560,550,000
2023021003557	B	USDMXN	03/14/2023	30,000,000	18.78	(563,520,000)
2023021003561	B	USDMXN	02/14/2023	30,000,000	18.69	(560,550,000)
2023021003562	S	USDMXN	03/14/2023	(30,000,000)	18.78	563,520,000
2023021003652	BO	USDMXN	03/23/2023	60,000	18.83	(1,129,594)
2023021003653	BO	USDMXN	03/30/2023	60,000	18.85	(1,131,154)
2023021003709	S	USDMXN	02/14/2023	(204,089)	18.66	3,808,540
2023021003828	B	USDMXN	02/14/2023	734,875	18.66	(13,713,209)
2023021003829	S	USDMXN	02/21/2023	(734,875)	18.68	13,729,450
2023021003830	B	USDMXN	02/14/2023	169,212	18.66	(3,157,327)
2023021303052	S	USDMXN	02/14/2023	(103,965,702)	18.66	1,940,000,000
2023021303053	B	USDMXN	02/15/2023	103,946,623	18.66	(1,940,000,000)
2023021303058	S	USDMXN	02/14/2023	(45,000,000)	18.68	840,375,000
2023021303059	B	USDMXN	02/15/2023	45,000,000	18.68	(840,530,250)
2023021303072	S	USDMXN	02/14/2023	(421,965)	18.67	7,878,325
2023021303073	B	USDMXN	02/15/2023	421,965	18.67	(7,879,865)
2023021303086	S	USDMXN	02/14/2023	(47,000,000)	18.67	877,490,000
2023021303087	B	USDMXN	02/15/2023	47,000,000	18.67	(877,652,150)
2023021303132	B	USDMXN	02/15/2023	407,000	18.65	(7,589,162)
2023021303172	S	USDMXN	02/15/2023	(40,000,000)	18.62	744,880,000
2023021303173	B	USDMXN	03/08/2023	40,000,000	18.70	(747,840,000)
2023021303182	S	USDMXN	02/15/2023	(20,000,000)	18.62	372,440,000
2023021303183	B	USDMXN	03/08/2023	20,000,000	18.70	(373,920,000)
2023021303184	S	USDMXN	02/15/2023	(20,000,000)	18.62	372,440,000
2023021303185	B	USDMXN	03/08/2023	20,000,000	18.70	(373,920,000)
2023021303203	S	USDMXN	02/15/2023	(411,191)	18.63	7,661,056
2023021303206	BO	USDMXN	03/02/2023	150,000	18.67	(2,800,525)
2023021303207	BO	USDMXN	03/09/2023	150,000	18.70	(2,804,272)
2023021303208	BO	USDMXN	03/23/2023	150,000	18.75	(2,812,089)
2023021303209	BO	USDMXN	03/30/2023	150,000	18.77	(2,815,961)
2023021303225	B	USDMXN	02/14/2023	150,000,000	18.65	(2,797,500,000)
2023021303226	S	USDMXN	02/15/2023	(150,000,000)	18.65	2,798,040,000
2023021303227	B	USDMXN	02/14/2023	150,000,000	18.65	(2,797,500,000)
2023021303228	S	USDMXN	02/15/2023	(150,000,000)	18.65	2,798,040,000
2023021303229	B	USDMXN	02/14/2023	150,000,000	18.65	(2,797,500,000)
2023021303230	S	USDMXN	02/15/2023	(150,000,000)	18.65	2,798,040,000
2023021303240	S	USDMXN	02/14/2023	(300,000,000)	18.63	5,590,200,000
2023021303241	B	USDMXN	02/15/2023	300,000,000	18.64	(5,591,250,000)
2023021303354	SON	USDMXN	02/15/2023	(30,000,000)	19.68	590,529,000
2023021303355	BO	USDMXN	02/15/2023	0	18.63	(31,621,500)
2023021303391	S	USDMXN	02/13/2023	(10,740,000)	18.62	199,978,800
2023021303392	B	USDMXN	02/14/2023	10,740,000	18.62	(200,015,316)
2023021303394	S	USDMXN	02/13/2023	(19,260,000)	18.64	359,006,400
2023021303395	B	USDMXN	02/14/2023	19,260,000	18.64	(359,071,884)
2023021303492	BO	USDMXN	03/01/2023	681,000	18.66	(12,710,015)
2023021303504	BO	USDMXN	03/01/2023	681,000	18.72	(12,746,988)
2023021303560	SO	USDMXN	02/22/2023	(1,000,000)	18.62	18,623,485
2023021303565	B	USDMXN	02/15/2023	307,536	18.60	(5,720,222)
2023021303566	S	USDMXN	02/22/2023	(307,536)	18.62	5,727,434
2023021303617	BO	USDMXN	03/22/2023	58,650	18.74	(1,099,022)
2023021303618	BO	USDMXN	03/15/2023	39,200	18.71	(733,536)
2023021303652	BO	USDMXN	02/22/2023	131,368	18.62	(2,445,668)
2023021303657	BO	USDMXN	03/02/2023	98,136	18.65	(1,829,797)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023021303658	BO	USDMXN	03/15/2023	10,496	18.69	(196,207)
2023021303659	BO	USDMXN	03/15/2023	3,504	18.68	(65,451)
2023021403003	S	USDMXN	02/15/2023	(200,000,000)	18.61	3,722,000,000
2023021403004	B	USDMXN	02/16/2023	200,000,000	18.61	(3,722,696,000)
2023021403045	S	USDMXN	02/15/2023	(200,000,000)	18.52	3,703,000,000
2023021403046	B	USDMXN	02/16/2023	200,000,000	18.52	(3,703,690,000)
2023021403048	S	USDMXN	02/15/2023	(42,000,000)	18.54	778,680,000
2023021403049	B	USDMXN	02/16/2023	42,000,000	18.54	(778,824,900)
2023021403067	B	USDMXN	02/15/2023	150,000,000	18.63	(2,794,500,000)
2023021403068	S	USDMXN	02/16/2023	(150,000,000)	18.63	2,795,037,000
2023021403069	B	USDMXN	02/15/2023	150,000,000	18.63	(2,794,500,000)
2023021403070	S	USDMXN	02/16/2023	(150,000,000)	18.63	2,795,037,000
2023021403071	B	USDMXN	02/15/2023	142,000,000	18.63	(2,645,460,000)
2023021403072	S	USDMXN	02/16/2023	(142,000,000)	18.63	2,645,968,360
2023021403081	B	USDMXN	02/16/2023	20,000,000	18.65	(372,900,000)
2023021403092	S	USDMXN	02/15/2023	(6,921,965)	18.55	128,369,743
2023021403093	B	USDMXN	02/16/2023	6,921,965	18.55	(128,395,527)
2023021403233	B	USDMXN	02/16/2023	20,000,000	18.57	(371,460,000)
2023021403243	S	USDMXN	02/16/2023	(125,000)	18.56	2,319,638
2023021403244	B	USDMXN	03/10/2023	125,000	18.64	(2,329,498)
2023021403246	S	USDMXN	02/16/2023	(125,000)	18.56	2,319,450
2023021403248	S	USDMXN	02/16/2023	(125,000)	18.56	2,319,375
2023021403250	S	USDMXN	02/16/2023	(125,000)	18.56	2,319,538
2023021403397	BO	USDMXN	03/21/2023	100,000	18.64	(1,864,366)
2023021403478	S	USDMXN	02/16/2023	(1,262,610)	18.52	23,388,461
2023021403491	SO	USDMXN	03/14/2023	(160,258)	18.61	2,982,778
2023021403582	BO	USDMXN	03/08/2023	105,337	18.58	(1,956,997)
2023021403583	BO	USDMXN	03/01/2023	65,797	18.55	(1,220,768)
2023021403636	BO	USDMXN	03/01/2023	98,400	18.55	(1,825,348)
2023021403637	BO	USDMXN	03/08/2023	128,800	18.58	(2,392,515)
2023021403638	BO	USDMXN	03/22/2023	33,000	18.63	(614,669)
2023021403654	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,097,166
2023021403655	B	USDMXN	02/22/2023	977,000	18.54	(18,117,723)
2023021403656	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,096,189
2023021403657	B	USDMXN	03/01/2023	977,000	18.57	(18,141,571)
2023021403658	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,096,873
2023021403659	B	USDMXN	03/08/2023	977,000	18.59	(18,166,706)
2023021403660	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,096,287
2023021403661	B	USDMXN	03/15/2023	977,000	18.62	(18,190,308)
2023021403662	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,096,385
2023021403663	B	USDMXN	03/22/2023	977,000	18.64	(18,215,868)
2023021403664	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,096,776
2023021403665	B	USDMXN	03/29/2023	977,000	18.67	(18,241,109)
2023021403666	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,097,166
2023021403668	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,097,948
2023021403670	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,097,948
2023021403672	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,097,948
2023021403674	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,096,678
2023021403676	S	USDMXN	02/16/2023	(977,000)	18.52	18,096,678
2023021503012	SO	USDMXN	03/03/2023	(150,000)	18.70	2,804,749
2023021503055	S	USDMXN	02/17/2023	(1,000,000)	18.66	18,660,000
2023021503056	S	USDMXN	02/16/2023	(14,000,000)	18.66	261,240,000
2023021503057	B	USDMXN	02/17/2023	14,000,000	18.66	(261,288,300)
2023021503109	S	USDMXN	02/16/2023	(921,965)	18.65	17,191,511
2023021503110	B	USDMXN	02/17/2023	921,965	18.65	(17,194,691)
2023021503116	B	USDMXN	02/16/2023	150,000,000	18.65	(2,797,500,000)
2023021503117	S	USDMXN	02/17/2023	(150,000,000)	18.65	2,798,040,000
2023021503118	B	USDMXN	02/16/2023	150,000,000	18.65	(2,797,500,000)
2023021503119	S	USDMXN	02/17/2023	(150,000,000)	18.65	2,798,040,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023021503120	B	USDMXN	02/16/2023	150,000,000	18.65	(2,797,500,000)
2023021503121	S	USDMXN	02/17/2023	(150,000,000)	18.65	2,798,040,000
2023021503142	S	USDMXN	02/16/2023	(130,000,000)	18.65	2,424,110,000
2023021503143	B	USDMXN	02/17/2023	130,000,000	18.65	(2,424,555,250)
2023021503144	S	USDMXN	02/16/2023	(270,000,000)	18.65	5,034,690,000
2023021503145	B	USDMXN	02/17/2023	270,000,000	18.65	(5,035,614,750)
2023021503146	S	USDMXN	02/16/2023	(50,000,000)	18.65	932,350,000
2023021503147	B	USDMXN	02/17/2023	50,000,000	18.65	(932,521,250)
2023021503169	S	USDMXN	02/17/2023	(681,000)	18.67	12,716,449
2023021503170	B	USDMXN	03/01/2023	681,000	18.72	(12,745,631)
2023021503177	BO	USDMXN	03/01/2023	32,984	18.70	(616,894)
2023021503261	BO	USDMXN	03/09/2023	4,390	18.69	(82,035)
2023021503262	BO	USDMXN	03/16/2023	16,480	18.71	(308,355)
2023021503450	S	USDMXN	02/17/2023	(15,000,000)	18.62	279,330,000
2023021503517	S	USDMXN	02/15/2023	(20,000,000)	18.59	371,800,000
2023021503518	B	USDMXN	02/16/2023	20,000,000	18.59	(371,868,000)
2023021503530	SO	USDMXN	03/06/2023	(226,000)	18.66	4,216,170
2023021603011	B	USDMXN	02/21/2023	30,000,000	18.63	(558,900,000)
2023021603105	B	USDMXN	02/17/2023	378,035	18.63	(7,042,657)
2023021603106	S	USDMXN	02/21/2023	(378,035)	18.64	7,047,633
2023021603124	S	USDMXN	02/17/2023	(160,970,113)	18.64	3,000,000,000
2023021603125	B	USDMXN	02/21/2023	160,852,734	18.65	(3,000,000,000)
2023021603126	S	USDMXN	02/17/2023	(40,242,528)	18.64	750,000,000
2023021603127	B	USDMXN	02/21/2023	40,213,183	18.65	(750,000,000)
2023021603128	S	USDMXN	02/17/2023	(49,364,168)	18.64	920,000,000
2023021603129	B	USDMXN	02/21/2023	49,328,172	18.65	(920,000,000)
2023021603140	S	USDMXN	02/17/2023	(100,000,000)	18.65	1,865,200,000
2023021603141	B	USDMXN	02/21/2023	100,000,000	18.67	(1,866,560,000)
2023021603149	B	USDMXN	02/21/2023	200,000	18.64	(3,727,000)
2023021603193	S	USDMXN	02/17/2023	(37,711,454)	18.56	700,000,000
2023021603194	B	USDMXN	02/21/2023	37,683,843	18.58	(700,000,000)
2023021603202	S	USDMXN	02/21/2023	(4,000,000)	18.57	74,270,960
2023021603203	B	USDMXN	02/28/2023	4,000,000	18.59	(74,369,760)
2023021603206	S	USDMXN	02/21/2023	(1,362,000)	18.55	25,271,256
2023021603207	B	USDMXN	03/31/2023	1,362,000	18.69	(25,457,239)
2023021603259	BO	USDMXN	03/08/2023	44,000	18.66	(821,209)
2023021603266	S	USDMXN	02/16/2023	(25,000,000)	18.56	464,000,000
2023021603267	B	USDMXN	02/17/2023	25,000,000	18.56	(464,085,000)
2023021603272	S	USDMXN	02/17/2023	(25,000,000)	18.56	463,875,000
2023021603273	B	USDMXN	02/21/2023	25,000,000	18.57	(464,212,500)
2023021603275	B	USDMXN	02/21/2023	10,000	18.54	(185,432)
2023021603276	SON	USDMXN	02/21/2023	(30,000,000)	18.88	566,265,000
2023021603277	BO	USDMXN	02/21/2023	0	18.56	(9,510,000)
2023021603280	B	USDMXN	02/21/2023	30,000,000	18.56	(556,755,000)
2023021603283	B	USDMXN	02/17/2023	150,000,000	18.60	(2,790,000,000)
2023021603284	S	USDMXN	02/21/2023	(150,000,000)	18.61	2,792,130,000
2023021603286	B	USDMXN	02/17/2023	150,000,000	18.60	(2,790,000,000)
2023021603287	S	USDMXN	02/21/2023	(150,000,000)	18.61	2,792,130,000
2023021603288	B	USDMXN	02/17/2023	150,000,000	18.60	(2,790,000,000)
2023021603289	S	USDMXN	02/21/2023	(150,000,000)	18.61	2,792,130,000
2023021603306	S	USDMXN	02/17/2023	(49,369,466)	18.64	920,000,000
2023021603307	B	USDMXN	02/21/2023	49,333,462	18.65	(920,000,000)
2023021603469	S	USDMXN	02/21/2023	(2,000,000)	18.50	37,000,000
2023021603473	S	USDMXN	02/21/2023	(360,000)	18.50	6,659,860
2023021603527	B	USDMXN	03/28/2023	200,000	18.62	(3,723,124)
2023021603531	B	USDMXN	02/21/2023	1,399,938	18.49	(25,887,351)
2023021603533	BO	USDMXN	03/22/2023	77,000	18.60	(1,431,854)
2023021603536	B	USDMXN	02/21/2023	964,545	18.49	(17,835,801)
2023021603548	SO	USDMXN	03/28/2023	(314)	18.61	5,847

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023021703033	B	USDMXN	02/21/2023	378,035	18.54	(7,007,219)
2023021703034	S	USDMXN	02/22/2023	(378,035)	18.54	7,008,468
2023021703037	S	USDMXN	02/21/2023	(241,000,000)	18.53	4,466,212,000
2023021703038	B	USDMXN	02/22/2023	241,000,000	18.54	(4,467,031,400)
2023021703040	S	USDMXN	02/21/2023	(80,941,075)	18.53	1,500,000,000
2023021703041	B	USDMXN	02/22/2023	80,926,228	18.54	(1,500,000,000)
2023021703115	SO	USDMXN	03/03/2023	(1,200,000)	18.49	22,189,144
2023021703126	SO	USDMXN	03/06/2023	(1,300,000)	18.51	24,057,535
2023021703201	SO	USDMXN	03/07/2023	(221,000)	18.64	4,118,359
2023021703272	BO	USDMXN	03/03/2023	74,673	18.47	(1,379,060)
2023021703274	B	USDMXN	02/22/2023	15,000	18.43	(276,481)
2023021703328	BO	EURMXN	02/21/2023	5,200,000	19.66	(102,251,448)
2023021703352	S	USDMXN	02/22/2023	(1,000,000)	18.42	18,416,740
2023021703366	BO	USDMXN	03/22/2023	100,105	18.50	(1,852,216)
2023021703389	BO	USDMXN	03/08/2023	400,000	18.49	(7,396,570)
2023021703392	B	USDMXN	02/21/2023	150,000,000	18.40	(2,760,000,000)
2023021703393	S	USDMXN	02/22/2023	(150,000,000)	18.40	2,760,540,000
2023021703394	B	USDMXN	02/21/2023	150,000,000	18.40	(2,760,000,000)
2023021703395	S	USDMXN	02/22/2023	(150,000,000)	18.40	2,760,540,000
2023021703396	B	USDMXN	02/21/2023	150,000,000	18.40	(2,760,000,000)
2023021703397	S	USDMXN	02/22/2023	(150,000,000)	18.40	2,760,540,000
2023021703399	B	USDMXN	02/22/2023	1,000,000	18.35	(18,354,600)
2023021703400	B	USDMXN	02/22/2023	1,000,000	18.36	(18,356,860)
2023021703414	S	USDMXN	02/21/2023	(110,000,000)	18.39	2,022,900,000
2023021703415	B	USDMXN	02/22/2023	110,000,000	18.39	(2,023,296,000)
2023021703438	S	USDMXN	02/22/2023	(500,000)	18.38	9,189,280
2023021703442	S	USDMXN	02/22/2023	(500,000)	18.38	9,187,860
2023021703445	S	USDMXN	02/22/2023	(1,000,000)	18.38	18,376,500
2023021703448	S	USDMXN	02/22/2023	(250,000)	18.38	4,594,080
2023021703479	SO	USDMXN	03/06/2023	(21,687)	18.41	399,175
2023021703625	BO	USDMXN	03/22/2023	400,000	18.49	(7,396,758)
2023021703626	BO	USDMXN	03/29/2023	400,000	18.47	(7,386,366)
2023021703652	B	USDMXN	02/22/2023	20,000,000	18.36	(367,140,000)
2023021703744	S	USDMXN	02/22/2023	(96,864)	18.36	1,778,153
2023021703745	B	USDMXN	03/01/2023	96,864	18.38	(1,780,536)
2023021703746	S	USDMXN	02/22/2023	(101,668)	18.36	1,866,341
2023021703747	B	USDMXN	03/15/2023	101,668	18.43	(1,873,885)
2023021703749	S	USDMXN	02/22/2023	(18,468)	18.36	339,041
2023021703781	S	USDMXN	02/22/2023	(24,624)	18.36	451,980
2023022003324	BO	USDMXN	03/01/2023	33,064	18.41	(608,747)
2023022003425	BO	USDMXN	03/01/2023	57,532	18.42	(1,059,775)
2023022003426	BO	USDMXN	03/08/2023	100,068	18.45	(1,845,758)
2023022003427	BO	USDMXN	03/22/2023	32,400	18.50	(599,282)
2023022003431	BO	USDMXN	03/01/2023	468	18.42	(8,619)
2023022103003	B	USDMXN	02/22/2023	278,035	18.37	(5,106,981)
2023022103004	S	USDMXN	02/23/2023	(278,035)	18.37	5,107,894
2023022103106	B	USDMXN	02/23/2023	30,000,000	18.40	(552,000,000)
2023022103107	S	USDMXN	03/23/2023	(30,000,000)	18.50	555,015,000
2023022103258	S	USDMXN	02/22/2023	(125,000,000)	18.38	2,297,500,000
2023022103259	B	USDMXN	02/23/2023	125,000,000	18.38	(2,297,931,250)
2023022103262	S	USDMXN	02/22/2023	(54,400,000)	18.38	999,872,000
2023022103263	B	USDMXN	02/23/2023	54,400,000	18.38	(1,000,059,680)
2023022103266	S	USDMXN	02/22/2023	(125,000,000)	18.40	2,299,750,000
2023022103267	B	USDMXN	02/23/2023	125,000,000	18.40	(2,300,181,250)
2023022103268	S	USDMXN	02/22/2023	(81,566,000)	18.39	1,499,998,740
2023022103269	B	USDMXN	02/23/2023	81,566,000	18.39	(1,500,280,143)
2023022103274	SO	USDMXN	03/09/2023	(1,100,000)	18.44	20,287,892
2023022103289	BON	USDMXN	03/27/2023	35,000,000	18.50	(647,412,500)
2023022103292	SON	USDMXN	02/23/2023	(30,000,000)	19.02	570,696,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023022103293	BO	USDMXN	02/23/2023	0	18.38	(19,176,000)
2023022103374	S	USDMXN	02/22/2023	(65,000,000)	18.41	1,196,455,000
2023022103375	B	USDMXN	02/23/2023	65,000,000	18.41	(1,196,679,250)
2023022103394	B	USDMXN	02/22/2023	150,000,000	18.42	(2,763,000,000)
2023022103395	S	USDMXN	02/23/2023	(150,000,000)	18.42	2,763,540,000
2023022103396	B	USDMXN	02/22/2023	150,000,000	18.42	(2,763,000,000)
2023022103397	S	USDMXN	02/23/2023	(150,000,000)	18.42	2,763,540,000
2023022103398	B	USDMXN	02/22/2023	150,000,000	18.42	(2,763,000,000)
2023022103399	S	USDMXN	02/23/2023	(150,000,000)	18.42	2,763,540,000
2023022103407	B	USDMXN	02/23/2023	2,500,000	18.42	(46,054,500)
2023022103442	S	USDMXN	02/23/2023	(50,000,000)	18.40	920,000,000
2023022103443	B	USDMXN	03/15/2023	50,000,000	18.47	(923,550,000)
2023022103457	S	USDMXN	03/08/2023	(144,000)	18.45	2,656,186
2023022103638	SO	USDMXN	03/10/2023	(378,000)	18.47	6,983,532
2023022103639	S	USDMXN	03/08/2023	(58,829)	18.51	1,088,670
2023022103640	B	USDMXN	03/15/2023	58,829	18.53	(1,090,188)
2023022103641	S	USDMXN	03/09/2023	(49,170)	18.51	910,005
2023022103642	B	USDMXN	03/17/2023	49,170	18.54	(911,457)
2023022103647	SO	USDMXN	03/09/2023	(14,097)	18.51	260,879
2023022103648	BO	USDMXN	03/15/2023	11,872	18.53	(220,031)
2023022103649	BO	USDMXN	03/17/2023	60,000	18.54	(1,112,459)
2023022103650	BO	USDMXN	03/31/2023	100,000	18.52	(1,852,319)
2023022103658	BO	USDMXN	03/31/2023	581,000	18.58	(10,797,266)
2023022103713	BO	USDMXN	03/15/2023	94,353	18.53	(1,747,967)
2023022103731	S	USDMXN	02/23/2023	(2,000,000)	18.47	36,936,600
2023022203009	S	USDMXN	02/23/2023	(200,000,000)	18.39	3,678,000,000
2023022203010	B	USDMXN	02/24/2023	200,000,000	18.39	(3,678,690,000)
2023022203032	S	USDMXN	02/23/2023	(100,000,000)	18.38	1,837,600,000
2023022203033	B	USDMXN	02/24/2023	100,000,000	18.38	(1,837,945,000)
2023022203114	S	USDMXN	02/23/2023	(24,000,000)	18.39	441,360,000
2023022203115	B	USDMXN	02/24/2023	24,000,000	18.39	(441,442,200)
2023022203120	S	USDMXN	02/23/2023	(50,000,000)	18.36	918,100,000
2023022203121	B	USDMXN	02/24/2023	50,000,000	18.37	(918,273,750)
2023022203127	S	USDMXN	02/23/2023	(721,965)	18.36	13,257,911
2023022203128	B	USDMXN	02/24/2023	721,965	18.37	(13,260,546)
2023022203183	BO	USDMXN	03/31/2023	681,000	18.51	(12,602,743)
2023022203228	S	USDMXN	02/23/2023	(50,000,000)	18.39	919,500,000
2023022203229	B	USDMXN	02/24/2023	50,000,000	18.39	(919,673,750)
2023022203232	S	USDMXN	02/23/2023	(54,466,231)	18.36	1,000,000,000
2023022203233	B	USDMXN	02/24/2023	54,455,924	18.36	(1,000,000,000)
2023022203234	S	USDMXN	02/23/2023	(45,000,000)	18.35	825,750,000
2023022203235	B	USDMXN	02/24/2023	45,000,000	18.35	(825,906,375)
2023022203239	B	USDMXN	02/23/2023	150,000,000	18.36	(2,754,000,000)
2023022203240	S	USDMXN	02/24/2023	(150,000,000)	18.36	2,754,541,500
2023022203241	B	USDMXN	02/23/2023	150,000,000	18.36	(2,754,000,000)
2023022203242	S	USDMXN	02/24/2023	(150,000,000)	18.36	2,754,541,500
2023022203243	B	USDMXN	02/23/2023	150,000,000	18.36	(2,754,000,000)
2023022203244	S	USDMXN	02/24/2023	(150,000,000)	18.36	2,754,541,500
2023022203247	B	USDMXN	02/24/2023	70,000,000	18.36	(1,285,200,000)
2023022203248	S	USDMXN	03/15/2023	(70,000,000)	18.43	1,289,876,000
2023022203273	B	USDMXN	02/24/2023	20,000,000	18.36	(367,200,000)
2023022203274	S	USDMXN	03/15/2023	(20,000,000)	18.43	368,536,000
2023022203308	S	USDMXN	02/24/2023	(90,000,000)	18.36	1,652,400,000
2023022203309	B	USDMXN	03/15/2023	90,000,000	18.43	(1,658,430,000)
2023022203318	S	USDMXN	02/24/2023	(30,000,000)	18.35	550,500,000
2023022203319	BO	USDMXN	03/15/2023	30,000,000	18.42	(552,510,000)
2023022203400	B	USDMXN	02/23/2023	50,000,000	18.34	(917,100,000)
2023022203401	S	USDMXN	02/24/2023	(50,000,000)	18.35	917,273,750
2023022203478	SO	USDMXN	03/02/2023	(850,000)	18.36	15,609,712

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023022203479	SO	USDMXN	03/07/2023	(1,050,000)	18.40	19,317,822
2023022203480	SO	USDMXN	03/08/2023	(910,000)	18.41	16,750,995
2023022203542	SO	USDMXN	03/10/2023	(40,000)	18.42	736,846
2023022203563	SO	USDMXN	03/02/2023	(2,095)	18.40	38,542
2023022203566	SO	USDMXN	03/07/2023	(9,948)	18.41	183,167
2023022203569	BO	USDMXN	03/08/2023	35,932	18.42	(662,000)
2023022303042	S	USDMXN	02/23/2023	(50,000,000)	18.35	917,600,000
2023022303043	B	USDMXN	02/24/2023	50,000,000	18.36	(917,785,000)
2023022303056	BO	EURUSD	02/23/2023	1,000,000	1.06	(1,059,849)
2023022303107	S	USDMXN	02/24/2023	(50,000,000)	18.33	916,500,000
2023022303108	B	USDMXN	02/27/2023	50,000,000	18.34	(917,030,000)
2023022303188	SO	USDMXN	03/10/2023	(188,000)	18.44	3,466,098
2023022303202	S	USDMXN	02/24/2023	(163,309,744)	18.37	3,000,000,000
2023022303203	B	USDMXN	02/27/2023	163,210,681	18.38	(3,000,000,000)
2023022303205	S	USDMXN	02/24/2023	(108,873,163)	18.37	2,000,000,000
2023022303206	B	USDMXN	02/27/2023	108,807,120	18.38	(2,000,000,000)
2023022303208	S	USDMXN	02/24/2023	(27,200,000)	18.36	499,392,000
2023022303209	B	USDMXN	02/27/2023	27,200,000	18.37	(499,688,480)
2023022303210	S	USDMXN	02/24/2023	(108,932,462)	18.36	2,000,000,000
2023022303211	B	USDMXN	02/27/2023	108,867,236	18.37	(2,000,000,000)
2023022303218	B	USDMXN	02/24/2023	150,000,000	18.40	(2,760,000,000)
2023022303219	S	USDMXN	02/27/2023	(150,000,000)	18.41	2,761,680,000
2023022303222	B	USDMXN	02/24/2023	150,000,000	18.40	(2,760,000,000)
2023022303223	S	USDMXN	02/27/2023	(150,000,000)	18.41	2,761,680,000
2023022303224	B	USDMXN	02/24/2023	150,000,000	18.40	(2,760,000,000)
2023022303225	S	USDMXN	02/27/2023	(150,000,000)	18.41	2,761,680,000
2023022303264	BO	USDMXN	03/31/2023	681,000	18.44	(12,559,738)
2023022303267	S	USDMXN	02/24/2023	(24,000,000)	18.44	442,512,000
2023022303268	B	USDMXN	02/27/2023	24,000,000	18.45	(442,776,000)
2023022303281	S	USDMXN	02/24/2023	(721,965)	18.42	13,299,204
2023022303282	B	USDMXN	02/27/2023	721,965	18.43	(13,307,474)
2023022303297	SO	USDMXN	03/10/2023	(225,000)	18.47	4,156,749
2023022303305	SO	USDMXN	03/07/2023	(250,000)	18.46	4,614,916
2023022303432	S	USDMXN	02/27/2023	(50,000,000)	18.40	920,050,000
2023022303433	B	USDMXN	03/13/2023	50,000,000	18.45	(922,525,000)
2023022303519	SO	USDMXN	03/13/2023	(226,000)	18.44	4,167,896
2023022303521	S	USDMXN	02/27/2023	(30,000,000)	18.39	551,700,000
2023022303630	SO	USDMXN	03/10/2023	(134,841)	18.41	2,481,904
2023022303631	S	USDMXN	02/27/2023	(10,000,000)	18.38	183,760,000
2023022303671	B	USDMXN	03/13/2023	2,681,291	18.42	(49,382,709)
2023022303672	S	USDMXN	03/14/2023	(2,681,291)	18.42	49,388,339
2023022303674	S	USDMXN	03/14/2023	(5,084,096)	18.42	93,663,951
2023022303677	S	USDMXN	03/14/2023	(383,575)	18.42	7,067,156
2023022303678	B	USDMXN	03/29/2023	383,575	18.48	(7,087,935)
2023022303697	SO	USDMXN	03/14/2023	(1,851,037)	18.43	34,115,226
2023022303701	SO	USDMXN	03/28/2023	(112,178)	18.48	2,073,213
2023022403009	B	USDMXN	02/27/2023	693,778	18.46	(12,807,222)
2023022403010	S	USDMXN	02/28/2023	(693,778)	18.46	12,809,578
2023022403011	S	USDMXN	02/27/2023	(250,000,000)	18.48	4,618,750,000
2023022403012	B	USDMXN	02/28/2023	250,000,000	18.48	(4,619,631,250)
2023022403094	SO	USDMXN	03/14/2023	(221,000)	18.51	4,090,226
2023022403096	S	USDMXN	02/27/2023	(150,000,000)	18.45	2,767,950,000
2023022403097	B	USDMXN	02/28/2023	150,000,000	18.46	(2,768,478,750)
2023022403098	B	USDMXN	02/27/2023	150,000,000	18.46	(2,769,000,000)
2023022403099	S	USDMXN	02/28/2023	(150,000,000)	18.46	2,769,543,750
2023022403100	B	USDMXN	02/27/2023	150,000,000	18.46	(2,769,000,000)
2023022403101	S	USDMXN	02/28/2023	(150,000,000)	18.46	2,769,543,750
2023022403102	B	USDMXN	02/27/2023	150,000,000	18.46	(2,769,000,000)
2023022403103	S	USDMXN	02/28/2023	(150,000,000)	18.46	2,769,543,750

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023022403121	B	USDMXN	02/28/2023	50,000,000	18.42	(920,850,000)
2023022403236	SO	USDMXN	03/03/2023	(300,000)	18.45	5,534,196
2023022403248	BO	USDMXN	03/31/2023	681,000	18.53	(12,620,439)
2023022403312	S	USDMXN	02/28/2023	(30,000,000)	18.44	553,200,000
2023022403313	S	USDMXN	02/28/2023	(10,000,000)	18.44	184,400,000
2023022403333	S	USDMXN	02/28/2023	(50,000,000)	18.42	921,150,000
2023022403334	B	USDMXN	03/15/2023	50,000,000	18.48	(923,815,000)
2023022403361	SO	USDMXN	03/10/2023	(100,000)	18.44	1,844,351
2023022403472	SO	USDMXN	03/17/2023	(227,000)	18.50	4,200,043
2023022403560	BO	USDMXN	03/29/2023	72,250	18.53	(1,338,683)
2023022403575	B	USDMXN	02/28/2023	30,000,000	18.42	(552,600,000)
2023022403576	S	USDMXN	03/21/2023	(30,000,000)	18.49	554,841,000
2023022403630	B	USDMXN	02/28/2023	30,000,000	18.42	(552,660,000)
2023022403631	S	USDMXN	03/21/2023	(30,000,000)	18.50	554,901,000
2023022703072	BO	USDMXN	03/08/2023	128,464	18.40	(2,364,136)
2023022703114	S	USDMXN	02/28/2023	(42,000,000)	18.41	773,304,000
2023022703115	B	USDMXN	03/01/2023	42,000,000	18.42	(773,453,100)
2023022703116	B	USDMXN	02/28/2023	293,778	18.39	(5,403,968)
2023022703117	S	USDMXN	03/01/2023	(293,778)	18.40	5,404,965
2023022703126	S	USDMXN	02/28/2023	(200,000,000)	18.40	3,679,600,000
2023022703127	B	USDMXN	03/01/2023	200,000,000	18.40	(3,680,310,000)
2023022703130	S	USDMXN	02/28/2023	(83,000,000)	18.41	1,527,615,000
2023022703131	B	USDMXN	03/01/2023	83,000,000	18.41	(1,527,909,650)
2023022703132	B	USDMXN	02/28/2023	175,000,000	18.40	(3,220,000,000)
2023022703133	S	USDMXN	03/01/2023	(175,000,000)	18.40	3,220,638,750
2023022703134	B	USDMXN	02/28/2023	175,000,000	18.40	(3,220,000,000)
2023022703135	S	USDMXN	03/01/2023	(175,000,000)	18.40	3,220,638,750
2023022703244	S	USDMXN	03/01/2023	(40,000,000)	18.38	735,160,000
2023022703257	B	USDMXN	03/01/2023	30,000,000	18.39	(551,700,000)
2023022703276	S	USDMXN	03/01/2023	(25,000,000)	18.40	460,034,250
2023022703378	SO	USDMXN	03/10/2023	(105,000)	18.44	1,936,407
2023022703459	BO	USDMXN	03/29/2023	73,200	18.51	(1,354,968)
2023022703472	S	USDMXN	03/01/2023	(100,000,000)	18.39	1,838,700,000
2023022703473	B	USDMXN	03/15/2023	100,000,000	18.44	(1,843,640,000)
2023022703523	BO	USDMXN	03/31/2023	681,000	18.48	(12,588,235)
2023022703627	SO	USDMXN	03/10/2023	(191,000)	18.42	3,517,354
2023022803004	S	USDMXN	03/01/2023	(40,000,000)	18.33	733,080,000
2023022803005	B	USDMXN	03/02/2023	40,000,000	18.33	(733,218,000)
2023022803029	BO	USDMXN	03/22/2023	34,800	18.39	(639,869)
2023022803035	S	USDMXN	03/01/2023	(100,000,000)	18.32	1,831,600,000
2023022803036	B	USDMXN	03/02/2023	100,000,000	18.32	(1,831,947,500)
2023022803037	B	USDMXN	03/01/2023	293,778	18.31	(5,379,323)
2023022803038	S	USDMXN	03/02/2023	(293,778)	18.31	5,380,288
2023022803059	S	USDMXN	03/01/2023	(175,000,000)	18.34	3,208,887,500
2023022803060	B	USDMXN	03/02/2023	175,000,000	18.34	(3,209,482,500)
2023022803073	B	USDMXN	03/01/2023	175,000,000	18.34	(3,209,500,000)
2023022803074	S	USDMXN	03/02/2023	(175,000,000)	18.34	3,210,125,625
2023022803076	B	USDMXN	03/01/2023	175,000,000	18.34	(3,209,500,000)
2023022803077	S	USDMXN	03/02/2023	(175,000,000)	18.34	3,210,125,625
2023022803164	S	USDMXN	03/02/2023	(20,000,000)	18.32	366,300,000
2023022803247	SON	USDMXN	03/02/2023	(35,000,000)	18.95	663,145,000
2023022803248	BO	USDMXN	03/02/2023	0	18.33	(21,770,000)
2023022803249	B	USDMXN	03/02/2023	35,000,000	18.33	(641,375,000)
2023022803490	SO	USDMXN	03/13/2023	(167,000)	18.38	3,069,227
2023022803517	S	USDMXN	03/02/2023	(50,000,000)	18.34	917,225,000
2023022803518	B	USDMXN	03/15/2023	50,000,000	18.39	(919,500,000)
2023022803669	S	USDMXN	03/02/2023	(60,000,000)	18.32	1,099,380,000
2023022803800	BO	USDMXN	03/08/2023	36,728	18.31	(672,656)
2023022803806	BO	USDMXN	03/28/2023	400,000	18.38	(7,353,579)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023030103035	S	USDMXN	03/02/2023	(706,222)	18.23	12,874,662
2023030103036	B	USDMXN	03/03/2023	706,222	18.23	(12,877,103)
2023030103038	S	USDMXN	03/02/2023	(200,000,000)	18.25	3,649,600,000
2023030103039	B	USDMXN	03/03/2023	200,000,000	18.25	(3,650,270,000)
2023030103041	S	USDMXN	03/02/2023	(26,000,000)	18.24	474,110,000
2023030103042	B	USDMXN	03/03/2023	26,000,000	18.24	(474,195,800)
2023030103044	S	USDMXN	03/02/2023	(150,000,000)	18.24	2,735,550,000
2023030103045	B	USDMXN	03/03/2023	150,000,000	18.24	(2,736,052,500)
2023030103090	B	USDMXN	03/02/2023	175,000,000	18.24	(3,192,000,000)
2023030103091	S	USDMXN	03/03/2023	(175,000,000)	18.24	3,192,612,500
2023030103092	B	USDMXN	03/02/2023	175,000,000	18.24	(3,192,000,000)
2023030103093	S	USDMXN	03/03/2023	(175,000,000)	18.24	3,192,612,500
2023030103106	BO	USDMXN	03/31/2023	150,000	18.35	(2,753,205)
2023030103131	BO	USDMXN	03/24/2023	400,000	18.35	(7,338,094)
2023030103205	S	USDMXN	03/03/2023	(50,000,000)	18.13	906,350,000
2023030103206	B	USDMXN	03/15/2023	50,000,000	18.17	(908,415,000)
2023030103227	BO	EURUSD	03/21/2023	290,000	1.07	(309,860)
2023030103244	SON	USDMXN	03/03/2023	(30,000,000)	19.44	583,200,000
2023030103245	BO	USDMXN	03/03/2023	0	18.14	(39,120,000)
2023030103252	BO	USDMXN	03/01/2023	10,000,000	18.12	(181,228,380)
2023030103255	S	USDMXN	03/03/2023	(50,000,000)	18.12	906,000,000
2023030103256	B	USDMXN	03/15/2023	50,000,000	18.16	(908,065,000)
2023030103324	B	USDMXN	03/03/2023	30,000,000	18.09	(542,700,000)
2023030203045	BO	USDMXN	03/02/2023	10,000,000	18.15	(181,482,600)
2023030203046	S	USDMXN	03/03/2023	(42,000,000)	18.19	763,812,000
2023030203047	B	USDMXN	03/06/2023	42,000,000	18.20	(764,213,100)
2023030203056	S	USDMXN	03/06/2023	(20,000,000)	18.16	363,100,000
2023030203059	B	USDMXN	03/03/2023	175,000,000	18.15	(3,176,250,000)
2023030203060	S	USDMXN	03/06/2023	(175,000,000)	18.16	3,178,087,500
2023030203062	B	USDMXN	03/03/2023	175,000,000	18.15	(3,176,250,000)
2023030203063	S	USDMXN	03/06/2023	(175,000,000)	18.16	3,178,087,500
2023030203066	S	USDMXN	03/03/2023	(108,000,000)	18.16	1,961,280,000
2023030203067	B	USDMXN	03/06/2023	108,000,000	18.17	(1,962,316,800)
2023030203068	S	USDMXN	03/03/2023	(200,000,000)	18.16	3,632,000,000
2023030203069	B	USDMXN	03/06/2023	200,000,000	18.17	(3,633,920,000)
2023030203088	SO	USDMXN	03/10/2023	(16,665)	18.15	302,399
2023030203089	SO	USDMXN	03/13/2023	(100)	18.16	1,816
2023030203092	BO	USDMXN	03/21/2023	53	18.19	(959)
2023030203128	S	USDMXN	03/03/2023	(36,000,000)	18.13	652,752,000
2023030203129	B	USDMXN	03/06/2023	36,000,000	18.14	(653,097,600)
2023030203133	S	USDMXN	03/03/2023	(706,222)	18.12	12,798,730
2023030203134	B	USDMXN	03/06/2023	706,222	18.13	(12,805,704)
2023030203243	S	USDMXN	03/06/2023	(200,000,000)	18.11	3,622,000,000
2023030203244	B	USDMXN	03/14/2023	200,000,000	18.14	(3,627,330,000)
2023030203247	B	USDMXN	03/06/2023	200,000,000	18.11	(3,622,000,000)
2023030203248	S	USDMXN	03/15/2023	(200,000,000)	18.14	3,628,000,000
2023030203443	S	USDMXN	03/06/2023	(548,400)	18.13	9,940,803
2023030203507	S	USDMXN	03/06/2023	(200,000)	18.10	3,619,652
2023030203509	S	USDMXN	03/06/2023	(200,000)	18.10	3,620,316
2023030203511	S	USDMXN	03/06/2023	(200,000)	18.10	3,620,340
2023030203544	S	USDMXN	03/06/2023	(548,400)	18.11	9,932,248
2023030203545	B	USDMXN	03/28/2023	548,400	18.19	(9,973,202)
2023030203550	B	USDMXN	03/28/2023	38,024	18.19	(691,536)
2023030203559	B	USDMXN	03/06/2023	808,442	18.12	(14,648,110)
2023030203590	S	USDMXN	03/06/2023	(250,000)	18.13	4,531,468
2023030203592	S	USDMXN	03/06/2023	(250,000)	18.13	4,531,545
2023030203594	S	USDMXN	03/06/2023	(250,000)	18.13	4,531,445
2023030203596	S	USDMXN	03/06/2023	(250,000)	18.13	4,531,445
2023030203598	S	USDMXN	03/06/2023	(250,000)	18.13	4,531,385

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023030203648	S	USDMXN	03/06/2023	(200,000,000)	18.13	3,625,000,000
2023030203649	B	USDMXN	03/14/2023	200,000,000	18.15	(3,630,330,000)
2023030203650	B	USDMXN	03/06/2023	200,000,000	18.13	(3,625,000,000)
2023030203651	S	USDMXN	03/15/2023	(200,000,000)	18.16	3,631,000,000
2023030203662	S	USDMXN	03/06/2023	(162,500)	18.13	2,945,547
2023030203664	S	USDMXN	03/06/2023	(162,500)	18.13	2,945,756
2023030203687	BO	USDMXN	03/22/2023	57,200	18.18	(1,039,942)
2023030203688	BO	USDMXN	03/29/2023	57,800	18.20	(1,052,197)
2023030303004	B	USDMXN	03/06/2023	293,778	18.05	(5,303,421)
2023030303005	S	USDMXN	03/07/2023	(293,778)	18.06	5,304,316
2023030303009	S	USDMXN	03/06/2023	(200,000,000)	18.05	3,610,600,000
2023030303010	B	USDMXN	03/07/2023	200,000,000	18.06	(3,611,240,000)
2023030303069	S	USDMXN	03/06/2023	(200,000,000)	18.05	3,610,600,000
2023030303070	B	USDMXN	03/07/2023	200,000,000	18.06	(3,611,240,000)
2023030303072	S	USDMXN	03/06/2023	(177,000,000)	18.04	3,193,080,000
2023030303073	B	USDMXN	03/07/2023	177,000,000	18.04	(3,193,646,400)
2023030303159	B	USDMXN	03/06/2023	200,000,000	18.00	(3,600,000,000)
2023030303160	S	USDMXN	03/07/2023	(200,000,000)	18.00	3,600,690,000
2023030303161	B	USDMXN	03/06/2023	200,000,000	18.00	(3,600,000,000)
2023030303162	S	USDMXN	03/07/2023	(200,000,000)	18.00	3,600,690,000
2023030303168	BO	EURMXN	03/06/2023	4,100,000	19.08	(78,227,951)
2023030303179	S	USDMXN	03/03/2023	(27,777,778)	18.00	500,000,000
2023030303180	B	USDMXN	03/06/2023	27,763,279	18.01	(500,000,000)
2023030303185	S	USDMXN	03/03/2023	(111,043,251)	18.01	2,000,000,000
2023030303186	B	USDMXN	03/06/2023	110,985,328	18.02	(2,000,000,000)
2023030303209	B	USDMXN	03/03/2023	100,000,000	18.00	(1,800,000,000)
2023030303210	S	USDMXN	03/06/2023	(100,000,000)	18.01	1,801,020,000
2023030303257	SON	USDMXN	03/07/2023	(30,000,000)	18.68	560,511,000
2023030303258	BO	USDMXN	03/07/2023	0	18.02	(19,993,500)
2023030303351	BO	USDMXN	03/30/2023	73,767	18.10	(1,334,978)
2023030303417	B	USDMXN	03/07/2023	30,000,000	18.00	(540,000,000)
2023030303419	BO	USDMXN	03/23/2023	34,810	18.06	(628,530)
2023030303421	BO	USDMXN	03/24/2023	34,801	18.06	(628,443)
2023030303431	SO	USDMXN	03/13/2023	(116,961)	18.02	2,107,339
2023030303464	SO	USDMXN	03/13/2023	(164,000)	18.02	2,955,444
2023030303487	B	USDMXN	03/07/2023	20,000,000	17.99	(359,800,000)
2023030303638	SO	USDMXN	03/14/2023	(127,103)	18.00	2,288,409
2023030303688	BO	USDMXN	03/15/2023	109,404	18.00	(1,968,890)
2023030303689	SO	USDMXN	03/13/2023	(83)	17.98	1,490
2023030303691	BO	USDMXN	03/14/2023	7	17.99	(124)
2023030303756	BO	USDMXN	03/15/2023	36,472	17.99	(655,964)
2023030603090	S	USDMXN	03/07/2023	(150,000,000)	18.00	2,699,550,000
2023030603091	B	USDMXN	03/08/2023	150,000,000	18.00	(2,700,026,250)
2023030603146	B	USDMXN	03/07/2023	5,993,778	17.99	(107,818,814)
2023030603147	S	USDMXN	03/08/2023	(5,993,778)	17.99	107,837,065
2023030603149	S	USDMXN	03/07/2023	(30,000,000)	18.02	540,540,000
2023030603150	B	USDMXN	03/08/2023	30,000,000	18.02	(540,635,250)
2023030603181	S	USDMXN	03/07/2023	(150,000,000)	18.00	2,699,550,000
2023030603182	B	USDMXN	03/08/2023	150,000,000	18.00	(2,700,026,250)
2023030603232	S	USDMXN	03/07/2023	(100,000,000)	18.00	1,799,500,000
2023030603233	B	USDMXN	03/08/2023	100,000,000	18.00	(1,799,820,000)
2023030603246	S	USDMXN	03/08/2023	(50,000,000)	18.01	900,370,000
2023030603247	B	USDMXN	03/14/2023	50,000,000	18.03	(901,360,150)
2023030603256	B	USDMXN	03/07/2023	200,000,000	18.00	(3,600,000,000)
2023030603257	S	USDMXN	03/08/2023	(200,000,000)	18.00	3,600,690,000
2023030603259	B	USDMXN	03/07/2023	200,000,000	18.00	(3,600,000,000)
2023030603260	S	USDMXN	03/08/2023	(200,000,000)	18.00	3,600,690,000
2023030603261	S	USDMXN	03/06/2023	(85,000,000)	18.02	1,531,700,000
2023030603262	B	USDMXN	03/07/2023	85,000,000	18.02	(1,531,984,750)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023030603394	S	USDMXN	03/08/2023	(14,000,000)	18.02	252,294,000
2023030603412	SO	USDMXN	03/14/2023	(500,000)	18.05	9,027,033
2023030603463	SO	USDMXN	03/24/2023	(244,000)	18.08	4,411,685
2023030603466	SO	USDMXN	03/14/2023	(11,165)	18.01	201,133
2023030603467	BO	USDMXN	03/22/2023	190,000	18.05	(3,428,620)
2023030603468	BO	USDMXN	03/29/2023	110,800	18.07	(2,001,965)
2023030603520	BO	USDMXN	03/13/2023	40,000	18.03	(721,015)
2023030603596	S	USDMXN	03/08/2023	(20,000,000)	18.01	360,280,000
2023030603622	SO	USDMXN	03/15/2023	(172,000)	18.03	3,101,590
2023030603630	SO	USDMXN	03/15/2023	(246)	18.03	4,427
2023030703004	S	USDMXN	03/08/2023	(50,000,000)	18.01	900,300,000
2023030703005	B	USDMXN	03/09/2023	50,000,000	18.01	(900,460,000)
2023030703006	S	USDMXN	03/08/2023	(100,000,000)	18.01	1,800,600,000
2023030703007	B	USDMXN	03/09/2023	100,000,000	18.01	(1,800,920,000)
2023030703008	S	USDMXN	03/08/2023	(223,000,000)	18.01	4,015,115,000
2023030703009	B	USDMXN	03/09/2023	223,000,000	18.01	(4,015,828,600)
2023030703010	S	USDMXN	03/08/2023	(27,000,000)	18.01	486,135,000
2023030703011	B	USDMXN	03/09/2023	27,000,000	18.01	(486,221,400)
2023030703012	B	USDMXN	03/08/2023	200,000,000	18.00	(3,600,000,000)
2023030703013	S	USDMXN	03/09/2023	(200,000,000)	18.00	3,600,670,000
2023030703014	B	USDMXN	03/08/2023	200,000,000	18.00	(3,600,000,000)
2023030703015	S	USDMXN	03/09/2023	(200,000,000)	18.00	3,600,670,000
2023030703043	S	USDMXN	03/08/2023	(6,222)	18.01	112,023
2023030703044	B	USDMXN	03/09/2023	6,222	18.01	(112,044)
2023030703046	S	USDMXN	03/08/2023	(14,000,000)	18.00	252,000,000
2023030703047	B	USDMXN	03/09/2023	14,000,000	18.00	(252,044,800)
2023030703052	S	USDMXN	03/07/2023	(20,000,000)	18.01	360,120,000
2023030703053	B	USDMXN	03/08/2023	20,000,000	18.01	(360,184,000)
2023030703173	SO	USDMXN	03/15/2023	(60,500)	18.11	1,095,794
2023030703226	S	USDMXN	03/09/2023	(40,000,000)	18.17	726,780,000
2023030703351	SO	USDMXN	03/27/2023	(239,000)	18.20	4,349,242
2023030703353	SO	USDMXN	03/28/2023	(255,000)	18.20	4,641,240
2023030703355	SO	USDMXN	03/21/2023	(480,000)	18.08	8,679,104
2023030703356	BO	USDMXN	03/15/2023	258	18.15	(4,673)
2023030703357	S	USDMXN	03/09/2023	(75,000,000)	18.13	1,359,375,000
2023030703358	B	USDMXN	03/15/2023	75,000,000	18.14	(1,360,860,000)
2023030703575	SO	USDMXN	03/15/2023	(500,000)	18.11	9,056,861
2023030703580	S	USDMXN	03/29/2023	(1,584,323)	18.20	28,834,857
2023030703582	S	USDMXN	03/29/2023	(1,649,057)	18.19	30,001,760
2023030703584	B	USDMXN	03/09/2023	6,766,620	18.14	(122,713,328)
2023030703585	S	USDMXN	03/29/2023	(6,766,620)	18.20	123,159,113
2023030703590	SO	USDMXN	03/15/2023	(39,085)	18.15	709,264
2023030703625	B	USDMXN	03/09/2023	30,000,000	18.14	(544,140,000)
2023030703647	BO	EURMXN	03/29/2023	282,000	19.22	(5,420,159)
2023030703656	BO	EURMXN	03/29/2023	569	19.22	(10,940)
2023030803051	S	USDMXN	03/09/2023	(150,000,000)	17.97	2,695,500,000
2023030803052	B	USDMXN	03/10/2023	150,000,000	17.97	(2,696,002,500)
2023030803080	S	USDMXN	03/09/2023	(24,000,000)	17.92	430,080,000
2023030803081	B	USDMXN	03/10/2023	24,000,000	17.92	(430,160,400)
2023030803091	S	USDMXN	03/09/2023	(6,222)	17.93	111,550
2023030803092	B	USDMXN	03/10/2023	6,222	17.93	(111,571)
2023030803103	S	USDMXN	03/09/2023	(166,504,787)	18.02	3,000,000,000
2023030803104	B	USDMXN	03/10/2023	166,474,758	18.02	(3,000,000,000)
2023030803118	BO	USDMXN	03/22/2023	113,000	17.96	(2,029,597)
2023030803132	S	USDMXN	03/09/2023	(166,504,787)	18.02	3,000,000,000
2023030803133	B	USDMXN	03/10/2023	166,474,758	18.02	(3,000,000,000)
2023030803171	S	USDMXN	03/10/2023	(20,000,000)	17.95	358,920,000
2023030803179	S	USDMXN	03/09/2023	(83,705,000)	17.92	1,499,993,600
2023030803180	B	USDMXN	03/10/2023	83,705,000	17.92	(1,500,274,012)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023030803181	B	USDMXN	03/09/2023	200,000,000	17.95	(3,590,000,000)
2023030803182	S	USDMXN	03/10/2023	(200,000,000)	17.95	3,590,690,000
2023030803183	B	USDMXN	03/09/2023	200,000,000	17.95	(3,590,000,000)
2023030803184	S	USDMXN	03/10/2023	(200,000,000)	17.95	3,590,670,000
2023030803187	B	USDMXN	03/09/2023	200,000,000	17.95	(3,590,000,000)
2023030803188	S	USDMXN	03/10/2023	(200,000,000)	17.95	3,590,690,000
2023030803207	B	USDMXN	03/10/2023	116,028,387	17.95	(2,082,709,554)
2023030803208	S	USDMXN	03/17/2023	(115,877,972)	17.97	2,082,709,554
2023030803211	S	USDMXN	03/10/2023	(150,000)	17.96	2,693,801
2023030803377	S	USDMXN	03/10/2023	(100,000,000)	17.97	1,796,500,000
2023030803378	B	USDMXN	03/17/2023	100,000,000	17.99	(1,798,850,000)
2023030803383	S	USDMXN	03/10/2023	(100,000,000)	17.97	1,796,500,000
2023030803384	B	USDMXN	03/17/2023	100,000,000	17.99	(1,798,850,000)
2023030803486	S	USDMXN	03/10/2023	(100,000)	17.99	1,798,968
2023030803487	B	USDMXN	03/22/2023	100,000	18.03	(1,803,019)
2023030803494	BO	USDMXN	03/22/2023	320	18.03	(5,769)
2023030903006	S	USDMXN	03/10/2023	(150,000,000)	17.92	2,688,000,000
2023030903007	B	USDMXN	03/13/2023	150,000,000	17.93	(2,689,507,500)
2023030903008	S	USDMXN	03/10/2023	(150,000,000)	17.92	2,688,000,000
2023030903009	B	USDMXN	03/13/2023	150,000,000	17.93	(2,689,507,500)
2023030903010	S	USDMXN	03/10/2023	(40,000,000)	17.91	716,480,000
2023030903011	B	USDMXN	03/13/2023	40,000,000	17.92	(716,882,000)
2023030903033	S	USDMXN	03/09/2023	(22,000,000)	17.92	394,130,000
2023030903034	B	USDMXN	03/10/2023	22,000,000	17.92	(394,203,700)
2023030903045	S	USDMXN	03/10/2023	(39,000,000)	17.92	698,880,000
2023030903046	B	USDMXN	03/13/2023	39,000,000	17.93	(699,273,900)
2023030903047	S	USDMXN	03/10/2023	(884,609)	17.91	15,846,382
2023030903048	B	USDMXN	03/13/2023	884,609	17.92	(15,855,466)
2023030903081	S	USDMXN	03/10/2023	(60,000,000)	17.94	1,076,400,000
2023030903082	B	USDMXN	03/13/2023	60,000,000	17.95	(1,077,006,000)
2023030903148	B	USDMXN	03/10/2023	200,000,000	18.00	(3,600,000,000)
2023030903149	S	USDMXN	03/13/2023	(200,000,000)	18.01	3,602,070,000
2023030903150	B	USDMXN	03/10/2023	200,000,000	18.00	(3,600,000,000)
2023030903151	S	USDMXN	03/13/2023	(200,000,000)	18.01	3,602,070,000
2023030903383	B	USDMXN	03/13/2023	20,000,000	18.05	(361,000,000)
2023030903651	BO	USDMXN	03/22/2023	38,348	18.27	(700,585)
2023030903726	SO	USDMXN	03/23/2023	(200,000)	18.35	3,670,109
2023031003042	B	USDMXN	03/14/2023	1,000,000	18.44	(18,440,050)
2023031003045	B	USDMXN	03/14/2023	1,000,000	18.44	(18,436,900)
2023031003080	S	USDMXN	03/14/2023	(1,000,000)	18.35	18,352,470
2023031003084	S	USDMXN	03/14/2023	(450,000)	18.37	8,265,353
2023031003091	B	USDMXN	03/14/2023	100,000,000	18.46	(1,845,500,000)
2023031003092	S	USDMXN	03/15/2023	(100,000,000)	18.46	1,845,845,000
2023031003094	B	USDMXN	03/14/2023	100,000,000	18.46	(1,845,500,000)
2023031003095	S	USDMXN	03/15/2023	(100,000,000)	18.46	1,845,845,000
2023031003101	S	USDMXN	03/13/2023	(100,000,000)	18.44	1,844,000,000
2023031003102	B	USDMXN	03/14/2023	100,000,000	18.44	(1,844,360,000)
2023031003103	S	USDMXN	03/13/2023	(200,000,000)	18.44	3,688,000,000
2023031003104	B	USDMXN	03/14/2023	200,000,000	18.44	(3,688,720,000)
2023031003125	S	USDMXN	03/13/2023	(884,609)	18.41	16,288,575
2023031003126	B	USDMXN	03/14/2023	884,609	18.42	(16,291,755)
2023031003150	S	USDMXN	03/13/2023	(109,000,000)	18.43	2,008,325,000
2023031003151	B	USDMXN	03/14/2023	109,000,000	18.43	(2,008,717,400)
2023031003321	S	USDMXN	03/14/2023	(548,400)	18.35	10,065,339
2023031003345	SO	USDMXN	03/31/2023	(377,000)	18.40	6,935,181
2023031003347	B	USDMXN	03/13/2023	200,000,000	18.40	(3,680,000,000)
2023031003348	S	USDMXN	03/14/2023	(200,000,000)	18.40	3,680,760,000
2023031003349	B	USDMXN	03/13/2023	200,000,000	18.40	(3,680,000,000)
2023031003350	S	USDMXN	03/14/2023	(200,000,000)	18.40	3,680,760,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023031003457	SO	USDMXN	03/23/2023	(690,736)	18.42	12,726,592
2023031003458	SO	USDMXN	03/27/2023	(690,549)	18.44	12,732,462
2023031003459	SO	USDMXN	03/21/2023	(110,856)	18.42	2,041,730
2023031003466	SO	USDMXN	03/30/2023	(97,000)	18.41	1,785,680
2023031003547	S	USDMXN	03/14/2023	(50,000,000)	18.45	922,255,500
2023031003600	SO	USDMXN	03/30/2023	(125,000)	18.57	2,320,975
2023031003640	B	USDMXN	03/14/2023	30,000,000	18.51	(555,210,000)
2023031003690	B	USDMXN	03/14/2023	39,000	18.46	(720,107)
2023031003692	B	USDMXN	03/14/2023	39,000	18.47	(720,297)
2023031003697	B	USDMXN	03/14/2023	39,000	18.47	(720,405)
2023031003726	S	USDMXN	03/14/2023	(31,200)	18.47	576,247
2023031003731	B	USDMXN	03/14/2023	31,200	18.48	(576,571)
2023031003752	B	USDMXN	03/14/2023	31,200	18.51	(577,628)
2023031003754	S	USDMXN	03/14/2023	(31,200)	18.51	577,591
2023031003757	B	USDMXN	03/14/2023	62,400	18.51	(1,155,238)
2023031003759	B	USDMXN	03/14/2023	31,200	18.51	(577,519)
2023031003765	B	USDMXN	03/14/2023	39,000	18.51	(722,032)
2023031003768	B	USDMXN	03/14/2023	39,000	18.51	(721,933)
2023031003770	B	USDMXN	03/14/2023	39,000	18.51	(721,905)
2023031003772	B	USDMXN	03/14/2023	39,000	18.51	(721,908)
2023031003775	B	USDMXN	03/14/2023	36,250	18.51	(671,032)
2023031003777	B	USDMXN	03/14/2023	36,250	18.51	(671,052)
2023031003779	B	USDMXN	03/14/2023	36,250	18.51	(671,006)
2023031003782	B	USDMXN	03/14/2023	36,250	18.51	(670,810)
2023031003798	S	USDMXN	03/14/2023	(548,400)	18.49	10,138,019
2023031003874	B	USDMXN	03/14/2023	62,400	18.50	(1,154,207)
2023031003879	B	USDMXN	03/14/2023	31,200	18.50	(577,214)
2023031003881	B	USDMXN	03/14/2023	39,000	18.50	(721,573)
2023031003883	S	USDMXN	03/14/2023	(31,200)	18.50	577,129
2023031003887	S	USDMXN	03/14/2023	(31,200)	18.50	577,102
2023031003890	BO	USDMXN	03/22/2023	38,884	18.53	(720,550)
2023031303115	S	USDMXN	03/14/2023	(100,000,000)	18.89	1,889,000,000
2023031303116	B	USDMXN	03/15/2023	100,000,000	18.89	(1,889,345,000)
2023031303117	S	USDMXN	03/14/2023	(106,072,660)	18.86	2,000,000,000
2023031303118	B	USDMXN	03/15/2023	106,053,255	18.86	(2,000,000,000)
2023031303119	S	USDMXN	03/14/2023	(53,036,330)	18.86	1,000,000,000
2023031303120	B	USDMXN	03/15/2023	53,026,627	18.86	(1,000,000,000)
2023031303121	B	USDMXN	03/15/2023	29,108	18.80	(547,305)
2023031303131	S	USDMXN	03/14/2023	(4,884,609)	18.78	91,746,585
2023031303132	B	USDMXN	03/15/2023	4,884,609	18.79	(91,764,218)
2023031303144	B	USDMXN	03/15/2023	30,000,000	18.83	(564,900,000)
2023031303174	B	USDMXN	03/15/2023	150,000	18.82	(2,823,225)
2023031303181	S	USDMXN	03/14/2023	(115,000,000)	18.85	2,167,865,000
2023031303182	B	USDMXN	03/15/2023	115,000,000	18.85	(2,168,267,500)
2023031303195	BO	JPYUSD	03/14/2023	8,000,000	133.11	(60,101)
2023031303207	S	USDMXN	03/15/2023	(1,000,000)	18.80	18,803,740
2023031303210	S	USDMXN	03/15/2023	(1,000,000)	18.81	18,813,580
2023031303218	B	USDMXN	03/14/2023	200,000,000	18.80	(3,760,000,000)
2023031303219	S	USDMXN	03/15/2023	(200,000,000)	18.80	3,760,740,000
2023031303220	B	USDMXN	03/14/2023	200,000,000	18.80	(3,760,000,000)
2023031303221	S	USDMXN	03/15/2023	(200,000,000)	18.80	3,760,740,000
2023031303238	B	USDMXN	03/15/2023	10,000,000	18.77	(187,700,000)
2023031303255	SON	USDMXN	03/15/2023	(30,000,000)	19.94	598,110,000
2023031303256	BO	USDMXN	03/15/2023	0	18.77	(34,935,000)
2023031303349	B	USDMXN	03/15/2023	10,000,000	18.83	(188,250,000)
2023031303393	S	USDMXN	03/15/2023	(50,000,000)	18.92	946,088,500
2023031303543	B	USDMXN	03/14/2023	50,000,000	18.80	(940,000,000)
2023031303544	S	USDMXN	03/15/2023	(50,000,000)	18.80	940,185,000
2023031303651	BO	USDMXN	03/23/2023	200,000	19.02	(3,803,476)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023031403010	S	USDMXN	03/15/2023	(100,000,000)	18.75	1,874,500,000
2023031403011	B	USDMXN	03/16/2023	100,000,000	18.75	(1,874,845,000)
2023031403013	S	USDMXN	03/15/2023	(376,110)	18.66	7,017,746
2023031403014	B	USDMXN	03/16/2023	376,110	18.66	(7,019,116)
2023031403018	S	USDMXN	03/15/2023	(40,000,000)	18.68	747,000,000
2023031403019	B	USDMXN	03/16/2023	40,000,000	18.68	(747,138,000)
2023031403020	S	USDMXN	03/15/2023	(200,000,000)	18.74	3,748,000,000
2023031403021	B	USDMXN	03/16/2023	200,000,000	18.74	(3,748,690,000)
2023031403044	B	USDMXN	03/15/2023	1,000,000	18.62	(18,621,332)
2023031403045	S	USDMXN	03/16/2023	(1,000,000)	18.62	18,624,500
2023031403089	SO	USDMXN	03/30/2023	(125,000)	19.15	2,394,099
2023031403175	S	USDMXN	03/15/2023	(50,000,000)	18.63	931,500,000
2023031403176	B	USDMXN	03/16/2023	50,000,000	18.63	(931,675,000)
2023031403180	B	USDMXN	03/15/2023	200,000,000	18.65	(3,730,000,000)
2023031403181	S	USDMXN	03/16/2023	(200,000,000)	18.65	3,730,740,000
2023031403183	B	USDMXN	03/15/2023	200,000,000	18.65	(3,730,000,000)
2023031403184	S	USDMXN	03/16/2023	(200,000,000)	18.65	3,730,740,000
2023031403246	S	USDMXN	03/15/2023	(200,000,000)	18.74	3,747,000,000
2023031403247	B	USDMXN	03/16/2023	200,000,000	18.74	(3,747,690,000)
2023031403304	SO	USDMXN	03/28/2023	(100,000)	18.71	1,871,317
2023031403517	B	USDMXN	03/16/2023	180,000	18.66	(3,358,370)
2023031403518	S	USDMXN	03/22/2023	(180,000)	18.68	3,362,000
2023031503003	S	USDMXN	03/16/2023	(64,000,000)	18.96	1,213,440,000
2023031503004	B	USDMXN	03/17/2023	64,000,000	18.96	(1,213,683,200)
2023031503006	S	USDMXN	03/16/2023	(376,110)	18.91	7,110,468
2023031503007	B	USDMXN	03/17/2023	376,110	18.91	(7,112,016)
2023031503044	S	USDMXN	03/16/2023	(100,000,000)	18.92	1,892,000,000
2023031503045	B	USDMXN	03/17/2023	100,000,000	18.92	(1,892,390,000)
2023031503047	S	USDMXN	03/16/2023	(50,000,000)	18.90	945,000,000
2023031503048	B	USDMXN	03/17/2023	50,000,000	18.90	(945,195,000)
2023031503049	S	USDMXN	03/16/2023	(125,000,000)	18.93	2,366,625,000
2023031503050	B	USDMXN	03/17/2023	125,000,000	18.94	(2,367,112,500)
2023031503052	S	USDMXN	03/16/2023	(50,000,000)	18.93	946,650,000
2023031503053	B	USDMXN	03/17/2023	50,000,000	18.94	(946,845,000)
2023031503121	S	USDMXN	03/17/2023	(1,500,000)	18.93	28,398,300
2023031503122	B	USDMXN	03/22/2023	1,500,000	18.95	(28,427,562)
2023031503127	B	USDMXN	03/16/2023	200,000,000	18.90	(3,780,000,000)
2023031503128	S	USDMXN	03/17/2023	(200,000,000)	18.90	3,780,810,000
2023031503129	B	USDMXN	03/16/2023	200,000,000	18.90	(3,780,000,000)
2023031503130	S	USDMXN	03/17/2023	(200,000,000)	18.90	3,780,810,000
2023031503310	B	USDMXN	03/17/2023	100,657,904	19.04	(1,916,526,500)
2023031503311	S	USDMXN	03/28/2023	(100,436,354)	19.08	1,916,526,500
2023031503358	S	USDMXN	03/17/2023	(50,000,000)	19.00	950,000,000
2023031503359	B	USDMXN	03/28/2023	50,000,000	19.04	(952,125,000)
2023031503445	S	USDMXN	03/17/2023	(50,000,000)	19.03	951,500,000
2023031503446	B	USDMXN	03/28/2023	50,000,000	19.07	(953,630,000)
2023031503450	S	USDMXN	03/17/2023	(221,000)	19.02	4,203,942
2023031503520	S	USDMXN	03/17/2023	(519,000)	18.97	9,844,029
2023031503522	S	USDMXN	03/17/2023	(21,772,311)	18.96	412,750,984
2023031503544	S	USDMXN	03/17/2023	(1,000,000)	18.96	18,963,000
2023031503585	B	USDMXN	03/17/2023	2,500,000	18.96	(47,400,000)
2023031603006	S	USDMXN	03/17/2023	(48,000,000)	19.08	915,840,000
2023031603007	B	USDMXN	03/21/2023	48,000,000	19.10	(916,608,000)
2023031603008	S	USDMXN	03/17/2023	(935,042)	19.06	17,825,710
2023031603009	B	USDMXN	03/21/2023	935,042	19.08	(17,840,798)
2023031603012	S	USDMXN	03/17/2023	(45,000,000)	19.09	859,050,000
2023031603013	B	USDMXN	03/21/2023	45,000,000	19.11	(859,770,000)
2023031603039	S	USDMXN	03/17/2023	(35,000,000)	19.08	667,625,000
2023031603040	B	USDMXN	03/21/2023	35,000,000	19.09	(668,185,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023031603056	S	USDMXN	03/17/2023	(250,000,000)	19.08	4,768,750,000
2023031603057	B	USDMXN	03/21/2023	250,000,000	19.09	(4,772,750,000)
2023031603174	S	USDMXN	03/21/2023	(1,000,000)	19.00	18,999,470
2023031603181	S	USDMXN	03/21/2023	(1,000,000)	19.01	19,006,130
2023031603184	S	USDMXN	03/21/2023	(1,000,000)	19.02	19,015,120
2023031603204	S	USDMXN	03/21/2023	(2,000,000)	18.92	37,840,280
2023031603206	S	USDMXN	03/21/2023	(1,000,000)	18.95	18,950,670
2023031603221	S	USDMXN	03/21/2023	(20,000,000)	19.00	379,900,000
2023031603225	S	USDMXN	03/21/2023	(20,000,000)	19.00	379,900,000
2023031603228	S	USDMXN	03/21/2023	(30,000,000)	19.00	569,850,000
2023031603230	B	USDMXN	03/17/2023	200,000,000	19.05	(3,810,000,000)
2023031603231	S	USDMXN	03/21/2023	(200,000,000)	19.07	3,813,360,000
2023031603232	B	USDMXN	03/17/2023	200,000,000	19.05	(3,810,000,000)
2023031603233	S	USDMXN	03/21/2023	(200,000,000)	19.07	3,813,360,000
2023031603236	S	USDMXN	03/17/2023	(50,000,000)	18.91	945,250,000
2023031603237	B	USDMXN	03/21/2023	50,000,000	18.92	(946,060,000)
2023031603273	B	USDMXN	03/21/2023	5,000,000	18.90	(94,521,500)
2023031603274	S	USDMXN	03/31/2023	(5,000,000)	18.94	94,714,255
2023031603276	B	USDMXN	03/21/2023	5,000,000	18.90	(94,520,500)
2023031603433	SO	USDMXN	03/24/2023	(25,000)	18.88	471,970
2023031603434	SO	USDMXN	03/31/2023	(25,000)	18.90	472,434
2023031603451	S	USDMXN	03/21/2023	(10,000,000)	18.87	188,650,000
2023031603520	B	USDMXN	03/27/2023	50,000,000	18.83	(941,385,750)
2023031603647	B	USDMXN	03/21/2023	1,688,150	18.75	(31,652,803)
2023031603648	S	USDMXN	03/28/2023	(1,688,150)	18.78	31,695,668
2023031603660	S	USDMXN	03/21/2023	(600,000)	18.74	11,245,548
2023031703003	S	USDMXN	03/21/2023	(200,000,000)	18.76	3,752,000,000
2023031703004	B	USDMXN	03/22/2023	200,000,000	18.76	(3,752,864,000)
2023031703005	S	USDMXN	03/21/2023	(65,000,000)	18.81	1,222,650,000
2023031703006	B	USDMXN	03/22/2023	65,000,000	18.81	(1,222,929,500)
2023031703007	S	USDMXN	03/21/2023	(50,000,000)	18.81	940,500,000
2023031703008	B	USDMXN	03/22/2023	50,000,000	18.81	(940,715,000)
2023031703009	B	USDMXN	03/21/2023	200,000,000	18.80	(3,760,000,000)
2023031703010	S	USDMXN	03/22/2023	(200,000,000)	18.80	3,760,896,000
2023031703011	B	USDMXN	03/21/2023	200,000,000	18.80	(3,760,000,000)
2023031703012	S	USDMXN	03/22/2023	(200,000,000)	18.80	3,760,896,000
2023031703014	B	USDMXN	03/21/2023	64,958	18.79	(1,220,835)
2023031703015	S	USDMXN	03/22/2023	(64,958)	18.80	1,221,084
2023031703113	B	USDMXN	03/22/2023	20,000,000	18.92	(378,410,000)
2023031703588	S	EURMXN	03/21/2023	(290,000)	20.20	5,858,291
2023031703673	B	USDMXN	03/21/2023	1,000,000	18.91	(18,907,500)
2023032103000	S	USDMXN	03/22/2023	(9,000,000)	18.68	168,120,000
2023032103001	B	USDMXN	03/23/2023	9,000,000	18.68	(168,160,500)
2023032103003	S	USDMXN	03/22/2023	(45,235)	18.70	846,057
2023032103004	B	USDMXN	03/23/2023	45,235	18.71	(846,279)
2023032103026	S	USDMXN	03/22/2023	(100,000,000)	18.70	1,869,500,000
2023032103027	B	USDMXN	03/23/2023	100,000,000	18.70	(1,869,950,000)
2023032103030	S	USDMXN	03/22/2023	(45,000,000)	18.74	843,075,000
2023032103031	B	USDMXN	03/23/2023	45,000,000	18.74	(843,277,500)
2023032103036	S	USDMXN	03/22/2023	(80,000,000)	18.75	1,500,000,000
2023032103037	B	USDMXN	03/23/2023	80,000,000	18.75	(1,500,360,000)
2023032103043	B	USDMXN	03/22/2023	150,000,000	18.75	(2,812,500,000)
2023032103044	S	USDMXN	03/23/2023	(150,000,000)	18.75	2,813,205,000
2023032103045	B	USDMXN	03/22/2023	150,000,000	18.75	(2,812,500,000)
2023032103046	S	USDMXN	03/23/2023	(150,000,000)	18.75	2,813,205,000
2023032103121	S	USDMXN	03/23/2023	(1,000,000)	18.70	18,700,000
2023032103135	S	USDMXN	03/23/2023	(20,000,000)	18.69	373,860,000
2023032103392	B	USDMXN	03/23/2023	100,000	18.67	(1,867,260)
2023032103394	B	USDMXN	03/23/2023	100,000	18.67	(1,867,260)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023032103396	B	USDMXN	03/23/2023	100,000	18.67	(1,867,260)
2023032103415	B	USDMXN	03/23/2023	3,000,000	18.66	(55,981,530)
2023032103419	B	USDMXN	03/23/2023	569,000	18.66	(10,618,985)
2023032103433	S	USDMXN	03/23/2023	(548,500)	18.66	10,234,626
2023032103464	S	USDMXN	03/23/2023	(960,000)	18.64	17,898,528
2023032103490	S	USDMXN	03/23/2023	(2,819,212)	18.65	52,565,334
2023032103492	S	USDMXN	03/23/2023	(200,722)	18.65	3,742,560
2023032103494	B	USDMXN	03/23/2023	5,700,000	18.65	(106,301,580)
2023032103495	S	USDMXN	03/31/2023	(5,700,000)	18.68	106,478,332
2023032103579	BO	EURMXN	03/29/2023	141,285	20.09	(2,838,594)
2023032203007	B	USDMXN	03/23/2023	54,765	18.54	(1,015,358)
2023032203008	S	USDMXN	03/24/2023	(54,765)	18.54	1,015,586
2023032203043	S	USDMXN	03/23/2023	(50,000,000)	18.53	926,250,000
2023032203044	B	USDMXN	03/24/2023	50,000,000	18.53	(926,470,000)
2023032203050	S	USDMXN	03/23/2023	(50,000,000)	18.58	928,750,000
2023032203051	B	USDMXN	03/24/2023	50,000,000	18.58	(928,975,000)
2023032203118	B	USDMXN	03/24/2023	1,000,000	18.56	(18,557,830)
2023032203120	S	USDMXN	03/24/2023	(500,000)	18.56	9,280,450
2023032203122	S	USDMXN	03/24/2023	(500,000)	18.56	9,279,000
2023032203127	S	USDMXN	03/24/2023	(282,084)	18.56	5,236,495
2023032203128	B	USDMXN	03/29/2023	282,084	18.58	(5,242,381)
2023032203173	B	USDMXN	03/24/2023	5,000,000	18.57	(92,865,000)
2023032203179	B	USDMXN	03/24/2023	3,000,000	18.57	(55,719,000)
2023032203197	B	USDMXN	03/23/2023	150,000,000	18.55	(2,782,500,000)
2023032203198	S	USDMXN	03/24/2023	(150,000,000)	18.55	2,783,205,000
2023032203199	B	USDMXN	03/23/2023	150,000,000	18.55	(2,782,500,000)
2023032203200	S	USDMXN	03/24/2023	(150,000,000)	18.55	2,783,205,000
2023032203238	S	USDMXN	03/23/2023	(90,000,000)	18.56	1,669,950,000
2023032203239	B	USDMXN	03/24/2023	90,000,000	18.56	(1,670,364,000)
2023032203249	S	USDMXN	03/22/2023	(15,000,000)	18.53	277,950,000
2023032203250	B	USDMXN	03/23/2023	15,000,000	18.53	(278,019,750)
2023032203252	S	USDMXN	03/24/2023	(61,600)	18.53	1,141,479
2023032203254	S	USDMXN	03/24/2023	(38,600)	18.53	715,273
2023032203256	S	USDMXN	03/24/2023	(63,600)	18.53	1,178,387
2023032203258	S	USDMXN	03/24/2023	(144,000)	18.53	2,668,075
2023032203260	S	USDMXN	03/24/2023	(326,112)	18.53	6,042,692
2023032203261	B	USDMXN	03/29/2023	326,112	18.55	(6,049,498)
2023032203310	S	USDMXN	03/29/2023	(92,535,120)	18.56	1,717,636,906
2023032203316	BO	USDMXN	03/30/2023	10,000	18.55	(185,538)
2023032203318	S	USDMXN	03/30/2023	(96,137,619)	18.57	1,785,467,857
2023032203363	B	USDMXN	03/30/2023	96,225,700	18.56	(1,785,467,857)
2023032203374	S	USDMXN	03/24/2023	(4,000,000)	18.51	74,033,600
2023032203385	BO	USDMXN	03/29/2023	92,694,922	18.53	(1,717,636,906)
2023032203470	S	USDMXN	03/24/2023	(110,000)	18.46	2,030,963
2023032203472	S	USDMXN	03/24/2023	(46,000)	18.45	848,875
2023032203595	B	USDMXN	03/23/2023	15,000,000	18.44	(276,545,832)
2023032203596	S	USDMXN	03/24/2023	(15,000,000)	18.44	276,610,500
2023032203607	BO	USDMXN	03/29/2023	92,694,922	18.53	(1,717,636,906)
2023032203661	S	USDMXN	03/24/2023	(2,000,000)	18.63	37,260,000
2023032203677	B	USDMXN	03/24/2023	337,000	18.63	(6,279,759)
2023032303007	S	USDMXN	03/24/2023	(42,000,000)	18.58	780,150,000
2023032303008	B	USDMXN	03/27/2023	42,000,000	18.59	(780,683,400)
2023032303029	S	USDMXN	03/27/2023	(30,000,000)	18.56	556,800,000
2023032303067	B	USDMXN	03/24/2023	54,765	18.49	(1,012,630)
2023032303068	S	USDMXN	03/27/2023	(54,765)	18.50	1,013,297
2023032303079	S	USDMXN	03/23/2023	(30,000,000)	18.51	555,150,000
2023032303080	B	USDMXN	03/24/2023	30,000,000	18.51	(555,286,500)
2023032303081	S	USDMXN	03/24/2023	(35,000,000)	18.52	648,270,000
2023032303082	B	USDMXN	03/27/2023	35,000,000	18.53	(648,718,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023032303083	S	USDMXN	03/24/2023	(105,291,577)	18.52	1,950,000,000
2023032303084	B	USDMXN	03/27/2023	105,219,139	18.53	(1,950,000,000)
2023032303164	S	USDMXN	03/24/2023	(8,000,000)	18.49	147,920,000
2023032303165	B	USDMXN	03/27/2023	8,000,000	18.50	(148,024,400)
2023032303216	B	USDMXN	03/24/2023	150,000,000	18.50	(2,775,000,000)
2023032303217	S	USDMXN	03/27/2023	(150,000,000)	18.51	2,777,025,000
2023032303218	B	USDMXN	03/24/2023	150,000,000	18.50	(2,775,000,000)
2023032303219	S	USDMXN	03/27/2023	(150,000,000)	18.51	2,777,025,000
2023032303221	B	USDMXN	03/27/2023	72,438	18.47	(1,337,951)
2023032303272	SON	USDMXN	03/27/2023	(35,000,000)	18.50	647,412,500
2023032303273	BO	USDMXN	03/27/2023	0	18.49	(236,250)
2023032303277	S	USDMXN	03/27/2023	(35,000,000)	18.49	647,176,250
2023032303279	B	USDMXN	03/27/2023	35,000,000	18.49	(647,176,250)
2023032303286	B	USDMXN	03/23/2023	32,000,000	18.47	(591,040,000)
2023032303287	S	USDMXN	03/24/2023	(32,000,000)	18.47	591,187,200
2023032303301	S	USDMXN	03/23/2023	(32,000,000)	18.49	591,680,000
2023032303302	B	USDMXN	03/24/2023	32,000,000	18.49	(591,825,600)
2023032303362	S	USDMXN	03/27/2023	(600,000)	18.57	11,140,860
2023032303453	S	USDMXN	03/27/2023	(1,000,000)	18.55	18,554,300
2023032303466	S	USDMXN	03/27/2023	(500,000)	18.56	9,277,500
2023032303483	B	USDMXN	03/28/2023	1,349,460	18.60	(25,100,051)
2023032303494	B	USDMXN	03/27/2023	1,045,877	18.63	(19,479,468)
2023032303496	B	USDMXN	03/27/2023	423,120	18.63	(7,881,329)
2023032303544	B	USDMXN	03/27/2023	548,500	18.60	(10,203,883)
2023032303602	S	USDMXN	03/27/2023	(548,400)	18.62	10,212,744
2023032303613	S	USDMXN	03/27/2023	(75,200)	18.65	1,402,119
2023032303616	S	USDMXN	03/27/2023	(521,960)	18.64	9,730,065
2023032303620	S	USDMXN	03/27/2023	(37,600)	18.65	701,067
2023032403010	B	USDMXN	03/27/2023	54,765	18.65	(1,021,440)
2023032403011	S	USDMXN	03/28/2023	(54,765)	18.66	1,021,681
2023032403039	S	USDMXN	03/27/2023	(65,000,000)	18.60	1,209,000,000
2023032403040	B	USDMXN	03/28/2023	65,000,000	18.60	(1,209,308,750)
2023032403048	B	USDMXN	03/28/2023	30,000,000	18.61	(558,390,000)
2023032403071	B	USDMXN	03/27/2023	150,000,000	18.60	(2,790,000,000)
2023032403072	S	USDMXN	03/28/2023	(150,000,000)	18.60	2,790,735,000
2023032403073	B	USDMXN	03/27/2023	150,000,000	18.60	(2,790,000,000)
2023032403074	S	USDMXN	03/28/2023	(150,000,000)	18.60	2,790,735,000
2023032403097	S	USDMXN	03/28/2023	(3,000,000)	18.60	55,800,000
2023032403100	S	USDMXN	03/28/2023	(3,000,000)	18.60	55,800,000
2023032403132	B	USDMXN	03/28/2023	595,000	18.55	(11,038,172)
2023032403198	SON	USDMXN	03/28/2023	(30,000,000)	19.03	571,035,000
2023032403199	BO	USDMXN	03/28/2023	0	18.50	(16,050,000)
2023032403206	B	USDMXN	03/28/2023	30,000,000	18.50	(554,985,000)
2023032403233	B	USDMXN	03/28/2023	2,000,000	18.50	(36,990,000)
2023032403243	B	USDMXN	03/28/2023	2,000,000	18.50	(36,990,000)
2023032403351	S	USDMXN	03/28/2023	(74,465)	18.48	1,376,016
2023032403357	S	USDMXN	03/28/2023	(147,965)	18.48	2,734,165
2023032403361	S	USDMXN	03/28/2023	(74,699)	18.48	1,380,546
2023032403365	S	USDMXN	03/28/2023	(147,965)	18.48	2,734,032
2023032403371	S	USDMXN	03/28/2023	(222,400)	18.48	4,109,396
2023032403376	S	USDMXN	03/28/2023	(244,018)	18.48	4,508,545
2023032403520	S	USDMXN	03/28/2023	(27,000,000)	18.49	499,149,000
2023032703002	B	USDMXN	03/28/2023	16,878	18.35	(309,687)
2023032703003	S	USDMXN	03/29/2023	(16,878)	18.35	309,751
2023032703017	S	USDMXN	03/28/2023	(25,000,000)	18.34	458,375,000
2023032703018	B	USDMXN	03/29/2023	25,000,000	18.34	(458,477,500)
2023032703052	S	USDMXN	03/28/2023	(68,000,000)	18.34	1,246,780,000
2023032703053	B	USDMXN	03/29/2023	68,000,000	18.34	(1,247,058,800)
2023032703126	S	USDMXN	03/29/2023	(10,000,000)	18.39	183,940,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023032703136	S	USDMXN	03/29/2023	(500,000)	18.40	9,201,800
2023032703226	B	USDMXN	03/28/2023	150,000,000	18.35	(2,752,500,000)
2023032703227	S	USDMXN	03/29/2023	(150,000,000)	18.35	2,753,145,000
2023032703230	B	USDMXN	03/28/2023	150,000,000	18.35	(2,752,500,000)
2023032703231	S	USDMXN	03/29/2023	(150,000,000)	18.35	2,753,145,000
2023032703241	S	USDMXN	03/29/2023	(500,000)	18.38	9,188,700
2023032703253	S	USDMXN	03/29/2023	(548,500)	18.40	10,091,193
2023032703280	S	USDMXN	03/29/2023	(250,000)	18.36	4,591,075
2023032703311	S	USDMXN	03/29/2023	(4,000,000)	18.36	73,431,600
2023032703326	B	USDMXN	03/29/2023	20,000,000	18.37	(367,400,000)
2023032703425	S	USDMXN	03/29/2023	(100,000)	18.36	1,836,220
2023032703466	S	USDMXN	03/29/2023	(548,400)	18.36	10,068,843
2023032703562	S	USDMXN	03/29/2023	(130,564)	18.35	2,396,060
2023032703578	S	USDMXN	03/29/2023	(350,000)	18.36	6,424,250
2023032703580	S	USDMXN	03/29/2023	(400,000)	18.35	7,341,560
2023032703582	S	USDMXN	03/29/2023	(400,000)	18.35	7,341,680
2023032803004	B	USDMXN	03/29/2023	57,076	18.28	(1,043,417)
2023032803005	S	USDMXN	03/30/2023	(57,076)	18.29	1,043,652
2023032803023	S	USDMXN	03/29/2023	(50,000,000)	18.28	913,750,000
2023032803024	B	USDMXN	03/30/2023	50,000,000	18.28	(913,970,000)
2023032803026	B	USDMXN	03/30/2023	100,000	18.27	(1,826,566)
2023032803028	B	USDMXN	03/30/2023	548,400	18.28	(10,024,752)
2023032803034	S	USDMXN	03/30/2023	(548,400)	18.27	10,021,571
2023032803100	S	USDMXN	03/30/2023	(333,333)	18.26	6,086,200
2023032803102	S	USDMXN	03/30/2023	(333,333)	18.26	6,086,233
2023032803105	S	USDMXN	03/30/2023	(333,333)	18.26	6,086,167
2023032803177	B	USDMXN	03/29/2023	100,000,000	18.25	(1,825,000,000)
2023032803178	S	USDMXN	03/30/2023	(100,000,000)	18.25	1,825,460,000
2023032803179	B	USDMXN	03/29/2023	100,000,000	18.25	(1,825,000,000)
2023032803180	S	USDMXN	03/30/2023	(100,000,000)	18.25	1,825,460,000
2023032803227	S	USDMXN	03/30/2023	(400,000)	18.24	7,297,160
2023032803254	B	USDMXN	03/30/2023	100,000	18.25	(1,824,660)
2023032803391	S	USDMXN	03/30/2023	(400,000)	18.27	7,306,480
2023032803393	S	USDMXN	03/30/2023	(400,000)	18.27	7,306,120
2023032803401	S	USDMXN	03/30/2023	(100,000)	18.27	1,826,630
2023032803404	S	USDMXN	03/30/2023	(30,000)	18.27	547,974
2023032803406	S	USDMXN	03/30/2023	(70,000)	18.27	1,278,550
2023032803442	S	USDMXN	03/30/2023	(548,400)	18.25	10,009,177
2023032803527	BO	EURMXN	03/29/2023	75,000	19.78	(1,483,728)
2023032803569	B	USDMXN	03/30/2023	2,000,000	18.23	(36,450,000)
2023032803574	S	USDMXN	03/30/2023	(4,454,901)	18.22	81,185,675
2023032803576	S	USDMXN	03/30/2023	(630,013)	18.22	11,481,289
2023032903028	B	USDMXN	03/30/2023	69,000,000	18.17	(1,254,006,000)
2023032903029	S	USDMXN	03/31/2023	(69,000,000)	18.18	1,254,316,500
2023032903032	B	USDMXN	03/30/2023	668,996	18.13	(12,129,952)
2023032903033	S	USDMXN	03/31/2023	(668,996)	18.14	12,132,769
2023032903171	B	USDMXN	03/31/2023	1,000,000	18.11	(18,106,950)
2023032903173	B	USDMXN	03/31/2023	1,230,309	18.11	(22,279,682)
2023032903175	S	USDMXN	03/31/2023	(5,230,309)	18.12	94,759,081
2023032903259	B	USDMXN	03/30/2023	100,000,000	18.11	(1,810,500,000)
2023032903260	S	USDMXN	03/31/2023	(100,000,000)	18.11	1,810,910,000
2023032903300	B	USDMXN	03/30/2023	55,239,463	18.10	(1,000,000,000)
2023032903301	S	USDMXN	03/31/2023	(55,226,040)	18.11	1,000,000,000
2023032903337	S	USDMXN	03/31/2023	(13,423)	18.08	242,747
2023032903371	S	USDMXN	03/30/2023	(12,239,463)	18.08	221,272,761
2023032903372	B	USDMXN	03/31/2023	12,239,463	18.08	(221,324,987)
2023032903396	S	USDMXN	03/31/2023	(6,700,000)	18.08	121,136,000
2023032903439	S	USDMXN	03/31/2023	(1,100,000)	18.08	19,888,880
2023032903452	S	USDMXN	03/31/2023	(8,800,000)	18.09	159,155,040
2023032903555	S	USDMXN	03/31/2023	(30,000,000)	18.10	542,970,000
2023033003005	B	USDMXN	03/31/2023	55,000,000	18.13	(997,150,000)
2023033003010	BO	EURUSD	03/30/2023	2,000,000	1.09	(2,182,764)
2023033003042	B	USDMXN	03/31/2023	190,000,000	18.14	(3,446,220,000)
2023033003063	B	USDMXN	03/31/2023	368,996	18.12	(6,686,576)
2023033003692	S	USDMXN	03/31/2023	(500,000)	18.08	9,040,250

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2091003	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2091005	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2091021	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2091023	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2092532	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092534	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092535	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092796	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092798	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092799	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2097879	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2097881	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2097882	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	24,927
2097903	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2097905	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2097906	FX	04/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	24,927
2091112	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2091114	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2091115	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	9,855
2091148	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2091150	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2091151	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	9,855
2091204	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2091240	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2095895	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2095897	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2095898	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,029
2095923	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2095925	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2095926	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,029
2097595	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097597	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097598	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,518
2097615	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097617	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097618	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,518
2098616	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2098625	FX	05/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2093559	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093561	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093562	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093647	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093649	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093650	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2098011	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,000,000
2098013	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,000,000
2098014	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,000,000
2098016	FX	06/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,000,000
2095257	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2095337	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2095764	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2095836	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097057	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097059	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097060	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,937
2097129	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097131	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097132	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,937
2097743	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2097745	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097746	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,914
2097791	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097793	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097794	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	629
2097839	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097841	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097842	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,543
2098149	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098151	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098152	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,575
2098205	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098207	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098208	FX	09/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,575
2088239	FX	10/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2088251	FX	10/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099984	FX	10/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2099986	FX	10/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100020	FX	10/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100022	FX	10/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2092536	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092538	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092539	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092800	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092802	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092803	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2094230	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2094278	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096187	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096189	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096190	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,965
2096223	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096225	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096226	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,965
2096367	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2096369	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2096370	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	44,231
2096391	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2096393	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2096394	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	44,231
2096843	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096845	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096846	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,198
2096867	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096869	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096870	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,198
2096891	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096893	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096894	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,332
2096915	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096917	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096918	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,332
2100413	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100415	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100425	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100427	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100509	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100511	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100542	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2100544	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100575	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100577	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100578	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,805
2100595	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100597	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100598	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,805
2100739	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100741	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100742	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	628
2100747	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100749	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100750	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	628
2100755	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100757	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100761	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100763	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100888	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100890	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100891	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100936	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100938	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100939	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100984	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100986	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101020	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101022	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101317	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2101329	FX	11/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093563	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093565	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093566	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093651	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093653	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093654	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2095899	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2095901	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2095902	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,029
2095927	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2095929	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2095930	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,029
2096437	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096439	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096440	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,846
2096545	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096547	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096548	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,846
2097145	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097147	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097148	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	870
2097169	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097171	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097172	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	870
2097599	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097601	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097602	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,518
2097619	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097621	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097622	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,518

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2097915	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097917	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097930	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097932	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098617	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2098626	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2101057	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101059	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101069	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101071	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101081	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101083	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101084	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,375
2101097	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101099	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101100	FX	12/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,375
2095261	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2095341	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2095768	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2095840	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097297	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097299	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097300	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	5,024
2097329	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097331	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097332	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,048
2097361	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097363	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097364	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	5,024
2097436	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097438	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097460	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097462	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097484	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097486	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097747	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097749	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097750	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,914
2097795	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097797	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097798	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	629
2097843	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097845	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097846	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,543
2098153	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098155	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098156	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,575
2098209	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098211	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098212	FX	13/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,575
2099987	FX	17/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2099989	FX	17/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100023	FX	17/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100025	FX	17/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2092540	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092542	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092543	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092804	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092806	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2092807	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2097389	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2097391	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2097392	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,741
2097413	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2097415	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2097416	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,741
2099660	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099662	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099663	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2099672	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099674	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099675	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2100249	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2100251	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2100267	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2100269	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2100416	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100418	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100428	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100430	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100512	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100514	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100545	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100547	FX	18/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2076655	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	190,000
2076656	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	190,000
2076677	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	190,000
2076678	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	190,000
2097603	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097605	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097606	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,518
2097623	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097625	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097626	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,518
2098618	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2098627	FX	19/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2093567	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093569	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093570	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093655	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093657	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093658	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2102101	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102103	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102176	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102178	FX	20/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2095265	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2095345	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2095772	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2095844	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097751	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097753	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097754	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,914
2097799	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097801	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097802	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	629
2097847	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097849	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2097850	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,543
2102853	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102855	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102856	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424
2102901	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102903	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102904	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102949	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102951	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102952	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2102997	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2102999	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103000	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103093	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103095	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103096	FX	23/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2088241	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2088253	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099512	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099514	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099515	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,971
2099548	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099550	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099551	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,971
2099990	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2099992	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100026	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100028	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101197	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101199	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101209	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101211	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101230	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101274	FX	24/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2092544	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092546	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092547	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092808	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092810	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092811	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2100419	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100421	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100431	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100433	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100515	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100517	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100548	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100550	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100743	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100745	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100746	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	628
2100751	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100753	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100754	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	628
2100758	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100760	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100764	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100766	FX	25/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098619	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2098628	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2100892	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100894	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100895	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100940	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100942	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100943	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100987	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100989	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101023	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101025	FX	26/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2093571	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093573	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093574	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093659	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093661	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093662	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2094590	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2094626	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097149	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097151	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097152	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	870
2097173	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097175	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097176	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	870
2097509	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2097511	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2097512	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,145
2097533	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2097535	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2097536	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,145
2097691	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097693	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097694	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,327
2097715	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097717	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097718	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,327
2098030	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098054	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098079	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2098081	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2098082	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2098084	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2098665	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098667	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098668	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,478
2098685	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098687	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098688	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,478
2098701	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098711	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099680	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099682	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099683	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,226
2099716	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099718	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099719	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,226
2100297	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100299	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2100300	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,222
2100333	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100335	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100336	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,222
2101341	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	51,000,000
2101342	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	51,000,000
2102104	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102106	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102179	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102181	FX	27/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2097755	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097757	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097758	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,914
2097803	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097805	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097806	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	629
2097851	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097853	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097854	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,543
2100377	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100379	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100395	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100397	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2102857	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102859	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102860	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424
2102905	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102907	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102908	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102953	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102955	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102956	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2103001	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103003	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103004	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103097	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103099	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103100	FX	30/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2099642	FX	31/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2099654	FX	31/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2099993	FX	31/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2099995	FX	31/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100029	FX	31/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100031	FX	31/01/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2092548	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092550	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092551	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092812	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092814	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092815	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2097907	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2097909	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2097910	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	24,927
2100422	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100424	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100434	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100436	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	550,000
2100518	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100520	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2100551	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100553	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2101349	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101351	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101352	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625
2101389	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101391	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101392	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625
2103233	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2103235	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2103236	FX	01/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	24,927
2088243	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2088255	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2093575	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093577	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093578	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093663	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093665	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093666	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2098219	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098221	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098222	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,273
2098235	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098237	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098238	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,273
2098620	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2098629	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2100252	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100254	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100270	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100272	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2102107	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102109	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102182	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102184	FX	02/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2097333	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097335	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097336	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,048
2097439	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097441	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097759	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097761	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097762	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,914
2097807	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097809	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097810	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	629
2097855	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097857	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097858	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,543
2102862	FX	03/02/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102863	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102864	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424
2102910	FX	03/02/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102911	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102912	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102958	FX	03/02/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102959	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102960	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2103006	FX	03/02/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2103007	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103008	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103102	FX	03/02/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103103	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103104	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2103682	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103684	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103685	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,048
2103726	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103728	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103741	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103743	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103744	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103821	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103823	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103824	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103901	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103903	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103904	FX	03/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	9,114
2099996	FX	07/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2099998	FX	07/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100032	FX	07/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100034	FX	07/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2092552	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092554	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092555	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092816	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092818	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092819	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2094234	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2094282	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096395	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2096397	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2096398	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	44,231
2098475	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,800,000
2098477	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,800,000
2098478	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,800,000
2098480	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,800,000
2098481	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,200,000
2098483	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,200,000
2098484	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,200,000
2098486	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,200,000
2100255	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100257	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100273	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100275	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100521	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100523	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100554	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100556	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103237	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2103239	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2103240	FX	08/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	44,231
2098223	FX	09/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098225	FX	09/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098226	FX	09/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,273
2098239	FX	09/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098241	FX	09/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098242	FX	09/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,273

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2098621	FX	09/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2098630	FX	09/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2093579	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093581	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093582	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093667	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093669	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093670	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2102110	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102112	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102185	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102187	FX	10/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2096191	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096193	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096194	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,965
2096227	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096229	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096230	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,965
2096441	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096443	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096444	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,846
2096549	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096551	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096552	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,846
2096847	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096849	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096850	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,198
2096871	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096873	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096874	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,198
2096895	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096897	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096898	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,332
2096919	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096921	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2096922	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,332
2097153	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097155	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097156	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	870
2097177	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097179	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2097180	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	870
2097763	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097765	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097766	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,914
2097811	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097813	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097814	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	629
2097859	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097861	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097862	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,543
2100579	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100581	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100582	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,805
2100599	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100601	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100602	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,805
2100896	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100898	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2100899	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100944	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100946	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100947	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100990	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100992	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101026	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101028	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101113	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101115	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101125	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101127	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101319	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2101331	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2102865	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102867	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102868	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424
2102913	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102915	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102916	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102961	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102963	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102964	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2103009	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103011	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103012	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103105	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103107	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103108	FX	13/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2099999	FX	14/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100001	FX	14/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100035	FX	14/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100037	FX	14/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2103371	FX	14/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103515	FX	14/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092556	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092558	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092559	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092820	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092822	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092823	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2097417	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2097419	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2097420	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,741
2097918	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097920	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097933	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097935	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2100258	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100260	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100276	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100278	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100524	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100526	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100557	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100559	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2101353	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101355	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101356	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2101393	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101395	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101396	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625
2103241	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2103243	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2103244	FX	15/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,741
2088245	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2088257	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2093583	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093585	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093586	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093671	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093673	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093674	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2098227	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098229	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098230	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,273
2098243	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098245	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098246	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,273
2098622	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2098631	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2099664	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099666	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099667	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2099676	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099678	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099679	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2101060	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101062	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101072	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101074	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101085	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101087	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101088	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,375
2101101	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101103	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101104	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,375
2102113	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102115	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102188	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102190	FX	16/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2097337	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097339	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097340	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,048
2097442	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097444	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2097767	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097769	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	110,000
2097770	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,914
2097815	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097817	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,000
2097818	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	629
2097863	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097865	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	120,000
2097866	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,543
2102869	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102871	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102872	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2102917	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102919	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102920	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102965	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102967	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102968	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2103013	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103015	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103016	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103109	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103111	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103112	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2103686	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103688	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103689	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,048
2103729	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103731	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103745	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103747	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103748	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103825	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103827	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103828	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103905	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103907	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103908	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	9,114
2104468	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104470	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104471	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,219
2104516	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104518	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104519	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	34,229
2104564	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104566	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104567	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,465
2104612	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104614	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104615	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	235
2104660	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104662	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104663	FX	17/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,291
2076657	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	190,000
2076658	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	190,000
2076679	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	190,000
2076680	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	190,000
2099516	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099518	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099519	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,971
2099552	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099554	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099555	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,971
2100002	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100004	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100038	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100040	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101200	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101202	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101212	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101214	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2101234	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101278	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101597	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2101599	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2101600	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,584
2101625	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2101627	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2101628	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,584
2103374	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103518	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103994	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2104042	FX	21/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2092560	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092562	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092563	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092824	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092826	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092827	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2100261	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100263	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100279	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100281	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100527	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	600,000
2100529	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	600,000
2100560	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	600,000
2100562	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	600,000
2100689	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100690	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2102305	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2102306	FX	22/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2098231	FX	23/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098233	FX	23/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098234	FX	23/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,273
2098247	FX	23/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098249	FX	23/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098250	FX	23/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,273
2098623	FX	23/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2098632	FX	23/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2093587	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093589	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093590	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093675	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093677	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093678	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2094594	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2094630	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2097513	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2097515	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2097516	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,145
2097537	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2097539	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2097540	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,145
2097695	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097697	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097698	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,327
2097719	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097721	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097722	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,327
2098034	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2098058	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098267	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098269	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098270	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,196
2098279	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098281	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098282	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,196
2098669	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098671	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098672	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,478
2098689	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098691	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098692	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,478
2098703	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098713	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099684	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099686	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099687	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,226
2099720	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099722	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099723	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,226
2100301	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100303	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100304	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,222
2100337	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100339	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100340	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,222
2100900	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100902	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100903	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100948	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100950	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100951	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100993	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100995	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101029	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101031	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2102116	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102118	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102191	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102193	FX	24/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2100380	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100382	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100398	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100400	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2102751	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102753	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102802	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102804	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102873	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102875	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102876	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424
2102921	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102923	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102924	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102969	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102971	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102972	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2103017	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2103019	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103020	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103113	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103115	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103116	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2104472	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104474	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104475	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,219
2104520	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104522	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104523	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	34,229
2104568	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104570	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104571	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,465
2104616	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104618	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104619	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	235
2104664	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104666	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104667	FX	27/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,291
2100005	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100007	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100041	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100043	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101221	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2101223	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2101224	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	20,000
2101225	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2101227	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2101228	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	20,000
2103141	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103143	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103144	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,328
2103169	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103171	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103172	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,328
2103377	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103521	FX	28/02/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092564	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092566	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092567	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092828	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092830	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092831	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2097911	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2097913	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2097914	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	24,927
2100530	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100532	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100563	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100565	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2101357	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101359	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101360	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625
2101397	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101399	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101400	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625
2103245	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000
2103247	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	700,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2103248	FX	01/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	24,927
2094804	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2094820	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098535	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098537	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098538	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260
2098575	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098577	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098578	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260
2100623	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2100631	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2102754	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102756	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102805	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102807	FX	02/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2091836	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2091844	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2093591	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093593	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093594	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093679	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093681	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093682	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2102119	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102121	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102194	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102196	FX	03/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2098363	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098365	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098366	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,379
2098992	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2098994	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2098995	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	5,927
2099012	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099014	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099015	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2102877	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102879	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102880	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424
2102925	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102927	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102928	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102973	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102975	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102976	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2103021	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103023	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103024	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103117	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103119	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103120	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2103690	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103692	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103693	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,379
2103694	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103696	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103697	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2103749	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103751	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2103752	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103829	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103831	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103832	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103909	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103911	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103912	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	9,114
2104153	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2104154	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	5,927
2104171	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2104173	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2104174	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,944
2104235	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2104237	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2104238	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,944
2104327	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2104476	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104478	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104479	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,219
2104524	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104526	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104527	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	34,229
2104572	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104574	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104575	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,465
2104620	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104622	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104623	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	235
2104668	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104670	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104671	FX	06/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,291
2100008	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100010	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100044	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100046	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2103145	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103147	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103148	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,328
2103173	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103175	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103176	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,328
2103380	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103524	FX	07/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092568	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092570	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092571	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092832	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092834	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092835	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2094238	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2094286	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098315	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2098317	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2098318	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	20,631
2100288	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,000,000
2100290	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,000,000
2100291	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,000,000
2100293	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,000,000
2100533	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2100535	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100566	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100568	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2101137	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2101139	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2101140	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2101142	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2102757	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102759	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102808	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102810	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2103249	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2103251	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	500,000
2103252	FX	08/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	20,631
2098539	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098541	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098542	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260
2098579	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098581	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098582	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260
2100624	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2100632	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2102760	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102762	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102811	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102813	FX	09/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2093595	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093597	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093598	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093683	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093685	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093686	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2102122	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102124	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102197	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102199	FX	10/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2096195	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096197	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096198	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,965
2096231	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096233	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2096234	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,965
2096445	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096447	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096448	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,846
2096553	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096555	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2096556	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,846
2098271	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098273	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098274	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,196
2098283	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098285	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098286	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,196
2098367	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098369	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098370	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,379
2098996	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2098998	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2098999	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	5,927
2099016	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099018	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099019	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2100583	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100585	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100586	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,805
2100603	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100605	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2100606	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,805
2100904	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100906	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100907	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100952	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100954	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100955	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100996	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100998	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101032	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101034	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101116	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101118	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101128	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101130	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101321	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2101333	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2102882	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102883	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102884	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424
2102930	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102931	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102932	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102978	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102979	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102980	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2103026	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103027	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103028	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103122	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103123	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103124	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2103698	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103700	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103701	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,379
2103702	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103704	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103705	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2103753	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103755	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103756	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103833	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103835	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103836	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103913	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103915	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103916	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	9,114
2104155	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2104157	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2104158	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	5,927

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2104481	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104482	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104483	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,219
2104529	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104530	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104531	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	34,229
2104577	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104578	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104579	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,465
2104625	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104626	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104627	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	235
2104673	FX	13/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104674	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104675	FX	13/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,291
2100011	FX	14/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100013	FX	14/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100047	FX	14/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100049	FX	14/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2103383	FX	14/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103527	FX	14/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092572	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092574	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092575	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092836	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092838	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092839	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2097921	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097923	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097936	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2097938	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2100536	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100538	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100569	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100571	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2101361	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101363	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101364	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625
2101401	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101403	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101404	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625
2102764	FX	15/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102765	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102815	FX	15/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102816	FX	15/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2091838	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2091846	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2093599	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093601	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093602	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093687	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093689	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093690	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2098543	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098545	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098546	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260
2098583	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098585	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098586	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2100625	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2100633	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2101549	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2101551	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2101552	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,655
2101573	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2101575	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2101576	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,655
2102125	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102127	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102200	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102202	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102252	FX	16/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102253	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102254	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,683
2102276	FX	16/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102277	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102278	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,683
2105792	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2105793	FX	16/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2105794	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2105795	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2105796	FX	16/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2105797	FX	16/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2094806	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2094822	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098371	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098373	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098374	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,379
2099000	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2099002	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2099003	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	5,927
2099020	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099022	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2099023	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2100060	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	20,000,000
2100062	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	20,000,000
2100063	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,295,238
2100068	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	20,000,000
2100070	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	20,000,000
2100071	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,295,238
2101063	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101065	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101075	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101077	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101089	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101091	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101092	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,375
2101105	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101107	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2101108	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,375
2102886	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102887	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102888	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424
2102934	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102935	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102936	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102982	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102983	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2102984	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2103030	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103031	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103032	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103126	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103127	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103128	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2103706	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103708	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103709	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	12,379
2103710	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103712	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103713	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	7,902
2103757	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103759	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103760	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103837	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103839	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103840	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103917	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103919	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103920	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	9,114
2104159	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2104161	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2104162	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	5,927
2104179	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2104181	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2104182	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,944
2104243	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2104245	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2104246	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,944
2104485	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104486	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104487	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,219
2104533	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104534	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104535	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	34,229
2104581	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104582	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104583	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,465
2104629	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104630	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104631	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	235
2104677	FX	17/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104678	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104679	FX	17/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,291
2100014	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100016	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100050	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100052	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101601	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2101603	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2101604	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,584
2101629	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2101631	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	150,000
2101632	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,584
2103150	FX	21/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103151	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103152	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,328

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2103178	FX	21/03/2023	USD	PUT	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103179	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103180	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,328
2103386	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103530	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103998	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2104046	FX	21/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2092576	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092578	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092579	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092840	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092842	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092843	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2098451	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098453	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098454	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	973
2098463	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098465	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098466	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	973
2098511	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2098513	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2098514	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	46,973
2100539	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100541	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100572	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2100574	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2102769	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102771	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102820	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102822	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2103253	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2103255	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,000,000
2103256	FX	22/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	46,973
2098547	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098549	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098550	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260
2098587	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098589	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098590	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260
2100626	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2100634	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2102772	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102774	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102823	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102825	FX	23/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2093603	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093605	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093606	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093691	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093693	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093694	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2102128	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102130	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102203	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102205	FX	24/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2101188	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2101190	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2102889	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2102891	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2102892	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	42,424
2102937	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102939	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2102940	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	3,055
2102985	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102987	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2102988	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	291
2103033	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103035	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2103036	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,600
2103129	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103131	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2103132	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	47,370
2103732	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103734	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103761	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103763	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103764	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103841	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103843	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103844	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	4,557
2103921	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103923	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2103924	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	9,114
2104488	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104490	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	977,000
2104491	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	38,219
2104536	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104538	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	875,000
2104539	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	34,229
2104584	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104586	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	63,000
2104587	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,465
2104632	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104634	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,000
2104635	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	235
2104680	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104682	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	33,000
2104683	FX	27/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,291
2099520	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099522	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099523	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,971
2099556	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099558	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099559	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,971
2100017	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100019	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100053	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100055	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101203	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101205	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101215	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101217	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101238	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101282	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101501	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2101503	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2101504	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	14,619
2101525	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2101527	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	400,000
2101528	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	14,619
2103153	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103155	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103156	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,328
2103181	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103183	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103184	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	6,328
2103389	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2103533	FX	28/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092580	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092582	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092583	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2092844	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092846	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	200,000
2092847	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	15,256
2098038	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098062	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2098275	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098277	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098278	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,196
2098287	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098289	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2098290	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,196
2098673	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098675	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098676	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,478
2098693	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098695	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098696	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	13,478
2098705	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2098715	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2099688	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099690	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099691	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,226
2099724	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099726	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2099727	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,226
2100305	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100307	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100308	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,222
2100341	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100343	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2100344	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,222
2100908	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100910	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100911	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100956	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100958	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2100959	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,990
2100999	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101001	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101035	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101037	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101653	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2101655	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2101656	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,964
2102775	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102777	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000

Deal No	OTC	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Styl	Portfoli	Status	Prin. Amt.
2102826	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102828	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2103257	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103259	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2103260	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	10,964
2104724	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2104726	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2104727	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	11,842
2104760	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2104762	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	300,000
2104763	FX	29/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	11,842
2098551	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098553	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098554	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260
2098591	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098593	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2098594	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	2,260
2100383	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100385	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100401	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100403	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	75,000
2100627	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2100635	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	35,000
2101365	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101367	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101368	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625
2101405	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101407	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	50,000
2101408	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	1,625
2102778	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102780	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102829	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2102831	FX	30/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	100,000
2093607	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093609	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093610	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2093695	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093697	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	250,000
2093698	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	21,163
2094808	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2094824	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	25,000
2102131	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102133	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102206	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281
2102208	FX	31/03/2023	USD	CALL	MXN	EUR	NEGO	EXPIRE	60,281

Liquidados anticipadamente

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDV578	19/02/2023	U	mxn	194,296,386	194,296,386	194,296,386	
SDV558	19/02/2023	U	mxn	194,296,386	194,296,386	194,296,386	
SDV567	19/02/2023	U	mxn	194,296,386	194,296,386	194,296,386	
SDT715	08/04/2026	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SEY381	25/10/2024	U	mxn	225,000,000	225,000,000	225,000,000	
SFE628	26/11/2031	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SFV210	19/01/2024	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SFZ970	18/02/2026	U	mxn	295,000,000	295,000,000	295,000,000	
SGV995	14/06/2024	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHC533	08/08/2024	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SDR973	26/02/2025	U	mxn	225,000,000	225,000,000	225,000,000	
SDS500	24/10/2030	U	mxn	70,000,000	70,000,000	70,000,000	
SDS581	30/09/2029	U	mxn	179,000,000	179,000,000	179,000,000	
SDS682	06/03/2031	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SDS808	10/03/2026	U	mxn	230,000,000	230,000,000	230,000,000	
SDS912	19/03/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDT360	25/12/2025	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDT713	15/01/2026	U	mxn	225,000,000	225,000,000	225,000,000	
SDT766	24/04/2026	U	mxn	170,000,000	170,000,000	170,000,000	
SDU004	24/04/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDU029	24/03/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDU147	18/02/2026	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SDU263	07/11/2025	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDU658	01/06/2026	U	mxn	240,000,000	240,000,000	240,000,000	
SDV005	15/05/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDW357	14/08/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW557	20/04/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW682	17/07/2025	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDW688	30/01/2026	U	mxn	230,000,000	230,000,000	230,000,000	
SDW754	30/01/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW823	12/06/2026	U	mxn	135,000,000	135,000,000	135,000,000	
SDW826	06/08/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW888	21/05/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDX528	01/04/2027	U	mxn	563,014,510	563,014,510	563,014,510	
SED707	10/07/2026	U	mxn	210,000,000	210,000,000	210,000,000	
SFC648	27/11/2024	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SGK761	10/04/2024	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SHA837	01/09/2025	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDS660	03/11/2027	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SDS706	23/10/2026	U	mxn	370,000,000	370,000,000	370,000,000	
SDT025	17/03/2028	U	mxn	411,562,485	411,562,485	411,562,485	
SDT182	22/11/2029	U	mxn	135,000,000	135,000,000	135,000,000	
SDT385	20/03/2026	U	mxn	210,000,000	210,000,000	210,000,000	
SDT435	31/03/2031	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SDT464	31/12/2025	U	mxn	140,000,000	140,000,000	140,000,000	
SDT769	19/10/2026	U	mxn	220,000,000	220,000,000	220,000,000	
SDT909	08/04/2031	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU510	08/08/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV091	11/08/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV348	05/05/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDV439	26/03/2026	U	mxn	440,000,000	440,000,000	440,000,000	
SDV546	16/06/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDV602	16/04/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDV842	27/01/2026	U	mxn	240,000,000	240,000,000	240,000,000	
SDW114	12/02/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDW188	18/04/2023	U	mxn	1,110,000,000	1,110,000,000	1,110,000,000	
SDW370	09/04/2026	U	mxn	425,000,000	425,000,000	425,000,000	
SDW638	26/11/2025	U	mxn	210,000,000	210,000,000	210,000,000	
SDW767	24/04/2026	U	mxn	850,000,000	850,000,000	850,000,000	
SDX165	30/06/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDX749	21/05/2026	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SEY069	26/10/2023	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SEY081	24/10/2024	U	mxn	225,000,000	225,000,000	225,000,000	
SFR446	20/12/2026	U	mxn	900,000,000	900,000,000	900,000,000	
SGP438	10/05/2024	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SHB807	04/08/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDR997	23/02/2026	U	mxn	240,000,000	240,000,000	240,000,000	
SDS703	25/10/2024	U	mxn	480,000,000	480,000,000	480,000,000	
SDT056	09/06/2025	U	mxn	450,000,000	450,000,000	450,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDT476	02/07/2024	U	mxn	670,000,000	670,000,000	670,000,000	
SDU151	22/04/2026	U	mxn	135,000,000	135,000,000	135,000,000	
SDU725	01/12/2026	U	mxn	652,804,281	652,804,281	652,804,281	
SDU735	14/04/2026	U	mxn	450,000,000	450,000,000	450,000,000	
SDV025	02/06/2026	U	mxn	230,000,000	230,000,000	230,000,000	
SDV489	16/06/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV579	26/01/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDV910	12/08/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV961	13/01/2026	U	mxn	170,000,000	170,000,000	170,000,000	
SDV989	18/11/2025	U	mxn	320,000,000	320,000,000	320,000,000	
SDW216	10/09/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW374	05/05/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDX110	01/12/2025	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SEC911	30/06/2031	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SED138	07/07/2026	U	mxn	460,000,000	460,000,000	460,000,000	
SHC792	09/08/2024	U	mxn	750,000,000	750,000,000	750,000,000	
SDS974	01/02/2027	U	mxn	552,643,983	552,643,983	552,643,983	
SDU785	11/08/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV333	25/03/2026	U	mxn	145,000,000	145,000,000	145,000,000	
SDW436	29/01/2026	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDW797	06/08/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW974	18/07/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDX108	05/11/2025	U	mxn	220,000,000	220,000,000	220,000,000	
SDX153	02/12/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDY575	20/05/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDT006	19/03/2026	U	mxn	302,437,938	302,437,938	302,437,938	
SDU040	16/01/2026	U	mxn	230,000,000	230,000,000	230,000,000	
SDU507	04/12/2025	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDV745	26/03/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV934	24/02/2026	U	mxn	240,000,000	240,000,000	240,000,000	
SDW449	20/04/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDW715	14/01/2026	U	mxn	225,000,000	225,000,000	225,000,000	
SFZ899	21/02/2024	U	mxn	770,000,000	770,000,000	770,000,000	
SDW387	12/02/2026	U	mxn	230,000,000	230,000,000	230,000,000	
SDR972	27/02/2025	U	mxn	350,000,000	350,000,000	350,000,000	
SDT393	17/12/2024	U	mxn	450,000,000	450,000,000	450,000,000	
SDT466	01/07/2025	U	mxn	550,000,000	550,000,000	550,000,000	
SDU546	22/01/2026	U	mxn	2,940,000,000	2,940,000,000	2,940,000,000	
SDU666	23/01/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDW786	24/04/2026	U	mxn	850,000,000	850,000,000	850,000,000	
SFZ903	19/02/2025	U	mxn	2,533,000,000	2,533,000,000	2,533,000,000	
SHK625	21/06/2027	U	mxn	2,250,000,000	2,250,000,000	2,250,000,000	
SDS920	10/03/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDT917	08/04/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDT957	24/03/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDU023	15/01/2030	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDU087	09/04/2026	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDU241	09/04/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDU499	25/03/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDU843	27/03/2025	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDV029	18/03/2026	U	mxn	280,000,000	280,000,000	280,000,000	
SDV217	05/05/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDV265	26/03/2026	U	mxn	230,000,000	230,000,000	230,000,000	
SDV340	26/03/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV603	26/03/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDV754	07/05/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDV880	05/06/2024	U	mxn	385,000,000	385,000,000	385,000,000	
SDW192	29/01/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDW198	15/04/2025	U	mxn	840,000,000	840,000,000	840,000,000	
SDW399	06/05/2026	U	mxn	125,000,000	125,000,000	125,000,000	
SDW614	26/02/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDW643	26/02/2026	U	mxn	230,000,000	230,000,000	230,000,000	
SDW961	16/02/2026	U	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SDX024	23/04/2026	U	mxn	320,000,000	320,000,000	320,000,000	
SDX126	17/01/2025	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDX242	14/08/2023	U	mxn	550,000,000	550,000,000	550,000,000	
SEC521	06/07/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SED137	08/07/2025	U	mxn	555,000,000	555,000,000	555,000,000	
SFU800	18/01/2024	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SHB078	30/07/2024	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDT491	24/04/2026	U	mxn	240,000,000	240,000,000	240,000,000	
SDT698	11/07/2025	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDT704	13/12/2039	U	mxn	70,000,000	70,000,000	70,000,000	
SDU164	08/06/2026	U	mxn	190,000,000	190,000,000	190,000,000	
SDU635	09/02/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV492	12/06/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV576	08/10/2024	U	mxn	170,000,000	170,000,000	170,000,000	
SDV784	16/04/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDV898	04/06/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV977	25/02/2026	U	mxn	140,000,000	140,000,000	140,000,000	
SDW179	16/08/2024	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDW411	31/12/2024	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDW552	10/06/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDX096	16/02/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SEG804	04/08/2025	U	mxn	170,000,000	170,000,000	170,000,000	
SEQ030	31/08/2023	U	mxn	525,000,000	525,000,000	525,000,000	
SES941	15/09/2031	U	mxn	135,000,000	135,000,000	135,000,000	
SEY077	26/10/2023	U	mxn	325,000,000	325,000,000	325,000,000	
SGR072	21/05/2024	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SGV993	16/06/2023	U	mxn	1,900,000,000	1,900,000,000	1,900,000,000	
SHC078	07/08/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDT442	10/03/2026	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDT462	20/03/2026	U	mxn	220,000,000	220,000,000	220,000,000	
SDU073	18/04/2024	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SDU300	14/04/2026	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDU459	14/04/2026	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDU625	23/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU667	30/04/2031	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SDU887	14/04/2026	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDV528	26/01/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SDV715	17/01/2024	U	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SDW347	30/12/2024	U	mxn	530,000,000	530,000,000	530,000,000	
SDX218	15/05/2026	U	mxn	230,000,000	230,000,000	230,000,000	
SDX269	25/02/2026	U	mxn	140,000,000	140,000,000	140,000,000	
SED706	11/07/2025	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SEW266	03/10/2031	U	mxn	145,000,000	145,000,000	145,000,000	
SEY380	27/10/2023	U	mxn	325,000,000	325,000,000	325,000,000	
SFV096	12/01/2029	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SGK280	08/04/2024	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SHB075	01/08/2023	U	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	1,500,000,000	
SHB921	04/08/2023	U	mxn	1,270,000,000	1,270,000,000	1,270,000,000	
SHD596	16/08/2024	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SDS765	07/03/2031	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SDT192	25/03/2026	U	mxn	145,000,000	145,000,000	145,000,000	
SDT702	04/04/2031	U	mxn	80,000,000	80,000,000	80,000,000	
SDU148	23/04/2025	U	mxn	165,000,000	165,000,000	165,000,000	
SDU183	18/02/2026	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SDU642	30/04/2031	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV059	18/05/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDV365	20/02/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDV479	05/05/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDV681	03/06/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW646	14/03/2025	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDW717	17/04/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX018	27/02/2026	U	mxn	115,000,000	115,000,000	115,000,000	
SDX313	17/03/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SGQ942	20/05/2024	U	mxn	550,000,000	550,000,000	550,000,000	
SHB086	30/07/2024	U	mxn	600,000,000	600,000,000	600,000,000	
SDS420	10/03/2026	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDT157	24/12/2025	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDT482	06/04/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU066	18/02/2026	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SDU341	31/12/2025	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDX200	05/12/2025	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDT518	15/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT552	23/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT589	15/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT806	24/09/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT983	08/08/2025	U	mxn	105,000,000	105,000,000	105,000,000	
SDU215	17/04/2031	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU258	24/09/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU361	03/12/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU687	19/02/2026	U	mxn	90,000,000	90,000,000	90,000,000	
SDU743	19/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDU923	15/04/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV330	05/06/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV421	05/05/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV435	03/06/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV469	23/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV488	10/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV621	10/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV816	11/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV996	11/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW210	15/05/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW305	12/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW308	09/06/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW455	14/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW507	02/06/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX116	16/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SES958	15/09/2031	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SEZ146	23/10/2031	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SFS008	25/12/2024	U	mxn	155,000,000	155,000,000	155,000,000	
SFW493	15/01/2032	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SFW775	15/01/2032	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SFZ913	14/02/2029	U	mxn	72,500,000	72,500,000	72,500,000	
SFZ971	17/02/2027	U	mxn	245,000,000	245,000,000	245,000,000	
SGE427	12/03/2027	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SGE736	09/03/2032	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SGH412	28/03/2024	U	mxn	325,000,000	325,000,000	325,000,000	
SGR067	20/05/2025	U	mxn	380,000,000	380,000,000	380,000,000	
SGV964	14/06/2024	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SGW257	07/06/2032	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SGW259	15/06/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SGY959	14/07/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGZ429	16/07/2024	U	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SHH994	22/09/2027	U	mxn	187,500,000	187,500,000	187,500,000	
SHN845	05/11/2025	U	mxn	340,000,000	340,000,000	340,000,000	
SDR998	20/11/2025	U	mxn	240,000,000	240,000,000	240,000,000	
SDS028	20/11/2028	U	mxn	210,000,000	210,000,000	210,000,000	
SDS201	08/09/2026	U	mxn	90,000,000	90,000,000	90,000,000	
SDS365	02/05/2030	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDT269	21/12/2026	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDT426	31/03/2031	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDV541	03/06/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW433	24/11/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW948	28/11/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SES975	15/09/2031	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SEV626	29/09/2031	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SEV627	29/09/2031	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SFZ910	17/02/2027	U	mxn	96,000,000	96,000,000	96,000,000	
SGH414	26/03/2026	U	mxn	175,000,000	175,000,000	175,000,000	
SGO621	30/04/2029	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SGP645	10/05/2027	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SGQ708	11/05/2029	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SGR171	12/05/2032	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SGV005	31/05/2032	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SGW917	10/06/2032	U	mxn	60,000,000	60,000,000	60,000,000	
SHB217	21/07/2032	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SHB923	01/08/2025	U	mxn	190,000,000	190,000,000	190,000,000	
SHC836	24/04/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHF958	03/09/2025	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SHH012	11/09/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SHH993	22/09/2027	U	mxn	273,437,500	273,437,500	273,437,500	
SHI506	26/09/2023	U	mxn	640,000,000	640,000,000	640,000,000	
SHL837	03/07/2023	U	mxn	700,000,000	700,000,000	700,000,000	
SHM745	27/10/2025	U	mxn	190,000,000	190,000,000	190,000,000	
SHN861	29/10/2027	U	mxn	174,860,636	174,860,636	174,860,636	
SHP671	19/11/2025	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SHP673	20/11/2024	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SHP675	20/11/2024	U	mxn	370,000,000	370,000,000	370,000,000	
SHQ221	25/11/2025	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SHR046	05/06/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDR923	29/10/2028	U	mxn	142,500,000	142,500,000	142,500,000	
SDR932	01/11/2028	U	mxn	90,000,000	90,000,000	90,000,000	
SDT379	15/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU431	04/01/2024	U	mxn	260,000,000	260,000,000	260,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDV063	08/10/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV727	03/06/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW857	27/11/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX185	10/07/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SGO548	26/04/2032	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SGS011	23/05/2025	U	mxn	350,000,000	350,000,000	350,000,000	
SGV164	07/06/2027	U	mxn	80,000,000	80,000,000	80,000,000	
SGV608	12/06/2024	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SGZ966	09/07/2032	U	mxn	60,000,000	60,000,000	60,000,000	
SHC983	03/08/2032	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SHD503	06/08/2032	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SHN017	29/10/2026	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SHQ572	27/11/2025	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SHQ688	01/09/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGE429	12/03/2027	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SGE739	16/03/2027	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SGQ154	12/05/2027	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SHE465	18/08/2027	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SDS025	20/11/2028	U	mxn	210,000,000	210,000,000	210,000,000	
SDS932	16/03/2029	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SDU327	25/12/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU372	31/12/2026	U	mxn	230,000,000	230,000,000	230,000,000	
SDV661	13/01/2027	U	mxn	155,000,000	155,000,000	155,000,000	
SDW710	14/08/2025	U	mxn	105,000,000	105,000,000	105,000,000	
SDW870	21/05/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SFS009	24/12/2025	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SGH181	26/03/2026	U	mxn	250,000,000	250,000,000	250,000,000	
SGR524	23/05/2024	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SGW904	15/06/2029	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SHB224	12/04/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHB924	31/07/2026	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SHC061	02/08/2027	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SHC585	20/04/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDT828	07/04/2031	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDU026	07/11/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU099	07/11/2025	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDU414	22/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU694	26/09/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV437	25/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV483	09/09/2025	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDV701	07/05/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV758	16/04/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV793	23/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV885	23/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW155	28/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW180	11/04/2028	U	mxn	214,000,000	214,000,000	214,000,000	
SDW843	21/05/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW846	22/04/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW963	15/06/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX127	05/11/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX129	01/12/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX141	01/12/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX193	05/12/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX206	05/12/2025	U	mxn	105,000,000	105,000,000	105,000,000	
SDX293	17/12/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX350	17/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SFS690	31/12/2024	U	mxn	150,000,000	150,000,000	150,000,000	
SFX177	27/01/2025	U	mxn	155,000,000	155,000,000	155,000,000	
SGN284	16/04/2032	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SGZ754	20/07/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHB157	29/07/2025	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SHB453	31/07/2025	U	mxn	300,000,000	300,000,000	300,000,000	
SHF725	02/09/2024	U	mxn	400,000,000	400,000,000	400,000,000	
SHI505	23/09/2025	U	mxn	430,000,000	430,000,000	430,000,000	
SDS418	10/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDS502	24/10/2030	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDS913	19/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT343	06/04/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT756	25/12/2029	U	mxn	105,000,000	105,000,000	105,000,000	
SDT799	08/04/2026	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDT953	07/11/2025	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDU145	24/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDV230	15/04/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV299	26/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV430	10/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV676	26/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV719	16/04/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW119	15/07/2025	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SDW154	06/04/2026	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDW209	09/06/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW520	20/04/2026	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDW822	30/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW863	27/02/2026	U	mxn	115,000,000	115,000,000	115,000,000	
SDX308	17/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SEJ335	04/08/2026	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SFX771	23/01/2032	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SGW493	09/06/2032	U	mxn	155,000,000	155,000,000	155,000,000	
SDS811	10/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT364	20/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT440	25/12/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT958	16/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV583	06/05/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV709	26/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDV933	13/01/2027	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDW410	12/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW576	25/11/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDX296	29/08/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SEG805	31/07/2028	U	mxn	105,000,000	105,000,000	105,000,000	
SEW019	08/10/2026	U	mxn	120,000,000	120,000,000	120,000,000	
SGA283	13/02/2032	U	mxn	130,000,000	130,000,000	130,000,000	
SGD190	20/12/2028	U	mxn	420,000,000	420,000,000	420,000,000	
SGZ001	14/07/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHA848	01/09/2026	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	
SHB226	12/04/2023	U	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHB926	02/08/2024	U	mxn	275,000,000	275,000,000	275,000,000	
SHE675	28/08/2023	U	mxn	1,150,000,000	1,150,000,000	1,150,000,000	
SDT149	19/03/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT291	24/12/2025	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT617	24/04/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDT993	16/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU082	16/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU255	16/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDU615	19/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW434	12/02/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW918	23/09/2025	U	mxn	110,000,000	110,000,000	110,000,000	
SDX167	30/06/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SDW319	29/01/2026	U	mxn	100,000,000	100,000,000	100,000,000	
SHB922	01/08/2025	U	mxn	460,000,000	460,000,000	460,000,000	
SDV260	30/01/2023	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SDV277	30/01/2023	U	mxn	50,000,000	50,000,000	50,000,000	
SEQ997	13/09/2024	U	mxn	90,000,000	90,000,000	90,000,000	
SEQ998	13/09/2024	U	mxn	90,000,000	90,000,000	90,000,000	
MPM737	13/09/2024	U	mxn	90,000,000		90,000,000	
SER004	13/09/2024	U	mxn	90,000,000	90,000,000	90,000,000	
P18240	01/08/2025	U	mxn	4,000,000,000			4,000,000,000
SHC370	01/08/2025	U	mxn	4,000,000,000	4,000,000,000	4,000,000,000	
SHC372	01/08/2025	U	mxn	4,000,000,000	4,000,000,000	4,000,000,000	
P18241	01/08/2025	U	mxn	4,000,000,000			4,000,000,000
SGS033	31/05/2023	U	mxn	7,750,181	7,750,181	7,750,181	
SHI102	16/08/2024	U	mxn	47,256,016	47,256,016	47,256,016	
E82994	10/02/2023	U	mxn	7,080,000			7,080,000
E82995	10/02/2023	U	mxn	7,080,000			7,080,000
E81376	05/06/2023	U	mxn	40,585,000			40,585,000
SDV304	05/04/2023	U	mxn	8,349,108	8,349,108	8,349,108	
SDV268	05/04/2023	U	mxn	8,349,108	8,349,108	8,349,108	
C67358	01/10/2024	U	mxn/usd		93,650,000	5,000,000	
C67364	01/10/2024	U	usd/mxn		5,000,000	93,650,000	
SGX708	15/11/2024	U	mxn	4,757,990	4,757,990	4,757,990	
SHZ897	30/01/2035	U	mxn	49,000,000	49,000,000	49,000,000	
SHZ896	30/01/2035	U	mxn	49,000,000	49,000,000	49,000,000	
SDU378	08/10/2025	U	mxn	1,194,749,924	1,194,749,924	1,194,749,924	
SDT950	28/06/2024	U	mxn	62,948,402	62,948,402	62,948,402	
SDV159	15/06/2023	U	mxn	147,500,000	147,500,000	147,500,000	
SDV164	28/06/2023	U	mxn	119,429,828	119,429,828	119,429,828	

Trade ID	Maturity Date	Status	Currency	Notional	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
MGK327	21/01/2026	U	usd	10,000,000		10,000,000	
MGK326	21/01/2026	U	usd	15,000,000		15,000,000	
MGP875	21/01/2026	U	usd	25,000,000		25,000,000	
MGP904	21/01/2026	U	usd	10,000,000		10,000,000	
P17270	05/08/2025	U	mxn	200,000,000			200,000,000
P17199	05/08/2025	U	mxn	250,000,000			250,000,000
P17271	05/08/2025	U	mxn	200,000,000			200,000,000
P17198	05/08/2025	U	mxn	250,000,000			250,000,000
C83387	11/09/2025	U	usd/eur		18,300,000	16,424,340	
C83388	11/09/2025	U	eur/usd		16,424,340	18,300,000	
SHO222	11/09/2025	U	usd	5,490,000	5,490,000	5,490,000	
SHO223	11/09/2025	U	usd	5,490,000	5,490,000	5,490,000	
C72547	10/10/2024	U	mxn/eur		50,000,000	2,343,567	
C72549	10/10/2024	U	eur/mxn		2,343,567	50,000,000	
C72550	10/10/2024	U	eur/mxn		4,703,116	100,000,000	
C72548	10/10/2024	U	mxn/eur		100,000,000	4,703,116	
E83553	21/12/2023	U	mxn	13,740,000			13,740,000
E83554	21/12/2023	U	mxn	13,740,000			13,740,000
SEO659	15/08/2028	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SEO661	15/08/2028	U	mxn	200,000,000	200,000,000	200,000,000	
SDS657	03/11/2027	U	mxn	500,000,000	500,000,000	500,000,000	

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertuta o Negociación	Nocional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores dados en garantía
				VP Trim Anterior	VP Trim Actual	VP Trim Anterior	VP Trim Actual	0 A 1 AÑO	1 A 5 AÑOS	5 A 10 AÑOS	
Forwards	NEGO	3,198,004,799	Compra	Divisas	Divisas	116,808,619,802	113,552,303,250	3,162,924,437	35,080,361	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	3,385,957,467	Venta	Divisas	Divisas	(116,581,458,142)	(113,005,840,164)	3,350,836,429	35,121,038	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	916,898,000	Compra	Acción	Acción	58,405,399	100,689,423	407,540,000	509,358,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	406,932,000	Venta	Acción	Acción	(52,945,984)	(92,950,634)	407,540,000	(608,000)	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	8,608,874,244	Compra	Divisas	Divisas	134,993,415	254,861,958	8,372,588,047	236,286,197	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	8,338,572,744	Venta	Divisas	Divisas	(127,098,631)	(239,612,713)	8,102,286,547	236,286,197	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	4,103,520,000	Compra	Índice	Índice	147,668,967	168,961,369	-	4,103,520,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	668,330,000	Venta	Índice	Índice	-	(60,215,902)	-	668,330,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	46,795,920,873	Compra	Tasas	Tasas	1,309,831,443	1,267,993,544	3,014,252,158	39,503,668,876	4,277,999,840	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	45,914,265,288	Venta	Tasas	Tasas	(1,276,082,749)	(1,231,596,259)	3,014,252,158	38,804,974,435	4,095,038,695	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	291,958,000	Compra	Acción NE	Acción NE	7,226,177	6,384,725	-	291,958,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	291,958,000	Venta	Acción NE	Acción NE	(12,685,592)	(14,123,515)	-	291,958,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Índice NE	Índice NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,431,680,000	Venta	Índice NE	Índice NE	(147,667,784)	(108,742,524)	-	3,431,680,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	212,564,297	Compra	Divisas NE	Divisas NE	6,585,369	2,167,879	-	212,564,297	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	212,564,297	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(14,480,153)	(5,140,918)	-	212,564,297	-	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	8,791,547,098	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	590,517,483	531,848,216	-	5,938,960,882	2,852,586,216	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	4,159,400,498	CCIRS / IRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	447,476	40,421,980	3,604,020,000	395,299,625	160,080,873	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	57,895,387,744	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	1,483,043,756	1,441,654,264	-	34,369,966,691	23,525,421,052	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	3,839,980,000	CCIRS	Reuters_SOFR / LIBOR USD	TASA DE INTERES / LIBOR USD	47,278,617	371,532,306	3,839,980,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	122,135,000	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	366,472,527	258,516,236	-	122,135,000	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	40,382,227,751	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	1,136,216,353	956,130,747	1,129,784,384	19,999,207,418	19,253,235,949	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	320,664,769,366	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	13,175,007,985	9,162,380,757	79,950,000,000	136,704,933,014	104,009,836,352	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	45,102,490,684	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	(1,122,572,783)	(373,653,908)	251,430,323	27,054,300,633	17,796,759,729	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	317,125,399,587	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	(13,593,278,754)	(10,055,512,968)	73,267,789,677	132,045,454,201	111,812,155,708	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2023**

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 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
100000000000			**A C T I V O**	776,395,925,051	653,468,290,457
100200001001			**Efectivo y equivalentes de efectivo**	51,507,767,675	37,448,103,681
100400001001			**Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)**	1,091,283,713	864,460,162
100600001001			**INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS**	150,346,991,020	112,914,725,777
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	70,602,283,110	50,976,294,268
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	74,980,216,410	56,771,376,624
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	4,764,491,500	5,167,054,885
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	4,764,991,360	5,167,889,566
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-499,860	-834,681
101000001001			**Deudores por reporto**	4,849,434,616	3,201,385,046
101200001001			**PRÉSTAMO DE VALORES**	0	0
101400001001			**Instrumentos financieros derivados**	41,589,339,958	30,073,155,725
	101400102001		Con fines de negociación	32,944,570,688	24,105,235,410
	101400102002		Con fines de cobertura	8,644,769,270	5,967,920,315
101600001001			**AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS**	-1,111,571,160	-937,661,502
	101800104001		**Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1**	466,847,532,177	422,779,913,604
	101800105001		Créditos comerciales	244,569,360,108	221,646,880,480
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	214,038,666,700	184,618,558,462
		101800107002	Entidades financieras	16,097,110,295	17,720,180,638
		101800107003	Entidades gubernamentales	14,433,583,113	19,308,141,380
	101800105002		Créditos de consumo	32,373,683,089	33,599,697,020
	101800105003		Créditos a la vivienda	189,904,488,980	167,533,336,104
		101800507023	Media y residencial	184,554,112,059	161,489,772,381
		101800507024	De interés social	4,512,352	5,120,157
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	5,345,864,569	6,038,443,566
		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**	5,723,212,541	3,568,859,202
	101800205005		Créditos comerciales	2,020,777,850	785,416,488
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	2,020,777,850	656,084,361
		101800506008	Entidades financieras	0	0
		101800506009	Entidades gubernamentales	0	129,332,127
	101800205006		Créditos de consumo	668,304,760	550,069,612
	101800205007		Créditos a la vivienda	3,034,129,931	2,233,373,102
		101800706018	Media y residencial	2,870,865,593	2,126,115,400
		101800706019	De interés social	245,972	0
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	163,018,366	107,257,702
		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**	18,550,019,776	16,180,234,150
	101800305008		Créditos comerciales	9,425,209,753	7,800,459,884
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	9,333,730,228	7,753,003,413
		101800806024	Entidades financieras	91,479,525	47,456,471
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	0
	101800305009		Créditos de consumo	822,993,643	1,034,520,246
	101800305010		Créditos a la vivienda	8,301,816,380	7,345,254,020
		101801006034	Media y residencial	7,955,314,107	7,148,975,991
		101801006035	De interés social	10,054,940	12,027,777
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	336,447,333	184,250,252
		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: **2023**

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 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
		101801306051	De interés social	0	0
		101801306052	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	0	0
		101801306053	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801306054	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	131800103001		Cartera de crédito	491,120,764,494	442,529,006,956
	131800103002		Partidas diferidas	2,765,374,289	0
	101800103003		**ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS**	-16,278,114,668	-15,598,582,344
	131800102001		**Cartera de crédito (neto)**	477,608,024,115	426,930,424,612
	131800102002		**Derechos de cobro adquiridos (neto)**	0	0
131800001001			**Total de cartera de crédito (neto)**	477,608,024,115	426,930,424,612
102000001001			**Activos virtuales**	0	0
102200001001			**BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN**	0	0
132400001001			**Otras cuentas por cobrar (neto)**	29,121,295,260	20,319,653,270
132600001001			**Bienes adjudicados (neto)**	374,006,615	168,636,069
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	13,941,494	16,533,054
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	2,766,192,239	5,340,109,523
133400001001			**Propiedades, mobiliario y equipo (neto)**	4,710,228,767	4,233,354,033
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,676,635,045	2,696,170,440
103800001001			**INVERSIONES PERMANENTES**	53,440,841	52,541,968
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	6,229,166,229	5,615,389,323
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,569,748,624	4,531,309,276
134400001001			Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	0	0
104600001001			Crédito mercantil	0	0
200000000000			**P A S I V O**	700,959,991,188	582,876,946,100
200200001001			**CAPTACIÓN TRADICIONAL**	485,730,744,303	429,019,245,108
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	229,911,357,721	216,843,243,062
	200200102002		Depósitos a plazo	249,544,535,307	189,619,109,942
		200200203003	Del público en general	205,914,353,474	187,317,054,285
		200200203004	Mercado de dinero	43,630,181,833	2,302,055,657
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	5,047,070,765	21,676,002,060
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	1,227,780,510	880,890,044
200400001001			**PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS**	35,734,004,661	41,936,461,019
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	21,509,318,184	17,391,724,184
	200400102003		De largo plazo	14,224,686,477	24,544,736,835
230600001001			**VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR**	7,743,275,172	0
200800001001			**ACREEDORES POR REPORTO**	68,421,085,319	36,205,041,089
201000001001			**PRÉSTAMO DE VALORES**	105,395	0
201200001001			**COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA**	8,525,558,270	1,797,567,498
	201200102001		Reportos	4,001,642,802	1,674,400,131
	201200102002		Préstamo de valores	4,523,915,468	123,167,367
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			**Instrumentos financieros derivados**	38,505,188,154	27,833,221,137
	201400102001		Con fines de negociación	32,244,837,033	23,877,181,722
	201400102002		Con fines de cobertura	6,260,351,121	3,956,039,415
201600001001			**AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS**	1,123,738	6,382,253
201800001001			**OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN**	0	0
202000001001			**Pasivo por arrendamiento**	2,773,430,069	2,781,445,358
202200001001			**Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal**	0	0
202400001001			**OTRAS CUENTAS POR PAGAR**	35,928,530,497	25,976,421,905
	202400102001		Acreedores por liquidación de operaciones	17,717,834,132	10,228,378,852
	202400102002		Acreedores por cuentas de margen	1,863,018,457	1,503,490,068
	202400102003		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	4,666,072,125	3,005,845,347
	202400102004		Contribuciones por pagar	391,441,137	372,364,036
	202400102005		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	11,290,164,646	10,866,343,602
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: **2023**

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 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
203000001001			Instrumentos financieros que califican como pasivo	9,099,006,104	9,096,341,472
	203000102001		**OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN**	9,099,006,104	9,096,341,472
	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**	1,081,544,366	1,057,274,951
203600001001			**Pasivo por beneficios a los empleados**	6,339,877,598	5,625,250,922
203800001001			**Créditos diferidos y cobros anticipados**	1,076,517,542	1,542,293,388
400000000000			**CAPITAL CONTABLE**	75,435,933,863	70,591,344,357
440200001001			**Participación controladora**	75,434,651,399	70,590,197,922
	400200102001		**CAPITAL CONTRIBUIDO**	13,468,335,561	11,575,052,037
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	9,207,023,304
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	1,250,665,369
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	2,716,852,485	1,036,846,090
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	80,517,274
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		**CAPITAL GANADO**	61,966,315,838	59,015,145,885
		400200203010	Reservas de capital	7,839,163,707	6,897,399,203
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	162,317,294
		400200203012	Resultados acumulados	53,943,045,102	51,509,679,758
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	50,947,569,992	48,060,825,191
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	2,995,475,110	3,448,854,567
	400200203013		Otros resultados integrales	23,808,852	445,749,630
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-304,729,802	-159,935,114
		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	809,620,138	736,689,615
		400201304009	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0
		400201304010	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304011	Incremento por actualización de Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304012	Remedición de beneficios definidos a los empleados	-481,081,484	-131,004,871
		400201304013	Incremento por actualización de la remedición de beneficios definidos a los empleados	0	0
		400201304014	Efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304015	Incremento por actualización del efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304016	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
		400201304017	Incremento por actualización del resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	400200203014		Participación en ORI de otras entidades	-2,019,117	0
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			**PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA**	1,282,464	1,146,435
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	42,648	27,800
	440400102002		Otra participación no controladora	1,239,816	1,118,635
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			**CUENTAS DE ORDEN**	3,090,332,561,411	2,793,447,662,738
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	248,799,478,552	257,149,238,372
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	455,304,964,996	429,401,125,522
	700800102001		Fideicomisos	426,175,877,586	400,291,661,487
	700800102002		Mandatos	29,129,087,410	29,109,464,035
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	642,746,918,663	587,042,527,795
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	14,524,572,339	12,986,321,779
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	8,524,595,680	1,674,169,048
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,389,137,703	1,064,620,138
702000001001			Otras cuentas de registro	1,719,042,893,478	1,504,129,660,084

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB** TRIMESTRE: **01** AÑO: **2023**

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 2023 Y 2022

(PESOS)

Impresión Final

		TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	18,391,747,947	12,029,762,169
600400101002	Gastos por intereses	11,732,736,178	6,045,331,020
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	**MARGEN FINANCIERO**	6,659,011,769	5,984,431,149
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	145,206,617	-1,430,264,670
330000000002	**MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS**	6,513,805,152	7,414,695,819
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	1,308,161,498	1,193,889,808
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	108,810,030	191,585,576
501400301007	Resultado por intermediación	563,125,126	378,921,266
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	281,702,617	134,795,672
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	4,433,543,511	4,473,929,502
330000000003	**RESULTADO DE LA OPERACIÓN**	4,124,440,852	4,456,787,487
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	79,155,487	299,040
330000000004	**RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD**	4,203,596,339	4,457,086,527
602400501012	Impuestos a la utilidad	1,208,078,581	1,008,204,160
330000000005	**RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS**	2,995,517,758	3,448,882,367
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	**RESULTADO NETO**	2,995,517,758	3,448,882,367
502800701014	Otros Resultados Integrales	10,298,922	304,804,028
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	51,681,257	-48,897,221
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	-42,368,782	357,398,839
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remedición de beneficios definidos a los empleados	986,447	-3,697,590
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	84,956	0
330000000007	**RESULTADO INTEGRAL**	3,005,901,636	3,753,686,395
543200601016	**Resultado neto atribuible a:**	2,995,517,758	3,448,882,367
543201602158	Participación controladora	2,995,475,110	3,448,854,567
543201602159	Participación no controladora	42,648	27,800
543400701017	**Resultado integral atribuible a:**	3,005,901,636	3,753,686,395
543401702160	Participación controladora	3,005,901,636	3,753,686,395
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: **2023**

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 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

(PESOS) **Impresión Final**

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
		Actividades de operación		
851000102001		**Resultado antes de impuestos a la utilidad**	4,203,596,339	4,457,086,527
851000102002		**Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:**	-461,239,294	-1,738,950,519
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	265,605,529	245,750,153
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	197,799,817	155,487,128
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	9,522,231	-32,759,575
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-79,155,487	-299,040
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	-855,011,384	-2,107,129,185
	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	463,781,986	-5,984,431,149
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	0	594,819,073
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	463,781,986	239,817,000
	851000303003	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000303004	Otros intereses	0	-6,819,067,222
851000102004		**Cambios en partidas de operación**	-12,866,353,569	-22,035,095,501
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	-13,783,940,869	-6,471,083,850
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	1,116,609,669	1,533,185,808
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	-20,449,253,774	10,596,454,928
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	-1,624,941,608	8,615,880,585
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-1,259,047,006	-5,711,438,691
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	3,504,463,499	-4,461,598,458
	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)	-13,690,038,482	-8,542,793,555
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-89,073,858	-39,876,478
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	-369,333,545	-1,846,930,429
	851000403014	Cambio en captación tradicional	265,090,503	-13,155,804,135
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	12,660,179,719	-19,810,255,981
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	44,499	-37,122
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	4,560,233,845	-960,089,744
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	1,673,222,505	4,814,456,388
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	42,091,189	42,091,189
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	-14,544,366	454,377,757
	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	706,005,475	1,298,611,295
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	15,272,612,355	13,175,886,075
	851000403024	Cambio en otras provisiones	0	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-1,386,733,319	-1,566,131,083
851000001001		**Flujos netos de efectivo de actividades de operación**	-8,660,214,538	-25,301,390,642
		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	-57,655,359	-79,581,576
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
	851000202005	Pagos por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202006	Cobros por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202007	Pagos por adquisición de subsidiarias	0	-4,992
	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	78,670,629	0
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-179,665,382	-97,347,163
	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: **2023**

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 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

(PESOS) **Impresión Final**

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
	851000202016	Otros cobros por actividades de inversión	0	0
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	**Flujos netos de efectivo de actividades de inversión**	-158,650,112	-176,933,731
		Actividades de financiamiento		
	851000302001	Cobros por la obtención de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302002	Pagos de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	-594,819,073
	851000302003	Pagos de pasivo por arrendamiento	-240,563,490	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	-2,849,994,662	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	-463,781,986	-239,817,000
	851000302012	Pagos por intereses por pasivo por arrendamiento	0	-5,400,402
	851000302013	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302014	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302015	Otros cobros por actividades de financiamiento	0	12,058,983,027
	851000302016	Otros pagos por actividades de financiamiento	0	-5,234,515,403
851000001003		**Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento**	-3,554,340,138	5,984,431,149
	851000000000	**Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo**	-12,373,204,788	-19,493,893,224
	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**	63,880,972,463	56,941,996,905
	100200001001	**Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo**	51,507,767,675	37,448,103,681

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **01** AÑO: **2023**

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 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado									Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remediciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversion	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Participación en ORI de otras entidades			
Saldo al inicio del periodo	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	8,001,481,001	53,797,569,992	-356,411,059	851,988,920	0	-482,067,931	0	0	-2,104,073	75,278,792,411	1,239,816	75,280,032,227
Ajustes retrospectivos por cambios contables	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Ajustes retrospectivos por correcciones de errores	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Saldo ajustado	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	8,001,481,001	53,797,569,992	-356,411,059	851,988,920	0	-482,067,931	0	0	-2,104,073	75,278,792,411	1,239,816	75,280,032,227
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	-2,850,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	-2,850,000,000
Capitalización de otros conceptos del capital contable	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cambios en la participación controladora que no implican pérdida de control	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	-2,850,000,000
MOVIMIENTOS DE RESERVAS																
Reservas de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
RESULTADO INTEGRAL																
Resultado neto	0	0	0	0	0	2,995,475,110	0	0	0	0	0	0	0	2,995,475,110	42,648	2,995,517,758
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	51,681,257	-42,368,782	0	986,447	0	0	0	10,298,922	0	10,298,922
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	51,681,257	0	0	0	0	0	0	51,681,257	0	51,681,257
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	-42,368,782	0	0	0	0	0	-42,368,782	0	-42,368,782
Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remedición de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	986,447	0	0	0	986,447	0	986,447
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	84,956	84,956	0	84,956
Total	0	0	0	0	0	2,995,475,110	51,681,257	-42,368,782	0	986,447	0	0	84,956	3,005,858,988	42,648	3,005,901,636
Saldo al final del periodo	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	8,001,481,001	53,943,045,102	-304,729,802	809,620,138	0	-481,081,484	0	0	-2,019,117	75,434,651,399	1,282,464	75,435,933,863

Información Financiera

SCOTIABANK INVERLAT

Indicadores Financieros

Scotiabank-Indicadores Financieros T2 2022T3 2022T4 2022T1 2023
ROE
(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)15.7%15.1%10.1%
15.9%
ROA
(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)1.7%1.6%1.0%1.6%
MIN
(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos
productivos promedio)3.6%3.5%2.8%3.7%
Eficiencia Operativa
(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total
promedio)2.3%2.3%2.4%2.3%
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)3.6%3.8%3.7%3.8%
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.)95.2%85.8%
90.6%87.8%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito20.70%20.99%19.78%21.011).
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales
(crédito, mercado y operacional)16.50%16.41%15.50%16.121).
Liquidez
(Activos líquidos / Pasivos líquidos)42.5%40.6%45.5%44.0%
Sujeto a aprobación de Banco Central

Los resultados alcanzados dan una utilidad neta acumulada después de impuestos al cierre del primer trimestre de $2,995 millones, una disminución anual de 13%; debido principalmente al efecto en reservas crediticias producto de la implementación de IFRS 9 durante el primer trimestre de 2022, compensados parcialmente por Inversiones en instrumentos financieros en intermediación, así como un mayor margen financiero.

La utilidad neta mostró un incremento de $1,075 millones o 56% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a menores requerimientos de reservas crediticias; compensados parcialmente con mayores impuestos a la utilidad.

3 meses
Scotiabank- Información Financiera
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar

202231 dic
202231 mar
2023A/A
Δ%
Ingresos por intereses 12,030 16,950 18,39253%
Gastos por intereses(6,045)(10,211)(11,733)-94%
Margen Financiero 5,985 6,739 6,65911%
Comisiones 1,002 1,197 1,19920%
Resultado por Intermediación 379 333 56349%
Otros ingresos/egresos de la operación 135 274 282> +100%
Ingresos no Financieros 1,516 1,804 2,04435%
Total Ingresos 7,501 8,543 8,70316%
Gastos de Administración y Promoción(4,474)(4,310)(4,434)1%
PTPP1). 3,027 4,233 4,26941%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios 1,430 (2,006)(145)> -100%
Resultado de la Operación 4,457 2,227 4,124-7%
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora - - 790%
Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 4,457 2,227 4,203-6%
Impuestos a la Utilidad(1,008)(307)(1,208)-20%
Resultado Neto 3,449 1,920 2,995-13%
Otros Resultados Integrales
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender(49) 238 52> +100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo 357 (137)(42)> -100%
Remedición de beneficios definidos a los empleados(4)(366)1> +100%
Participación en ORI de otras entidades - (2)-0%
Resultado Integral 3,753 1,653 3,006-20%
PTPP: “Pre-Tax, Pre-Provision”, resultado antes de impuestos y reservas.

Margen Financiero

El margen financiero fue de $6,659 millones al cierre del primer trimestre de 2023, un incremento de $674 millones u 11% respecto al mismo trimestre del año anterior impulsado por mayores volúmenes de hipotecas y cartera comercial.

Al cierre del primer trimestre el margen financiero se ubicó $80 millones o 1% por debajo del trimestre anterior; debido a que los ingresos por intereses subieron $1,442 millones mientras que los gastos por intereses se incrementaron en $1,522 millones. El cambio de mezcla favoreció a la cartera hipotecaria y comercial. Por su parte, la participación de depósitos a plazo aumentó; así como los depósitos de exigibilidad inmediata.

Ingresos no Financieros

3 meses
Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202231 dic
202231 mar
2023A/A
Δ%
Aceptaciones por Cuenta de Terceros--10%

Actividades Fiduciarias655460-8%
Apertura de Cuenta46650%
Cartas de Crédito sin Refinanciamiento57827532%
Cheques Certificados1110%
Cheques de caja-1-0%
Manejo de Cuenta8386830%
Operaciones de Crédito3914874002%
Otras Comisiones y Tarifas33040149550%
Servicios de Banca Electrónica44505116%
Transferencia de Fondos2729270%
Total de Comisiones y Tarifas (netas)1,0021,1971,19920%

3 meses
Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202231 dic
202231 mar
2023A/A
Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas(14)2035> +100%
Aportaciones al IPAB(502)(521)(533)-6%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo832535-58%
Donativos-(11)-0%
Estimación por Pérdida de Valor de Bienes Adjudicados(4)(8)(7)-75%
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito-52-0%
Ingresos por Arrendamiento7233-96%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados29454659%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación851639762-10%
Quebrantos(405)(34)(72)82%
Recuperaciones311--1%
Resultado en Venta de Bienes Adjudicados222213-41%
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo-1-0%
Utilidad por venta de cartera de crédito-30-0%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación135274282> +100%

El total de ingresos no financieros fue de $2,044 millones en el primer trimestre de 2023, un incremento de $528 millones o 35% respecto al mismo trimestre del año anterior, debido a mayores comisiones y tarifas (netas) principalmente por colocación de créditos, así como mayores ingresos por intermediación y por Otros Ingresos/Egresos de la Operación. Los ingresos por intermediación se vieron impactados por mayores resultados de inversiones en instrumentos financieros en el trimestre y menores ingresos por cambios y derivados.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron un incremento de $240 millones o 13%, debido principalmente a mejores resultados por intermediación en instrumentos financieros y en derivados.

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

3 meses
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202231 dic
202231 mar
2023A/A
Δ%
Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios1,430(2,006)(145)> -100%

En el primer trimestre de 2023, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en $145 millones, un incrementó de $1,575 millones respecto al mismo periodo del año anterior; debido a la implementación de IFRS 9, durante el primer trimestre de 2022.

Por el contrario, respecto al trimestre anterior, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra una disminución de $1,861 millones o 93% debido principalmente a menores requerimientos de la cartera total (comercial y tarjeta de crédito), así como de reservas adicionales.

Gastos de Administración y Promoción

3 meses
Gastos de Administración y Promoción
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202231 dic
202231 mar
2023A/A
Δ%
Gastos de Personal(2,402)(1,555)(2,367)1%
Gastos de Operación(2,072)(2,755)(2,067)0%
Total de Gastos de Administración y Promoción(4,474)(4,310)(4,434)1%

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en $4,434 millones en el primer trimestre, una disminución de $40 millones o 1% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a una disminución en gastos de personal.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, incrementaron $124 millones o 3%. principalmente por el ajuste estacional del monto de PTU durante el primer trimestre de cada año y menores gastos generales.

Impuestos a la Utilidad

3 meses
Scotiabank-Impuestos
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202231 dic
202231 mar
2023A/A
Δ%
Impuesto a la Utilidad Causado(622)(682)(962)-55%
Impuesto a la Utilidad Diferido(386)375(246)36%
Total de Impuestos a la Utilidad(1,008)(307)(1,208)-20%

En el primer trimestre, se registró un impuesto neto a cargo de $1,208 millones, un incremento de $200 millones o 20% respecto al mismo trimestre del año anterior, debido a una menor inflación en el trimestre.

Respecto al trimestre inmediato anterior, el impuesto incremento $901 millones, originado principalmente por una mayor utilidad en el periodo.

Balance General

3 meses
Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202231 dic
202231 mar
2023A/A
Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores183,564231,456248,27335%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2426,349476,776472,57111%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 316,18018,54118,55015%
Partidas diferidas-2,7462,7650%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(15,599)(16,805)(16,278)-4%
Otros Activos42,97437,36650,51518%
Total Activo653,468750,080776,39619%
Depósitos429,019485,466485,73113%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos41,93649,51835,734-15%
Obligaciones Subordinadas en Circulación9,0969,0579,0990%
Otros Pasivos102,826130,759170,39666%
Capital70,59175,28075,4367%
Total Pasivo y Capital653,468750,080776,39619%

Al 31 de marzo de 2023, el total de activos de Scotiabank se ubicó en $776,396 millones, un incremento de $122,928 millones o 19% respecto al cierre de marzo de 2022. El incremento anual se debió a mayores volúmenes de cartera de crédito, inversiones en instrumentos financieros de valores gubernamentales (negociables y por cobrar o vender), efectivo y equivalentes de efectivo principalmente en depósitos en Banxico; así como mayores volúmenes en instrumentos financieros derivados.

Los activos totales incrementaron $26,316 millones o 4% respecto al cierre del trimestre anterior, debido principalmente a mayores volúmenes en inversiones en instrumentos financieros de valores gubernamentales (negociables y por cobrar o vender) y deudores por liquidación de operaciones en otros; compensados parcialmente por menores volúmenes en efectivo y equivalentes en préstamos interbancarios call money y depósitos en otras entidades financieras.

El total del pasivo registró $700,960 millones al 31 de marzo, un incremento de $118,083 millones o 20% respecto al año pasado. Este incremento fue resultado principalmente de mayores volúmenes en depósitos, así como acreedores por reporto, instrumentos financieros derivados y valores asignados por liquidar (en otros).

Respecto al cierre del trimestre anterior, el pasivo total incrementó $26,160 millones o 4%, debido principalmente a mayores volúmenes en acreedores por reporto y liquidación de operaciones, instrumentos financieros derivados y colaterales vendidos o dados en garantía (en otros); compensados en parte por menores volúmenes de préstamos bancarios

y de otros organismos.

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
202231 dic
202231 mar
2023A/A
%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales34,15033,25933,042-3%
Créditos a la Vivienda169,766189,071192,93914%
Total Préstamos de Menudeo203,916222,330225,98111%
Actividad Empresarial o Comercial185,275221,292216,06017%
Entidades Financieras17,72017,42616,097-9%
Entidades Gubernamentales19,43815,72814,433-26%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales222,433254,446246,59011%
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2426,349476,776472,57111%

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales etapa 1 y 2 al 31 de marzo de 2023 se ubicó en $246,590 millones, un incremento de $24,157 millones u 11% respecto al año pasado y una disminución de $7,856 o 3% respecto al trimestre anterior. El incremento anual se dio principalmente por mayores créditos de actividad empresarial o comercial. La disminución trimestral se debió a menores créditos de actividad empresarial o comercial; entidades financieras y gubernamentales.

La cartera de préstamos de menudeo etapa 1 y 2 al 31 de marzo de 2023 alcanzó $225,981 millones, un incremento anual de $22,065 millones y $3,651 millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado por mayores créditos a la vivienda.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

3 meses
Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202231 dic
202231 mar
2023A/A
Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 316,18018,54118,55015%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(15,599)(16,805)(16,278)-4%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta5811,7362,272> +100%
Índice de morosidad3.66%3.74%3.78%12pb

Al 31 de marzo de 2023 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó $18,550 millones, un incremento anual de $2,370 millones o 15% y un incremento trimestral de $9 millones.

En esta misma fecha, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en $16,278 millones, un incremento anual de $679 millones o 4% y una disminución de $527 millones o 3% respecto del trimestre anterior. La estimación preventiva para riesgos crediticios representa el 3.3% de la cartera total, una disminución de 21pb respecto al año anterior y de 8pb respecto al trimestre anterior.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 87.8% al 31 de marzo de 2023, una disminución de 800pb respecto del año anterior y de 300pb respecto del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 31 de marzo de 2023 fue de 3.8%, un incremento de 12pb respecto del año anterior y 3pb respecto al trimestre pasado.

Depósitos

3 meses
Scotiabank – Depósitos
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar
202231 dic
202231 mar
2023A/A
Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro216,843231,775229,9116%
Público en General187,317209,629205,91510%
Mercado de Dinero2,30231,23843,630> +100%
Total Depósitos a Plazo189,619240,867249,54532%
Títulos de Crédito Emitidos21,67611,8455,047-77%
Cuenta global de captación sin movimientos8819791,22839%
Total de Depósitos429,019485,466485,73113%

El total de depósitos registró $485,731 millones al 31 de marzo de 2023, un incremento anual de $56,712 millones o 13%, debido principalmente a mayores depósitos a plazo por $59,926 millones o 32%.

El total de depósitos se muestra sin cambios significativos respecto al trimestre anterior, con un incremento de $265 millones.

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023 valor razonable)

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Instrumentos financieros negociables	68,852	1,556	14	180	70,602
Sin restricción:	-	-	13	-	13
Restringidos:	68,852	1,556	1	180	70,589
En operaciones de reporto	55,464	1,556	-	180	57,200
Préstamos de valores	4,793	-	-	-	4,793
Otros	8,595	-	1	-	8,596
Instrumentos financieros para cobrar o vender	51,940	21,433	-	1,607	74,980
Sin restricción:	36,070	21,433	-	1,607	59,110
Restringidos:	15,870	-	-	-	15,870
En operaciones de reporto	15,383	-	-	-	15,383
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	487	-	-	-	487
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	4,765	-	-	-	4,765
Sin restricción	4,765	-	-	-	4,765
Total	125,557	22,989	14	1,787	150,347

Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)
EmisorTítulosTasaPlazoImporte
I-BANSAN-2315514,964,608,04611.15%1414,900

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023 valor razonable)
Con fines de:Contratos AdelantadosFuturosOpcionesOperaciones EstructuradasSwapsPaquetes de Instrumentos DerivadosTotal activoTotal Pasivo
PosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosición
ActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasiva
Negociación4,5954,051--1,7181,54626123026,37026,418--32,94432,245
Cobertura--------8,6456,260--8,6456,260

Scotiabank-Montos nocionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de marzo de 2023)
Con fines de:Contratos AdelantadosFuturosOperaciones EstructuradasOpcionesSwapsPaquetes de Instrumentos Derivados
PosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosición
ActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasiva
Con fines de negociación
Posición USD3,1963,384----------
Posición EUR11----------
Posición CHF----------
Posición GBP11----------
Posición CAD----------
Divisas USD----1212474459----
Divisas EUR----------
Divisas MXN------5959----
Acciones MXN----292292917407----
Índices MXN-----3,4324,104668----
Tasa de interés
Pesos------32,70431,839330,400329,209--
Dólares------7827812,8202,951--
Euros----------
Pesos Colombianos--------177,500---
Con fines de cobertura
Tasa de interés
Pesos--------57,8953,550--
Dólares--------482477--
Euros----------

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)PesosDólaresUdisTotal
Actividad empresarial o comercial168,675 45,364 - 214,039
Créditos a entidades financieras16,046 51 - 16,097
Créditos a entidades gubernamentales10,823 3,610 - 14,433
Créditos al consumo32,374 - - 32,374
Créditos a la vivienda189,834 16 55 189,905
Total417,752 49,041 55 466,848

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)PesosDólaresUdisTotal
Actividad empresarial o comercial417,752 49,041 55 466,848
Créditos al consumo668 - - 668
Créditos a la vivienda3,028 1 5 3,034
Total5,717 1 5 5,723

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)PesosDólaresUdisTotal
Actividad empresarial o comercial7,760 1,574 - 9,334
Créditos a entidades financieras91 - - 91
Créditos al consumo823 - - 823
Créditos a la vivienda8,261 34 7 8,302
Total16,935 1,608 7 18,550

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)
Saldo al 31 de diciembre de 202218,541
Reestructuras75
Recuperaciones(398)
Castigos y quitas(582)
Traspasos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 31,048
Fluctuación Tipo Cambio(134)
Saldo al 31 de marzo de 202318,550

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)
Saldo al 31 de diciembre de 202216,805
Más: Creación de reservas27
Calificación184
Menos: Adjudicaciones y otros15
Castigos y quitas587
Comercial33
Hipotecario116
Consumo438
Desliz cambiario 136
Saldo al 31 de marzo de 202316,278

Scotiabank-Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)
No. Acreditados / GruposMonto% Capital Básico
110,29315.09%
28,10211.88%
37,57511.10%
Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos 25,970

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito31 mar

202231 dic
202231 mar
2023
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2
Metropolitano56.1%62.2%63.8%
Noroeste – Centro12.1%10.7%10.5%
Norte15.7%13.7%13.2%
Bajío9.7%7.9%7.3%
Sur6.4%5.5%5.2%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3
Metropolitano40.5%41.5%51.0%
Noroeste – Centro18.0%19.6%16.3%
Norte8.1%7.3%6.1%
Bajío17.0%15.7%13.0%
Sur16.3%15.9%13.6%

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)

Grado de Riesgo
Importe Cartera CrediticiaReservas Preventivas Necesarias
Cartera ComercialConsumoCartera de ViviendaTotal Reservas Preventivas
No revolventesTarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes
Exceptuada calificada
Riesgo A1 417,341 907 99 453 303 1,762
Riesgo A2 61,512 624 29 196 13 862
Riesgo B1 12,170 153 38 55 14 260
Riesgo B2 6,868 26 49 32 53 160
Riesgo B3 5,422 77 20 36 46 179
Riesgo C1 3,352 56 30 66 50 202
Riesgo C2 3,424 83 28 94 199 404
Riesgo D 7,290 624 49 262 1,247 2,182
Riesgo E 11,765 6,142 617 286 1,742 8,787
Total 529,144 8,692 959 1,480 3,667 14,798
Exceso1,480
Reservas Constituidas 16,278

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 2023.

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	$ 3
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	23
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos	6
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	1,448
Total	$ 1,480

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 2023 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses” son:

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)

Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	1,661 01-jul-27
BV 270701	6	01-jul-27
Total	11,209,692	1,661

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)

	ISR	PTU
Provisión por perdidas de crédito	4,883	1,104
Compensación diferida	(1,195)	(268)
Ingresos diferidos	522	113
Instalaciones y equipos / depreciación	774	176
Beneficios a los empleados	986	222
Provisiones	904	162
Otros	(645)	(47)
Efecto Neto en Diferido	6,229	1,462

Al 31 de marzo de 2023, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)

Vencimiento	Préstamos Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos
Pesos					
Inmediato	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	7,187	3,162	-
Largo	-	-	9,500	4,592	-
Total	-	-	16,687	7,754	-
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	12.59%	10.73%	0.00%
Otros					
Inmediato	-	-	-	-	-
Mediano	8,651	-	17	666	1,826
Largo	-	-	-	133	-
Total	8,651	-	17	799	1,826
Tasa Promedio	5.35%	0.00%	6.12%	5.23%	5.83%
Total Préstamos Interbancarios	8,651	-	16,704	8,553	1,826

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 2023.

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

Captación Tradicional	31 mar 2023	31 dic 2022	31 mar 2022
Depósitos a la Vista	53.4%	49.1%	48.1%
Metropolitano	21.8%	22.3%	21.5%
Noroeste – Centro	11.4%	9.1%	9.0%
Norte	8.3%	7.0%	6.7%
Bajío	6.1%	5.2%	5.1%
Sur	5.8%	5.5%	5.8%
Depósitos Ventanilla	46.0%	44.3%	42.8%
Metropolitano	18.7%	21.4%	19.9%
Noroeste - Centro	6.9%	4.8%	4.4%
Norte	9.2%	8.6%	7.6%
Bajío	5.6%	5.1%	5.3%
Sur	5.6%	4.4%	5.6%
Total de Captación del Público	99.4%	93.4%	90.9%
Fondeo Profesional	0.6%	6.6%	9.1%

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional

Tasa Promedio (millones de pesos al 31 de marzo de 2023)	Pesos	Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	4.71%	2.11%	-
Depósitos a plazo	9.73%	0.00%	-

Scotiabank-Resultados por Intermediación
(millones de pesos)31 mar
2023
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable 377
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros(4)
Resultado por valuación de divisas(604)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados423
Resultado por compraventa de divisas373
Costos de transacción(2)
Total 563

Emisión de Certificados Bursátiles

Al cierre de marzo de 2023, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

Clave de PizarraQuinta1).
SCOTIAB 13-2
Monto de la Emisión$1,150 millones
Fecha de Emisión y Colocación28 junio
2013
Plazo de Vigencia de la Emisión3,640 días, 20 períodos
182 días, aprox.
10 años
GarantíaQuirografaria
Tasa de interés7.30% Fijo
Pago de InteresesCada 182 días durante la vigencia de la emisión
Calificaciones otorgadas Fitch/S&PAAA(mex) /”mxAAA”
Amortización del principalUn sólo pago al vencimiento
Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

Emisión de Obligaciones Subordinadas

(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)
Fecha InicioFecha VencimientoISINPlazo Importe ($)Tasa (%)
18-diciembre-1405-diciembre-24MX0QSC1N00163,6402,093,000,0007.4
28-junio-1809-junio-33MX0QSC1N00245,4603,360,000,00012.3
11-septiembre-18PerpetuaMX0QSC1N0032-3,455,000,00011.3
Total de Obligaciones Subordinadas8,908,000,000

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

ClaveNúmero de títulosFecha de EmisiónVencimientoPlazo
(días)SubyacenteMonto
99-SCOTIAB 07-207,299,30014-may-2012-may-231,093SPXSRT5E INDEX 729,930,000

99-SCOTIAB 08-20402,35011-jun-2009-jun-231,093SPXSRT5E INDEX 40,235,000
99-SCOTIAB 04-21120,00024-mar-2108-mar-241,080Large-Cap ETF (FXI) 10,200,000
99-SCOTIAB 05-214,854,60029-abr-2126-abr-241,093Index (IDBTVER) 485,460,000
99-SCOTIAB 06-21572,30003-jun-2131-may-241,093Index (IDBTVER) 57,230,000
99-SCOTIAB 08-21802,90012-ago-2110-ago-23728Index (IDBTVER) 80,290,000
99-SCOTIAB 09-213,940,20025-nov-2122-nov-241,093Index (BNPIUIL5) 394,020,000
99-SCOTIAB 10-213,841,30025-nov-2122-nov-241,093Index (BNPIUIL5) 384,130,000
99-SCOTIAB 11-211,105,53007-dic-2101-jun-23541MSCI ETF (EZU) 110,553,000
99-SCOTIAB 01-22543,20028-feb-2225-feb-251,093MSFDVTHY Index 54,320,000
99-SCOTIAB 02-22512,60028-feb-2227-feb-24729Invesco QQQ Series 1 51,260,000
99-SCOTIAB 03-22369,75008-mar-2205-sep-23546iShares MSCI China ETF 36,975,000
99_SCOTIAB_04-22571,50012-may-2210-nov-23547SPDR Gold Shares (GLD) 57,150,000
99_SCOTIAB_05-221,255,86015-jun-2213-jun-251,094MSCI USA IMI (ENHAAGE5) 125,586,000
99_SCOTIAB_06-221,826,50015-jun-2213-jun-251,094MSCI USA IMI (ENHAAGE5) 182,650,000
99_SCOTIAB_07-22793,54016-jun-2213-jun-251,093MSCI USA IMI (ENHAFOO5) 79,354,000
99_SCOTIAB_08-221,027,15016-jun-2213-jun-251,093MSCI USA IMI (ENHAFOO5) 102,715,000
99_SCOTIAB_09-22495,00023-jun-2222-dic-23547Dólar - Peso (USDMXN) 49,500,000
99_SCOTIAB_10-22720,10030-jun-2229-dic-23547Dólar - Peso (USDMXN) 72,010,000
99_SCOTIAB_11-225,791,75017-nov-2214-nov-251,093US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5) 579,175,000
99_SCOTIAB_12-22457,55018-nov-2214-nov-251,092US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5) 45,755,000
99_SCOTIAB_13-22104,50023-nov-2221-nov-251,094US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5) 10,450,000
99_SCOTIAB_14-22803,80019-dic-2217-dic-251,094US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5) 80,380,000
99_SCOTIAB_1-23120,20003-mar-2303-sep-24550iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM) 12,020,000
Total Bonos Bancarios al 31 de marzo de 20233,831,348,000

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 2023)
ReferenciaCapital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservasMonto
1Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente 13,468
2Resultados de ejercicios anteriores 50,948
3Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 11,021
4Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1
(solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones) No aplica
5Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros
(monto permitido en el capital común de nivel 1) No aplica
6Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios 75,437
Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios
7Ajustes por valuación prudencial No aplica
8Crédito mercantil
(neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -
9Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -
10
conservadorImpuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la

utilidad diferidos a cargo) 1,466
11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo -
12Reservas pendientes de constituir -
13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización -
14Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable No aplica
15Plan de pensiones por beneficios definidos -
16
conservadorInversiones en acciones propias -
17
conservadorInversiones recíprocas en el capital ordinario -
18
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) -
19
conservadorInversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) -
20
conservadorDerechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%) -
21Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo) -
22Monto que excede el umbral del 15% No aplica
23 del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras No aplica
24 del cual: Derechos de servicios hipotecarios No aplica
25 del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales No aplica
26Ajustes regulatorios nacionales 8,669
A del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) -
B del cual: Inversiones en deuda subordinada -
C del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras) -
D del cual: Inversiones en organismos multilaterales -
E del cual: Inversiones en empresas relacionadas -
F del cual: Inversiones en capital de riesgo -
G del cual: Inversiones en sociedades de inversión -
H del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia -
I del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones -
J del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados 8,187
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 482
27Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deduciones -
28Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1 10,135
29Capital común de nivel 1 (CET1) 65,301
Capital adicional de nivel 1: instrumentos
30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1,

más su prima 3,482
31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables 3,482
32 de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables No aplica
33Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1 -
34Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1) No aplica
35 del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual No aplica
36Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios 3,482
Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios
37
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1 No aplica
38
conservadorInversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1 No aplica
39
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde las Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) No aplica
40
conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido No aplica
41Ajustes regulatorios nacionales -
42Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones No aplica
43Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1 -
44Capital adicional de nivel 1 (AT1) 3,482
45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) 68,783
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas
46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima 3,903
47Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2 -
48Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2) No aplica
49 de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual No aplica
50
conservadorReservas 1,436
51Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios 5,339
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios
52
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2 No aplica
53
conservadorInversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2 No aplica
54

conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) No aplica
55
conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido No aplica
56Ajustes regulatorios nacionales -
57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2 -
58Capital de nivel 2 (T2) 5,339
59Capital total (TC = T1 + T2) 74,122
60Activos ponderados por riesgo totales 459,745
Razones de capital y suplementos
61Capital Común de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)14.20%
62Capital de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)14.96%
63Capital Total
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.12%
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)17.30%
65 del cual: Suplemento de conservación de capital2.50%
66 del cual: Suplemento contracíclico bancario específico0.00%
67 del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)0.60%
68Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)7.20%
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)
69Razón mínima nacional de CET1
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica
70Razón mínima nacional de T1
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica
71Razón mínima nacional de TC
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica
Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)
72Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras No aplica
73Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras No aplica
74Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo) No aplica
75Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -
Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2
76Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite) 1,436
77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada 4,139
78Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite) -
79Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de

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

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

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

13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

14No aplica.

15Inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos que corresponden a los recursos a los que la Institución no tiene acceso irrestricto e ilimitado. Estas inversiones se considerarán netas de los pasivos del plan y de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo que correspondan que no hayan sido aplicados en algún otro ajuste regulatorio.

16*El monto de la inversión en cualquier acción propia que:
la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido.

17*Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.

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

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

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

34No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
35No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
36Suma de los renglones 30, 33 y 34.
37 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
38 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
39 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
40 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
41Ajustes nacionales considerados:
Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
42No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
43Suma de los renglones 37 a 42.
44Renglón 36, menos el renglón 43.
45Renglón 29, más el renglón 44.
46El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental ni en el Capital Básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
47Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
48No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
50Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.
51Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.
52 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
54 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
55 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
56Ajustes nacionales considerados:
Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
57Suma de los renglones 52 a 56.
58Renglón 51, menos renglón 57.
59Renglón 45, más renglón 58.
60Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.
61Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
62Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
63Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
64Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61, 65, 66 y 67.

65Reportar 2.5%
66Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción
III, del Artículo 2 Bis 5.
67La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
68Renglón 61 menos 7%.
69No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
70No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
71No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
72No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
73No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
74No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
75El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.
76Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
771.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
78Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
790.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
80No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
81No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
82Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
83Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.
84Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
85Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)

Referencias de los rubros del balance generalRubros del Balance GeneralMonto presentado en el balance general
Activo
BG1Efectivo y equivalentes de efectivo 53,597
BG2Cuentas de Margen 1,081
BG3Inversiones en instrumentos financieros 150,347
BG4Deudores por reporto 4,847
BG5Préstamo de valores -
BG6Instrumentos financieros derivados 41,589
BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros(1,111)
BG8Total de cartera de crédito (neto) 477,608
BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización -
BG10Otras cuentas por cobrar (neto) 28,795
BG11Bienes adjudicados (neto) 374
BG12Inmuebles, mobiliario y equipo (neto) 2,354
BG13Inversiones permanentes 3,791
BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta 14
BG15Impuestos a la utilidad diferidos (neto) 6,205
BG16Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) 2,794
Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto) 2,010
Activos Intangibles (neto) 4,570
Pasivo
BG17Captación tradicional 485,799
BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos 35,734
Valores Asignados por liquidar 7,743
BG19Acreedores por reporto 72,573
BG20Préstamo de valores -
BG21Colaterales vendidos o dados en garantía 8,526
BG22Instrumentos financieros derivados 38,505
BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros 1
BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización -
BG25Otras cuentas por pagar 34,894
BG26Obligaciones subordinadas en circulación -
BG27Pasivo por Impuestos a la Utilidad 1,061
BG28Créditos diferidos y cobros anticipados 1,077
Pasivos por arrendamiento 2,119
Instrumentos Financieros que califican como pasivo 9,099
Pasivos por Beneficio a los Empleados 6,300
Capital contable
BG29Capital contribuido 13,468
BG30Capital ganado 61,966
Cuentas de orden
BG31Avales otorgados -
BG32Activos y pasivos contingentes -
BG33Compromisos crediticios 248,799
BG34Bienes en fideicomisos o mandato 455,305
BG35Agente financiero del gobierno federal -
BG36Bienes en custodia o en administración 72,728
BG37Colaterales recibidos por la entidad 14,522
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad 8,525
BG39Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto) -
BG40Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida 1,389
BG41Otras cuentas de registro 1,718,968

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 2023)
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 1,466 BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) $1,466
4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización13 -
5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado15 -
6Inversiones en acciones de la propia institución16 -
7Inversiones recíprocas en el capital ordinario17 -
8Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido18 -
9Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido18
10Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido19 -
11Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido19
12Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales21 -
13Reservas reconocidas como capital complementario50 1,436 BG 8 Total de cartera de crédito (neto) $1,436
14Inversiones en deuda subordinada26-B -
15Inversiones en organismos multilaterales26-D -
16Inversiones en empresas relacionadas26-E -
17Inversiones en capital de riesgo26-F -
18Inversiones en sociedades de inversión26-G -
19Financiamiento para la adquisición de acciones propias26-H -
20Cargos diferidos y pagos anticipados26-J 8,187 BG 16 Activos Intangibles $4,570 más Gastos de Instalación $3,617
21Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)26-L -
22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos26-N -
23Inversiones en cámara de compensación26-P 482 BG 13 Inversiones Permanentes $ 482
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 3,482 BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,482
30Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental33 -
31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S46 3,903 BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,903

complementario47 -
33Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados26-J -
CAPITAL CONTABLE
34Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q1 13,468 BG 29 Capital Social $10,671 más Prima en Venta de Acciones $2,797
35Resultado de ejercicios anteriores2 50,948 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores $50,948
36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable3 810 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo $810
37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores3 10,211 BG 30 Reservas de Capital $8,001 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta ($304) más Remedición por beneficios definidos a los empleados ($481) más Resultado Neto $2,995
38Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R31 -
39Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S46 -
40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable3, 11 -
41Efecto acumulado por conversión3, 26-A -
42Resultado por tenencia de activos no monetarios3, 26-A -
CUENTAS DE ORDEN
43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas26 - K -
CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL
44Reservas pendientes de constituir12 -
45Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)26-C -
46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I -
47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M -
48Derogado

Scotiabank-Nota a los Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto
IdentificadorDescripción
1Crédito mercantil.
2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.
3Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales.
4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.
5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado.
6Cualquier acción propia que la Institución adquiera de conformidad con lo previsto en la Ley, que no hayan sido restadas; considerando aquellos montos adquiridos a través de las inversiones en índices de valores y el monto correspondiente a las inversiones en sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18
7Inversiones en acciones de sociedades distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) de la fracción I del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas, considerando aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18.
8Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.
9Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los

Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.
10Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.
11Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.
12Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales.
13Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
14Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
15Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
16Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
17Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
18Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
19Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de estas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
20Cargos diferidos y pagos anticipados.
21La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos que tengan ser deducidas de acuerdo con el Artículo 2 Bis 8 de las presentes disposiciones.
23Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.
24Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al crédito mercantil.
25Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a otros intangibles (distintos al crédito mercantil).
26Pasivos del plan de pensiones por beneficios definidos asociados a inversiones del

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

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)
Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgoImporte de posiciones equivalentesRequerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal 55,251 4,420
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable 1,054 84
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA´s 3,143 251
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General - -

Posiciones en UDI's, UMA´s o con rendimiento referido al INPC 74 6
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General - -
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal 2,721 218
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio 2,359 189
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones 64 5
Posiciones en Mercancía - -
Requerimiento de capital por impacto Gamma - -
Requerimiento de capital por impacto Vega 44 4
Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo
Grupo I-A (ponderados al 0%) - -
Grupo I-A (ponderados al 10%) - -
Grupo I-A (ponderados al 20%) - -
Grupo I-B (ponderados al 2%) 23 2
Grupo I-B (ponderados al 4%) - -
Grupo II (ponderados al 0%) - -
Grupo II (ponderados al 10%) - -
Grupo II (ponderados al 20%) - -
Grupo II (ponderados al 50%) - -
Grupo II (ponderados al 100%) - -
Grupo II (ponderados al 120%) - -
Grupo II (ponderados al 150%) - -
Grupo III (ponderados al 2.5%) - -
Grupo III (ponderados al 10%) 935 75
Grupo III (ponderados al 11.5%) - -
Grupo III (ponderados al 20%) 4,184 335
Grupo III (ponderados al 25%) 1 0
Grupo III (ponderados al 50%) 353 28
Grupo III (ponderados al 57.5%) - -
Grupo III (ponderados al 100%) 274 22
Grupo III (ponderados al 115%) - -
Grupo III (ponderados al 120%) - -
Grupo III (ponderados al 138%) - -
Grupo III (ponderados al 150%) - -
Grupo III (ponderados al 172.5%) - -
Grupo IV (ponderados al 0%) - -
Grupo IV (ponderados al 20%) 2,410 193
Grupo V (ponderados al 10%) - -
Grupo V (ponderados al 20%) 156 12
Grupo V (ponderados al 50%) - -
Grupo V (ponderados al 115%) - -
Grupo V (ponderados al 150%) 12 1
Grupo VI (ponderados al 20%) 2,692 215
Grupo VI (ponderados al 25%) 1,878 150
Grupo VI (ponderados al 30%) 7,380 590
Grupo VI (ponderados al 40%) 8,008 641
Grupo VI (ponderados al 50%) 37,606 3,008
Grupo VI (ponderados al 70%) 34 3
Grupo VI (ponderados al 75%) 21,375 1,710
Grupo VI (ponderados al 85%) 3,705 296
Grupo VI (ponderados al 100%) 56,639 4,531
Grupo VI (ponderados al 120%) - -
Grupo VI (ponderados al 150%) - -
Grupo VI (ponderados al 172.5%) - -
Grupo VII_A (ponderados al 10%) 154 12

Grupo VII_A (ponderados al 11.5%) - -
Grupo VII_A (ponderados al 20%) 19,012 1,521
Grupo VII_A (ponderados al 23%) 12 1
Grupo VII_A (ponderados al 25%) - -
Grupo VII_A (ponderados al 50%) 11,004 880
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%) - -
Grupo VII_A (ponderados al 100%) 130,669 10,454
Grupo VII_A (ponderados al 115%) - -
Grupo VII_A (ponderados al 120%) 71 6
Grupo VII_A (ponderados al 138%) - -
Grupo VII_A (ponderados al 150%) 1,655 132
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%) 448 36
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%) 6,879 550
Grupo VIII (ponderados al 150%) 3,311 265
Grupo IX (ponderados al 100%) 29,799 2,384
Grupo IX (ponderados al 115%) - -
Grupo X (ponderados al 1250%) - -
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 36 3
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%) - -
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%) - -
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%) - -
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 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 2,004 160
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación 19 2
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega 11 1

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional
Método empleadoActivos ponderados por riesgoRequerimiento de capital
Indicador de Negocio 42,291 3,383

Categoría Capitalización

Al 31 de marzo del 2023, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 12.73% (Índice regulatorio más suplemento de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local más Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales), por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de

las Disposiciones.

Scotiabank-Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio
ReferenciaCaracterísticasOpciones
1EmisorScotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2Identificador ISIN, CUSIP o BloombergN.A.
3Marco legalLey de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
Tratamiento regulatorio
4Nivel de capital con transitoriedadN.A.
5Nivel de capital sin transitoriedadFundamental
6Nivel del instrumentoInstitución de crédito sin consolidar subsidiarias
7Tipo de InstrumentoAcción series "F" y "B"
8Monto reconocido en el capital regulatorio13,468,335,561
9Valor nominal del instrumentoUn Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A Moneda del instrumentoPesos mexicanos
10Clasificación contableCapital
11Fecha de emisión13-ene-01
12Plazo del instrumentoPerpetuidad
13Fecha de vencimientoSin vencimiento
14Cláusula de pago anticipadoNo
15Primera fecha de pago anticipadoN.A.
15A Eventos regulatorios o fiscalesNo
15B Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipadoN.A.
16Fechas subsecuentes de pago anticipadoN.A.
Rendimientos / dividendos
17Tipo de rendimiento / dividendoFijo o Variable
18Tasa de Interés /DividendoLa política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19Cláusula de cancelación de dividendosSujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20Discrecionalidad en el pago Parcialmente discrecional.
21Cláusula de aumento de interesesNo
22Rendimientos / dividendosNo Acumulable
23Convertibilidad del instrumentoN.A.
24Condiciones de convertibilidadN.A.
25Grado de convertibilidadN.A.
26Tasa de conversiónN.A.
27Tipo de convertibilidad del instrumentoN.A.
28Tipo de instrumento financiero de la convertibilidadN.A.
29Emisor del instrumento Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.
30Cláusula de disminución de valor (Write-Down)No
31Condiciones para disminución de valorN.A.
32Grado de baja de valorN.A.
33Temporalidad de la baja de valorN.A.
34Mecanismos de disminución de valor temporalN.A.
35Posición de subordinación en caso de liquidaciónLos títulos de las acciones están sujetos a las disposiciones que en su caso emite la Secretaría de Hacienda y Crédito Público y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, así como lo que al efecto dispongan los Estatutos Sociales.
36Características de incumplimientoNO

37Descripción de características de incumplimientoNO

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

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

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

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

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto
(millones de pesos al 31 de marzo de 2023)
ReferenciaRubroMar-231).
1Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones 7,638
1aNo aplica
2Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo 459,745
3Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)1.63%
3aNo aplica

4Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones814,737
5Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)0.94%
5aNo aplica
6aComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?No
6b"Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?No

6cEn el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?0%
El Banco al considerarse una institución de Importancia Sistémica Local debe de constituir el suplemento al capital neto en un plazo de cuatro años:
Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

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

Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos
Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en 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 2023 fue de $23.75 millones y su promedio durante el primer trimestre de 2023 fue de $15.64 millones mismo que corresponde a un 0.021% del capital neto ($74,675 millones a febrero 2023, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del primer trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesosCierre
Marzo 2023Promedio
Factor de Riesgo
Tasas de interés
Derivados955,409882,957
Mercado de Dinero 58,32057,589
Tipo de cambio
Cash5,9027,469
Derivados157,947175,950
Capitales
Derivados13,86616,776

VaR 1 día (millones de pesos)Cierre
Marzo 2023Promedio
Factor de Riesgo
Tasas de interés15.4913.86
Tipo de cambio18.215.88
Capitales--
VaR Global23.7515.64

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 2023 muestra una pérdida máxima de $315.7. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, México 1994 por el denominado "Error de diciembre" y México 1997 por el efecto de la "crisis del rublo" y la crisis financiera asiática.
Asimismo, mensualmente se realizan pruebas de "backtesting" para comparar las pérdidas y ganancias teóricas y reales con el valor en riesgo observado y, en consecuencia, en su caso calibrar los modelos utilizados. El nivel de eficiencia del modelo se basa en el enfoque establecido por el BIS. Respecto de las pruebas de backtesting, durante el primer trimestre de 2023, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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

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

El Banco asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que el Banco pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles, para lo cual el Banco aplica controles a las brechas de liquidez, monitorea

indicadores clave de liquidez, mantiene fuentes diversificadas de fondeo, establece límites y mantiene un porcentaje mínimo de activos líquidos.

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de marzo 2023 así como el promedio del primer trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US17,54632,749
Liquidity Buffer
(bajo métrica CCL)89,51289,364

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

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el primer trimestre de 2023 de 133% y 108% respectivamente.

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

Para la medición del riesgo de tasas de interés se emplean indicadores tales como sensibilidad del valor económico y sensibilidad de margen. Para el cálculo de dichos indicadores se utilizan brechas de reprecio, construidas con base en las tasas de referencia de activos y pasivos; para el caso de posiciones a tasa fija son modeladas acorde a sus amortizaciones y vencimientos contractuales, mientras que aquellas posiciones referenciadas a una tasa flotante se modelan en función a su próxima fecha de reprecio. La metodología para el cálculo de los indicadores considera supuestos de estabilidad de depósitos de exigibilidad inmediata y de prepago de hipotecas. El primero consiste en un análisis de cosechas a fin de evaluar la permanencia de los depósitos mientras que el segundo considera un análisis histórico para estimar una tasa de prepago aplicable al portafolio de créditos.

Tanto la sensibilidad del valor económico como de la sensibilidad de margen contemplan

un impacto de ± 100 puntos base en las tasas de interés y considera la máxima pérdida esperada por escenario. Esta medición se realiza de manera semanal y se reporta a los miembros del Comité de Activos y Pasivos, al Comité de Riesgos y Consejo de Administración en sus respectivas sesiones.

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

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de marzo 2023 y en promedio para el primer trimestre de 2023 es la siguiente:

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre)Posición
(Promedio)
Valor Económico (+100 pbs) (1,109)(1,126)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)(206)(219)

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

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre)Posición
(Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender1).74,98071,039
Derivados de Cobertura76,43870,696
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 2023 y el promedio del primer trimestre del 2023 fueron $2,760 millones y $3,171 millones, respectivamente.
Riesgo de crédito

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

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

Existen dos niveles de resolución crediticia instituidos: Consejo de Administración y

Facultades Mancomunadas del departamento de Crédito. La distinción entre niveles se da en función del monto de la operación, clasificación de riesgo del acreditado, tipo de acreditado y destino de los recursos.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del primer trimestre corresponde a $41; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.

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

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

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

Al cierre del primer trimestre de 2023, el Banco mantiene $851 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

Información metodológica

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito1).
(Cifras al 31 de marzo 2023)Pérdida EsperadaPérdida no Esperada
Hipotecas0.3%3.3%
Consumo3.7%11.5%
Cartera Comercial0.6%4.0%
Total0.7%4.2%
Excluye cartera en etapa de riesgo 3.y/o en incumplimiento El cálculo incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos inter compañía.

Parámetros de Riesgo1).
(Cifras a millones al 31 de marzo 2023)EI22).PISP
Hipotecas192,9391.63%18.04%
Consumo50,2874.79%72.22%
Cartera Comercial294,2821.68%44.26%
EI (Exposición al Incumplimiento) calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en etapa de riesgo 3 o en incumplimiento. 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 2023.

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 2023 y en promedio durante el tercer trimestre de 2023, 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 0.89% y 0.89% 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 del Indicador de Negocio, mismo que entró en vigor en enero 2023.

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de enero - marzo 2023, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por $48.4 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de marzo 2023 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman $243.9 millones, donde $4.5 millones corresponden a riesgo operacional y $239.4 millones a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

Riesgo Tecnológico

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

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

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

En la sección Estados Financieros Relación con Inversionistas del portal oficial de Scotiabank, se presenta información adicional con la finalidad de dar cumplimiento a la

totalidad de requerimientos establecidos en el artículo 88 de la CUB sobre la revelación de información relativa a los distintos tipos de riesgo gestionados por la Institución.

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)
Periodo Reportado: enero 2023 – marzo 2023 (T1 2023)
Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

(Cifras en millones de pesos)Calculo Individual T1 2023Calculo Consolidado T1 2023
Importe sin ponderar (promedio)Importe ponderado (promedio)Importe sin ponderar (promedio)Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES
1Total de Activos Líquidos Computables No aplica97,051.25 No aplica97,051.25
SALIDAS DE EFECTIVO
2Financiamiento minorista no garantizado171,917.3313,826.38171,917.3313,826.38
3Financiamiento estable99,473.386,581.9899,473.386,581.98
4Financiamiento menos estable72,443.957,244.3972,443.957,244.39
5Financiamiento mayorista no garantizado225,278.6685,860.31225,278.6685,860.31
6Depósitos operacionales94,744.4323,019.8694,744.4323,019.86
7Depósitos no operacionales125,726.6058,032.82125,726.6058,032.82
8Deuda no garantizada4807.6296224807.6296224807.6296224807.629622
9Financiamiento mayorista garantizado No aplica416.6676667 No aplica416.6676667
10Requerimientos adicionales:242,456.6818,415.30242,456.6818,415.30
11Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías7,302.685,319.877,302.685,319.87
12Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda0000
13Líneas de crédito y liquidez235,154.0013,095.42235,154.0013,095.42
14Otras obligaciones de financiamiento contractuales37.1143444437.1143444437.11434444 37.11434444
15Otras obligaciones de financiamiento contingentes2,414.802,414.802,414.802,414.80
16TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO No aplica120,970.57 No aplica120,970.57
ENTRADAS DE EFECTIVO
17Entradas de efectivo por operaciones garantizadas5,183.99351.66567785,183.99 351.6656778
18Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas46,431.0431,887.2446,431.04 31,887.24
19Otras entradas de efectivo15,884.7415,884.7415,884.7415,884.74
20TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO67,499.7748,123.6467,499.7748,123.64
Importe ajustado
21TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLESNo aplica97,051.25No aplica97,051.25
22TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVONo aplica72,846.93No aplica72,846.93
23COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]No aplica133.12No aplica133.12

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 2023, 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 $51,268 millones y

depósitos a plazo tradicionales por $34,199 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por $1,846 millones y $2,760 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por $12,809 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de $17,842 millones y por operaciones de call money de $5,992 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por $17,248 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de $89,512 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; $44,028 millones en títulos de deuda de nivel 1, $36,531 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por $7,627 millones y $1,326 millones en títulos de nivel 2.

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

Promedio de cuarto trimestre 2022: 129% – promedio del primer trimestre 2023: 133% El coeficiente de cobertura de liquidez creció 400 pb respecto del cuarto trimestre del 2022, esto debido principalmente a:
En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron $3,557 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN $12,235 millones.
Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de $697 millones.
Finalmente, fondeo tradicional del banco decreció en $4,969 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en $4, millones.

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

Evolución de Activos Líquidos T1-2023EneroFebreroMarzo
Efectivo 9%9%9%
Reservas en el Banco Central53%37%41%
Nivel 137%53%49%
Nivel 2ª1%1%1%
Nivel 2B0%0%0%
Total de Activos Líquidos Ponderados100%100%100%

La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de FinanciamientoEneroFebreroMarzo
CAPTACION TRADICIONAL
Depósitos de exigibilidad inmediata43%43%46%
Depósitos a plazo
Del público en general41%42%42%
Mercado de dinero7%7%5%
Títulos de crédito emitidos2%2%2%
Cuenta global de captación sin movimientos0%0%0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS
De exigibilidad inmediata0%0%0%

De corto plazo4%3%3%
De largo plazo3%3%2%
Total100%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.

Exposición Potencial Futura (marzo 2023)
(Cifras en millones de pesos)
Con contrato de compensación3,912
Sin contrato de compensación6,935
Posibles llamadas de margen (marzo 2023)
Colateral en Tránsito36
Downgrade (Marzo 2023)
Baja calificación 3 niveles2,760

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de marzo 2023 es la siguiente:

Scotiabank-Exposición en Derivados
(cifras en millones de pesos)Posición Cierre
Factor de Riesgo
Tasas de interés 955,409
Tipo de cambio 157,947
Capitales 13,866
Total1,127,222

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 el primer trimestre del 2023, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -3.54% al cierre de marzo del 2023 y en promedio durante primer trimestre del 2023 fue de -4.26%.

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

I. Información cuantitativa:

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

Dentro de las políticas aprobadas por la institución en términos de liquidez, se encuentra establecido que la institución tendrá una baja dependencia del mercado mayorista, así como, mantener diversificadas las fuentes de fondeo y una baja

concentración de recursos en depositantes específicos. Esta diversificación, no solo se realiza por fuentes de fondeo, sino por plazos y variedad de productos.

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

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

Concentración de Depósitos Límite MM
Concepto
Concentración de Depósitos (MXN)9,000 MXN
Concentración de Depósitos (USD)150 USD

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

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

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

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

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

Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con las siguientes exposiciones a finales de marzo 2023.

Descripción Promedio T1 2023Marzo 2023
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)7,0619,465
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)45,12651,899
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)4241
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)4039
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)4241
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)4039

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 2023 y el promedio del primer trimestre de 2023 son:

Scotiabank (Cierre)	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	17,546	32,749
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	89,512	89,364

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 estás: (i) operaciones de crédito simple garantizado con depósitos de regulación monetaria o depósitos en dólares que el Grupo Financiero mantenga en el Banco de México, o (ii) reportos sobre títulos elegibles. Dicho financiamiento está sujeto al procedimiento que señala la circular 10/2015 de Banxico.

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el primer trimestre de 2023, 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 2023, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)
Periodo Reportado: primer trimestre del 2023
Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

(Cifras en millones de pesos)Cifras IndividualesCifras Consolidadas
Importe sin ponderar por plazo residualImporte ponderadoImporte sin ponderar por plazo residualImporte ponderado
Sin vencimiento< 6 mesesDe 6 meses a < 1 año>1 añoSin vencimiento< 6 mesesDe 6 meses a < 1 año>1 año
1Capital:79,208.280.000.000.0079,208.2879,208.280.000.000.0079,208.28
2Capital fundamental y capital básico no fundamental.79,208.280.000.000.0079,208.28
79,208.280.000.000.0079,208.28
3Otros instrumentos de capital.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
4Depósitos minoristas:0.00205,738.972,178.3621.91191,733.230.00205,738.972,178.3621.91
191,733.23
5Depósitos estables.0.0090,720.04994.4019.0687,147.780.0090,720.04994.4019.0687,147.78
6Depósitos menos estables.0.00115,018.931,183.962.85104,585.450.00115,018.931,183.96
2.85104,585.45
7Financiamiento mayorista:0.00334,474.3633,449.5419,695.17146,741.490.00334,474.36
33,449.5419,695.17146,741.49
8Depósitos operacionales.0.0012,430.970.000.006,215.490.0012,430.970.000.006,215.49
9Otro financiamiento mayorista.0.00322,043.3933,449.5419,695.17140,526.000.00322,043.39
33,449.5419,695.17140,526.00
10Pasivos interdependientes0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
11Otros pasivos: 3,352.7832,939.410.003,866.193,866.193,352.7832,939.410.003,866.19
3,866.19
12Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto
3,352.780.000.000.003,352.780.000.000.00
13Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores. 0.00
32,939.410.003,866.193,866.190.0032,939.410.003,866.193,866.19
14Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible82,561.05573,152.7435,627.90
23,583.26421,549.1882,561.05573,152.7435,627.9023,583.26421,549.18
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO
15Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica5,944.61No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica5,944.61
16Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.0.000.00

0.000.000.000.000.000.000.00
17Préstamos al corriente y valores:0.00119,832.4741,653.61301,540.08335,641.960.00
119,832.4741,653.61301,540.08335,641.96
18Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.0.001,588.620.000.00158.860.001,588.620.000.00158.86
19Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.0.0010,546.883,777.952,218.745,689.750.0010,546.88
3,777.952,218.745,689.75
20Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:0.0089,216.9834,941.15134,212.23169,694.110.0089,216.98
34,941.15134,212.23169,694.11
21Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
22Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:0.003,206.753,376.89187,854.08
150,582.990.003,206.753,376.89187,854.08150,582.99
23Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.0.00420.22442.3824,709.1116,492.220.00420.22
442.3824,709.1116,492.22
24Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).0.0015,693.480.001,964.149,516.260.0015,693.480.00
1,964.149,516.26
25Activos interdependientes.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
26Otros Activos:0.0071,055.46411.805,911.7336,557.920.0071,055.46411.805,911.73
36,557.92
27Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.
0.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.000.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.00
28Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centralesNo Aplica
2,240.760.000.001,904.65No Aplica2,240.760.000.001,904.65
29Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No Aplica0.000.000.00737.74No Aplica0.000.000.00737.74
30Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicialNo Aplica0.000.000.003,753.59No Aplica0.000.000.003,753.59
31Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 68,814.70
411.805,911.7330,161.940.0068,814.70411.805,911.7330,161.94
32Operaciones fuera de balance.No Aplica233,781.800.000.0011,689.09No Aplica233,781.80
0.000.0011,689.09
33Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica389,833.58No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica389,833.58
34Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica
108.14No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica108.14

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

Durante marzo 2023, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:

Fondeo Estable Disponible:
Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por $161,603 millones y depósitos a plazo tradicionales por $137,104 millones, Capital (fundamental y complementario) por $82,822 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por $18,200 millones y $12,615 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por $5,648 millones.
Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de $338,690 y por operaciones mercado de dinero de $16,867 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por $14,552 millones, deducciones de capital por $10,167 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por $3,753 millones.

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

Promedio del cuarto trimestre del 2022: 110.84% – Promedio del primer trimestre del 2023: 108.14% (decremento: 270pb). El coeficiente de financiamiento neto disminuyó 270pb respecto al cuarto trimestre del 2022, esto debido principalmente a:

El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional disminuyó en MXN 8,108 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 4,641 millones.
El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas crecieron $1,085 millones.

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

Monto Computable (MXN MM)	Enero	Febrero	Marzo
Financiamiento Estable Disponible	426,602	420,054	417,991
Financiamiento Estable Requerido	387,442	387,985	394,073
Coeficiente de Fondeo Estable Neto	110.11%	108.27%	106.07%

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 2023 la posición accionaria de títulos para negociar asciende $15 millones de pesos, con una minusvalía de $(0.37) millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
ScotiabankPública	1	E-FRES-*	2,930	0.45	0.53	(0.08)
ScotiabankPública	1	-ALFA-A	310,000	3.54	3.76	(0.22)
ScotiabankPública	1	-ARA-*	125,000	0.48	0.46	0.02
ScotiabankPública	1	-ALPEK-A	155,000	3.10	3.24	(0.14)
ScotiabankPública	1	-NEMAK-A	100,000	0.46	0.39	0.07
ScotiabankPública	1	-ORBIA-*	20,000	0.79	0.72	0.07
ScotiabankPública	1	-LASITE-B-1	100,000	0.75	0.67	0.08
ScotiabankPública	1I	-EWZ-*	11,000	5.43	5.60	(0.17)
Total			823,930	15.00	15.37	(0.37)

Al cierre del primer trimestre del año 2023, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por $0.78 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	15,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	25,000	0.01	(0.02)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	100,390	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	50,751	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	59,379	0.07	(0.03)	0.04
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	133,390	0.23	(0.09)	0.14
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	79,698	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-FEMSA-UBD	28,089	0.11	-	0.11
Scotiabank	Pública	1-AMX-L	286,600	0.34	(0.01)	0.33
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	1,806	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	4,600	0.20	-	0.20
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	154	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	3,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	1,004	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	3,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	327,705	-	(0.22)	(0.22)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	58,683	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	16,008	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	55,000	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1-FEMSA-UBD	39,483	0.04	(0.05)	(0.01)
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	16,613	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1B-NAFTRAC-ISHRS	15,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	1,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	798	-	(0.05)	(0.05)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	7,128	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-XLC-*	1,600	0.12	-	0.12
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	30,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	668	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	40,365	-	(0.06)	(0.06)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	57,788	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	90,000	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	10,000	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	111,298	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ORBIA-*	16,356	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1-LASITE-B-1	28,767	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	100	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	4,300	-	(0.13)	(0.13)
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	6,469	0.10	-	0.10
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	12,000	0.43	(0.32)	0.11
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	70,459	0.16	(0.07)	0.09
Scotiabank	Pública	1I-XLC-*	3,000	0.05	(0.05)	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	8,366	0.01	(0.11)	(0.10)
Total			1,820,815	2.05	(1.27)	0.78

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

InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosImporte ValuadoCostoPlusvalía/ Minusvalía
ScotiabankSin cotizaciónEMPRESAS FRISCO, S.A. DE C.V.1,222---
ScotiabankSin cotizaciónBLADEX COM8,095---
Total9,317---

Al 31 de marzo de 2023, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de $5.10 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de $ 3.75 millones de pesos y el requerimiento por riesgo especifico asciende a la cantidad de $1.35 millones de pesos.

Requerimientos de CapitalizaciónTotal LargaTotal CortaValor Absoluto de la posición Coeficiente de Riesgo de mercadoRequerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado16.86-16.8622.23% 3.75
Por riesgo específico
Canasta de acciones, 15.00-15.008.00% 1.20
Índices accionarios1.86-1.864.00%0.07
Requerimiento por riesgos específico1.86-1.864.00%0.07
Total Requerimiento de capital5.10

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

RerferenciaRubrodic-22mar-22
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) 712,010 732,429
2(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)(10,616)(10,135)
3Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) 701,395 722,293
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) 7,019 8,290
5Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados 3,819 4,478
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)(1,941)(2,820)
8(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)
9Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos
10(Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)
11Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10) 8,897 9,948
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores
12Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por

transacciones contables por ventas 3,224 4,847
13(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)(1,223)(846)
14Exposición Riesgo de Contraparte por SFT - 0
15Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros - 0.0
16Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) 2,001 4,002
Otras exposiciones fuera de balance
17Exposición fuera de balance (importe nocional bruto) 264,565 248,799
18(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)(168,959)(170,305)
19Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) 95,606 78,495
Capital y exposiciones totales
20Capital de Nivel 1 68,247 68,783
21Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) 807,899 814,737
Coeficiente de apalancamiento
22Coeficiente de apalancamiento de Basilea III8.45%8.44%

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

RerferenciaDESCRIPCIONdic-22mar-23
1Activos totales 751,487 778,865
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(612)(482)
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(27,355)(31,642)
5Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores(1,223)(846)
6Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden 95,606 78,495
7Otros ajustes(10,003)(9,653)
8Exposición del coeficiente de apalancamiento 807,898 814,737

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

RerferenciaDESCRIPCIONdic-22dic-23
1Activos totales 751,487 778,865
2Operaciones en instrumentos financieros derivados(36,252)(41,589)
3Operaciones en reporto y prestamos de valores(3,224)(4,847)
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 712,010 732,429

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

CONCEPTO/PERIODOdic-22mar-23Variación
Capital Básico 1) 68,247 68,783 0.06%
Activos Ajustados2) 807,899 814,737 -0.07%
Razón de Apalancamiento 3)8.45%8.44%-1 pb
Reportado en la fila 20
Reportado en la fila 21 y

Reportado en la fila 22, de la Tabla I.1
Cifras previas a la réplica de Banxico

Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la Razón de Apalancamiento por el periodo de diciembre de 2022 a marzo de 2023.

El indicador se ubicó en 8.44%, 1pb inferior respecto al trimestre anterior, activos ajustados (-7 pbs) debido principalmente al incremento en las exposiciones dentro del balance (netas excluyendo instrumentos financieros derivados y SFT) (-21 pbs) se compensan parcialmente con la disminución en las exposiciones fuera del balance (+18 pbs). Respecto al capital nivel 1 (+6 pbs) la mejora en el trimestre fue por menores deducciones.

TABLA I.2
NOTAS AL FORMATO DE REVELACIÓN ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

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

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

21Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19
22Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

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

TABLA III.2
NOTAS A LA CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE
ReferenciaDescripción
1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.
2El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados presentadas en el activo de los últimos estados financieros.
El monto se debe registrar con signo negativo.
3El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores presentadas en el activo de los últimos estados financieros.
El monto se debe registrar con signo negativo.
4No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.
5Suma de las líneas 1 a 4, la cual debe coincidir con la línea 1 de la Tabla I.1

Agencias Calificadoras

Scotiabank-Calificaciones Escala NacionalLargo plazoCorto plazoPerspectiva
Fitch RatingsAAA(mex)F1+(mex)Estable
Standard & Poor’smxAAAmxA-1+Estable

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

Dividendos

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

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

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

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

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

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

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 13 de noviembre del 2013, se aprobó decretar y pagar dividendos en efectivo, el primero de ellos hasta por la cantidad de $318’443,208.00 M.N. (Trescientos dieciocho millones cuatrocientos cuarenta y tres mil doscientos ocho pesos 00/100) M.N, a razón de $0.0513618077419 por acción,

para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6,200’000,000 (Seis mil doscientas millones) de acciones de las series “F” y “B” que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de “Utilidad de Ejercicios Anteriores” el cual fue pagado el 21 de noviembre del 2013, a través de la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V.

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

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

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

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 27 de octubre del 2022, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de $2,400’000,000.00 (Dos mil cuatrocientos millones de pesos 00/100) M.N., a razón de

$0.254768944692 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420,300,433 (Nueve mil cuatrocientas veinte millones trescientas mil cuatrocientos treinta y tres) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de "Utilidad de Ejercicios Anteriores".

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de marzo del 2023, 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$63,550 millones de pesos.
Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN$53,597 millones de pesos.

Adicionalmente:

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

Inversiones relevantes en capital

Al 31 de marzo de 2023, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.

I. Información cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de Mercado Derivado
1.Flujos de EfectivoPagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija PasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
2.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de

cambio de la moneda del subyacente.Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
3.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotanteActivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
4.Valor RazonableCartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera ActivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
5.Flujos de EfectivoCertificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
6.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
7.Flujos de EfectivoReportosPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
8.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXNCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional
9.Flujo de EfectivoBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesosCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

Subyacente*FuturosOpcionesSwaps
MRMEMRMEMRME
Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.
Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.
Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas
Operaciones de Opción sobre futuros de índice.
Moneda nacional, Divisas y UDIS;
Oro y Plata
Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.
Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (CurrencySwaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (ForwardStarting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.
(MR) Mercados reconocidos
(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

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

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

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

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo.
Diversificar fuentes de fondeo.
Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes activos

líquidos para hacer frente a eventos inesperados.
Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de marzo 2023 y en promedio para el primer trimestre de 2023 es de:

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)17,54632,749
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)89,51289,364

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

Inventario de modelos de derivados

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

Instrumentos a Valor Razonable

Clase de
activoDerivadoTipoBreve descripción
Tasas de interésOpcionesEuropeaCaps, 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=∑_(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=∑_(i=1)^n▒Floorlet_i
BinariaLa 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 nocional 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 nocional 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).
CCIRSIntercambio de intereses en moneda nacional por intereses

en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.
Tipo de cambioOpcionesEuropeaEn este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black–Scholes–Merton.
AmericanaEl enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)
BinariaSe 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.
BarreraUna 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.
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.

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 activoDerivadoTipoBreve descripción
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 repreciación ocurre justamente al pago de cupón.

Bonos Cupón Cero

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

Riesgo de Crédito

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

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

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

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

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

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.
Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2023 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el primer trimestre de 2023 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por inefectividad.

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

c. Información de Riesgos por el uso de Derivados

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

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

Al cierre de marzo de 2023 y promedio del primer trimestre 2023 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)89,51289,364

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:
ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

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

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

Scotiabank
(millones de pesos)NormalEscenario PosibleEscenario ProbableEscenario de Estrés
Gap 30d Gap Acum17,54614,77914,76514,751
Cambios en el Gap respecto al escenario normal(2,767)(2,781)(2,796)

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

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

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

Vega

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.
Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

Rho

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

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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, 2023:

Scotiabank
0-3 Meses3 - 12 Meses1 - 3 Años3 - 5 Años5 - 10 Años10 - 30 AñosTotal
Swaps(17,639.15)(5,530.19)(246,330.40)130,512.4538,481.49(60,128.23)(160,634.03)
CCS24,720.66(2,255.17)(1,493.87)344.74258.56(28.73)21,546.19
Caps&Floors158.01(57.45)158.0157.45--316.02
Binary Caps&Floors-------
TIIE Futures-------
Mbonds Futures-------
Total DERIVADOS7,239.52(7,842.81)(247,666.26)130,914.6438,740.05(60,156.96)
(138,771.82)
Cifras expresadas en pesos

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

Bajo el escenario probable una pérdida de (161.09) Millones de pesos.
Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (322.18) Millones de pesos.
Y finalmente con el escenario muy poco probable (798.5) 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 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(0.14)65.9750.00(6.94)100.00(13.88)200.00(27.75)
Volatilidad al 1%Caps & Floors-(0.01)0.10-0.40-1.00-
a FX %Forwards85.541,541.490.10(154.15)0.20(308.30)0.50(770.75)
a FX %Opciones Divisa--0.10-0.20-0.50-
Total(161.09)(322.18)(798.50)

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 31 de marzo de 2023 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

OpcionesDeltaVegaGamma
Options BNPUI5.INDX61,647.002,152.0027,961.00
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options EZU.P---
Options FXI.P---
Options GLD.P---
Options ICLN.OQ---
Options IDBTV1.INDX93,577.001,953.0035,650.00
Options MCHI.OQ---
Options MSFDV1.INDX---
Options NVDA.OQ---
Options QQQ.OQ---
Options SOXX.OQ---
Options SPXSR5.INDX---
Options SOXX.OQ---
Options SPXSR5.INDX---
TOTAL155,224.004,105.0063,611.00
Cifras expresadas en pesos

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 BNPUI5.INDX(6,164.70)(18,494.10)(30,823.50)

Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options EZU.P---
Options FXI.P---
Options GLD.P---
Options ICLN.OQ---
Options IDBTV1.INDX(9,357.70)(28,073.10)(46,788.50)
Options MEXIBX.INDX---
Options MXSXAE.INDX---
Options HSCE.INDX---
Options MEXXLK.USM---
Options IBM.USM---
Options SBUX.USM---
Options IBM.USM---
Options SBUX.USM---
TOTAL(15,522.40)(46,567.20)(77,612.00)
Cifras expresadas en pesos

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

Escenarios al alza(0.1)(0.3)(0.5)
Options BNPUI5.INDX3,082.359,247.0512,329.40
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options EZU.P---
Options FXI.P---
Options GLD.P---
Options ICLN.OQ---
Options IDBTV1.INDX4,678.8514,036.5518,715.40
Options MEXIBX.INDX---
Options MXSXAE.INDX---
Options HSCE.INDX---
Options MEXXLK.USM---
Options IBM.USM---
Options SBUX.USM---
Options IBM.USM---
Options SBUX.USM---
TOTAL7,761.2023,283.6031,044.80
Cifras expresadas en pesos

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:

ScotiabankMonto
Probable(15,522.40)
Poco Probable(46,567.20)
Muy poco Probable(77,612.00)

Cifras expresadas en pesos

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 2023 se tienen los siguientes saldos:

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado
CLIENTE 1MXN48,800,000(207,800,000)
CLIENTE 2MXN430,000,000(492,000,000)
CLIENTE 3MXN561,900,000(264,600,000)
CLIENTE 4MXN50,800,000(84,100,000)
CLIENTE 5MXN823,400,053(1,422,100,000)
CLIENTE 6USD70,470,000(107,690,000)
CLIENTE 7USD45,800,000(25,720,000)
CLIENTE 8USD252,900,000(345,200,000)
CLIENTE 9USD2,210,000(890,000)
CLIENTE 10USD7,400,000(9,330,000)
CLIENTE 11USD150,000(100,000)
CLIENTE 12USD10,430,000(6,900,000)
CLIENTE 13USD260,000-
CLIENTE 14USD3,660,000(3,200,000)
CLIENTE 15MXN140,500,000(352,300,000)
CLIENTE 16MXN179,300,000(229,500,000)
CLIENTE 17MXN7,400,000-
CLIENTE 18MXN1,622,800,000(576,900,000)
CLIENTE 19MXN351,675,414(1,128,878,132)
CLIENTE 20MXN8,400,000(1,700,000)
CLIENTE 21USD14,090,000(5,630,000)
CLIENTE 22USD2,710,000(42,550,000)
CLIENTE 23USD19,380,000(20,020,000)
TOTAL 4,654,435,467(5,327,108,132)
Cifras expresadas en pesos

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

Liquidados anticipadamente

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados
Cifras expresadas en pesos

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

(1)Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 18 de abril de 2023, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y Berenice Martínez Mendoza (Director Finanzas) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

Los estados financieros consolidados del Banco incluyen los de las subsidiarias en las que ejerce control: la Inmobiliaria, Scotia Servicios y Scotia Derivados. Los saldos y operaciones importantes con estas compañías se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2022.

De conformidad con la Ley General de Sociedades Mercantiles (LGSM), los estatutos del Banco y las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito (las Disposiciones), emitidas por la Comisión los accionistas y la Comisión tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2022 adjuntos se someterán a la aprobación de los Accionistas.

Bases de presentación

a)Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados están preparados con fundamento en la legislación bancaria y de acuerdo con los criterios de contabilidad para instituciones de crédito en México (los Criterios de Contabilidad) establecidos en el Anexo 33 de las Disposiciones, y las reglas de operación aplicables, establecidos por la Comisión, quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las instituciones de crédito y realiza la revisión de su información financiera.

Los Criterios de Contabilidad establecen que la contabilidad de las instituciones de crédito debe ajustarse a la estructura básica de las Normas de Información Financiera (NIF) definida por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A.C. (CINIF) en la NIF A-1 “Estructura de las normas de información financiera”, considerando en primera instancia las NIF contenidas en la Serie NIF A “Marco conceptual”, así como lo establecido en el criterio de contabilidad A-4 “Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad”. Asimismo, establecen que las instituciones deben observar los lineamientos contables de las NIF, excepto cuando sea necesario, a juicio de la Comisión, aplicar una normatividad o criterios de contabilidad específicos sobre el reconocimiento, valuación, presentación y revelación aplicables a rubros específicos de los estados financieros y los aplicables a su elaboración.

Los Criterios de Contabilidad señalan que a falta de criterio contable específico de la Comisión para las instituciones de crédito, o en un contexto más amplio, de las NIF, se aplicarán las bases de supletoriedad previstas por la NIF A-8 “Supletoriedad”, y sólo en caso de que las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) a que se refiere la NIF A-8 no den solución al reconocimiento contable, se podrá optar por una norma supletoria que pertenezca a cualquier otro esquema normativo, siempre que cumpla con todos los requisitos señalados en la citada NIF y el mismo criterio contable , debiéndose aplicar la supletoriedad en el siguiente orden: los principios de

contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP) y cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando cumpla con los requisitos del criterio A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad" de la Comisión.

b) Información financiera comparativa

El 13 de marzo de 2020 se publicó en el Diario Oficial de la Federación la resolución que modifica las Disposiciones, la cual establece que las instituciones de crédito reconozcan el efecto de los cambios contables que surgen de dicha resolución en utilidades retenidas, sin reformular los estados financieros de ejercicios anteriores al 1 de enero de 2022, y que los estados financieros básicos consolidados al y por el año terminado el 31 de diciembre de 2021, no se presenten.

c) Uso de juicios y estimaciones

La preparación de los estados financieros consolidados requiere que la Administración efectúe estimaciones y suposiciones que afectan los importes registrados de activos y pasivos y la revelación de activos y pasivos contingentes a la fecha de los estados financieros consolidados, así como los importes registrados de ingresos y gastos durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

Juicios

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

-Nota 7 – Inversiones en instrumentos financieros: definición del modelo de negocio: Instrumento Financiero para Cobrar Principal e Interés (IFCPI), Instrumento Financiero para Cobrar o Vender (IFCV), o Instrumento Financiero Negociable (IFN).
-Nota 9 – Derivados: determinación sobre si los instrumentos financieros son de negociación o son designados con fines de cobertura.
-Nota 10 – Cartera de crédito: definición del modelo de negocio, ya sea para cobrar principal e interés (IFCPI), o para cobrar o vender (IFCV).
-Nota 14 – Arrendamientos: determinación de si un acuerdo contiene un arrendamiento.

Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

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

-Nota 7 – Inversiones en instrumentos financieros: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.
-Nota 3 – Valuación de instrumentos financieros derivados: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo.
-Nota 10 – Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios y de recuperabilidad de cuentas por cobrar: supuestos e insumos utilizados en su determinación.
-Nota 18 – Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables, y la materialización de los impuestos diferidos.

-Nota 20 – Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves.

Determinación del valor razonable

Algunas de las políticas y revelaciones contables del Banco requieren la medición de los valores razonables tanto de los activos y pasivos financieros como de los no financieros.

El Banco cuenta con un marco de control establecido en relación con la medición de los valores razonables. Esto incluye la autorización por parte del Consejo de Administración de la contratación de un proveedor de precios, además de la autorización por parte del Comité de Riesgos del Banco de los modelos de valuación internos y sus modificaciones, los métodos de estimación de las variables usadas en estos modelos de valuación cuando no son proporcionadas directamente por el proveedor de precios que el Banco haya contratado, y de aquellos valores y demás instrumentos financieros a los que les son aplicables los modelos de valuación internos.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable, incluyendo los valores razonables de Nivel 3, y que reporta directamente a la Dirección de Finanzas. El equipo de valuación revisa regularmente los datos de entrada no observables significativos y los ajustes de valuación. Si se usa información de terceros, como cotizaciones de corredores o servicios de fijación de precios, para medir los valores razonables, el equipo de valuación evalúa la evidencia obtenida de los terceros para respaldar la conclusión de que esas valuaciones satisfacen los requerimientos de las NIF, incluyendo el nivel dentro de la jerarquía del valor razonable dentro del que deberían clasificarse esas valuaciones. Los asuntos de valuación significativos son informados al Comité de Auditoría y al Consejo de Administración del Banco.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable.

Cuando se mide el valor razonable de un activo o pasivo, el Banco utiliza datos de mercado observables siempre que sea posible. Los valores razonables se clasifican en distintos niveles dentro de una jerarquía del valor razonable que se basa en los datos de entrada (observabilidad de los insumos) usados en las técnicas de valoración, como sigue:

Nivel 1: precios cotizados (no-ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos, que corresponde al nivel más alto, correspondiente a precios obtenidos exclusivamente con datos de entrada de Nivel 1.
Nivel 2: datos de entrada diferentes de los precios cotizados incluidos en el Nivel 1, que sean observables para el activo o pasivo, ya sea directa (es decir, precios) o indirectamente (es decir, provenientes de los precios) que corresponde a precios obtenidos con datos de entrada nivel 2.
Nivel 3: datos o insumos para medir el activo o pasivo que no se basan en datos de mercado observables (datos de entrada no observables), que corresponde a el nivel más bajo, para aquellos previos obtenidos con datos de entrada nivel 3.

Los instrumentos financieros que son valuados mediante el uso de un modelo de valuación

interno del Banco no son considerados bajo ninguna circunstancia como Nivel 1.

Si los datos de entrada usados para medir el valor razonable de un activo o pasivo se clasifican en niveles distintos de la jerarquía del valor razonable, entonces la medición del valor razonable se clasifica en su totalidad en el mismo nivel de la jerarquía del valor razonable que la variable de más baja observabilidad que sea significativa para la medición total.

Conforme a lo establecido en las Disposiciones, el Banco determina el valor razonable de los siguientes instrumentos financieros mediante la valuación directa a vector, que consiste en aplicar a la posición en títulos o contratos del Banco el precio actualizado para valuación proporcionado por un proveedor de precios:

I.Valores inscritos en el registro nacional de valores o autorizados, inscritos o regulados en mercados reconocidos por la Comisión.
II.Instrumentos financieros derivados que cotizan en bolsas de derivados nacionales o que pertenecen a mercados reconocidos por el Banco Central.
III.Activos subyacentes y demás instrumentos financieros que forman parte de las operaciones estructuradas o paquetes de derivados, cuando se trata de valores o instrumentos financieros previstos en las fracciones l y II referidas anteriormente.

El proveedor de precios contratado por el Banco que le proporciona los precios e insumos para la determinación de la valuación de los instrumentos financieros es Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S. A. de C. V. (VALMER).

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2022, no se observó una disminución significativa en el volumen (o nivel de actividad) en relación con la actividad normal del mercado. Lo anterior considerando el tipo de instrumentos financieros que mantiene el Banco, su baja complejidad y por la disminución de la volatilidad en los mercados financieros en 2022.

Al 31 de diciembre de 2022, no existe una reducción en la disponibilidad de precios e insumos proporcionados por el proveedor de precios, por lo que no hay un deterioro evidente y que resulte significativo de las condiciones observables en los insumos utilizados para la valuación de los valores y los otros instrumentos financieros que requiera el reconocimiento de un deterioro en su valor. Como parte de los controles del Banco, se monitorea la evolución de los mercados financieros, liquidez y condiciones de disponibilidad de precios e insumos para la valuación de los instrumentos con el fin de anticipar cualquier deterioro en el valor de los mismos.

El Banco reconoce las transferencias entre los niveles de la jerarquía del valor razonable al final del período sobre el que se informa durante el cual ocurrió el cambio.

Las siguientes notas incluyen información adicional sobre los supuestos hechos al medir los valores razonables:

- Nota 7 – Inversión en instrumentos financieros; y
- Nota 9 – Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura.

d)Moneda funcional y de informe

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

Para propósitos de revelación en las notas a los estados financieros consolidados,

cuando se hace referencia a pesos o "$", se trata de millones de pesos mexicanos, y cuando se hace referencia a dólares o USD, se trata de millones de dólares de los Estados Unidos de América.

e) Presentación del resultado integral

En cumplimiento con el criterio contable D-2 "Estado de resultado integral" establecido por la Comisión, el Banco presenta el resultado integral en un solo estado que presenta en un único documento todos los rubros que conforman el resultado neto, incrementado o disminuido por los Otros Resultados Integrales (ORI) del período, así como de la participación en los ORI de otras entidades, y se denomina "Estado de resultado integral".

f) Reconocimiento de activos y pasivos financieros en su fecha de concertación

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

(2) Resumen de las principales políticas contables

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en la preparación de los estados financieros consolidados que se presentan, excepto por lo que se indica en la nota 4 que incluye los cambios contables reconocidos durante el ejercicio.

(a) Reconocimiento de los efectos de la inflación

Los estados financieros consolidados que se acompañan fueron preparados de conformidad con los Criterios de Contabilidad, los cuales debido a que el Banco opera en un entorno económico no inflacionario conforme lo establece la NIF B-10 "Efectos de la inflación", incluyen el reconocimiento de los efectos de la inflación hasta el 31 de diciembre de 2007 con base en el valor de la Unidad de Inversión (UDI), que es una unidad de cuenta cuyo valor es determinado por el Banco de México (Banco Central) en función de la inflación. El porcentaje de inflación anual, acumulada en los tres últimos ejercicios y los valores de la UDI utilizados para determinar la inflación, se muestran a continuación:

31 de diciembre de	UDI	Inflación Del año	Acumulada
2022	7.6468	7.58%	19.50%
2021	7.1082	7.61%	14.16%
2020	6.6056	3.23%	11.31%

(b) Bases de consolidación

Los estados financieros consolidados incluyen los del Banco, S. A. y los de sus subsidiarias en las que ejerce control. Los saldos y operaciones importantes entre las compañías del grupo se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las entidades al 31 de diciembre de 2022, los que se prepararon de acuerdo con los

Criterios de Contabilidad establecidos por la Comisión.

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2022, se detallan a continuación:

Subsidiaria ParticipaciónUbicaciónActividad
Inmobiliaria 99.99%Ciudad de MéxicoAdministración de activo fijo
Scotia Servicios 99.99%Ciudad de MéxicoApoya la administración del negocio adquirente de tarjeta de crédito
Scotia Derivados100%Ciudad de MéxicoOperador de contratos de futuros y opciones en Mexder

(c)Operaciones en moneda extranjera

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio de cierre de jornada de operación determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el periodo en que se originan.

(d)Compensación de activos financieros y pasivos financieros

Un activo y pasivo financiero serán objeto de compensación de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado su importe neto, sólo cuando el Banco tiene el derecho legalmente exigible y vigente de compensarlos en cualquier circunstancia, y a su vez la intención de liquidarlos sobre una base compensada, o de realizar el activo financiero y liquidar el pasivo financiero simultáneamente.

(e)Efectivo y equivalentes de efectivo

El efectivo se reconoce a su valor nominal. Se consideran efectivo, la moneda de curso legal y moneda extranjera en caja, los depósitos en el Banco Central y los depósitos en entidades financieras del país y el extranjero, ya sea en cuentas de cheques, giros bancarios, telegráficos o postales y remesas en tránsito.

Los equivalentes de efectivo se reconocen inicialmente a su valor razonable. Éstos incluyen valores a corto plazo, de alta liquidez, fácilmente convertibles en efectivo que están sujetos a riesgos poco importantes en su valor (donde estos últimos son aquellos cuyo plazo de vencimiento se prevé dentro de un máximo de 48 horas a partir de su adquisición), entre otros, los préstamos interbancarios con vencimientos iguales o menores a tres días hábiles (operaciones de “Call Money”), las compra de divisas que no se consideren instrumentos financieros derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable, y otros equivalentes de efectivo tales como corresponsales, documentos de cobro inmediato, metales preciosos amonedados e inversiones disponibles a la vista.

La valuación de los equivalentes de efectivo representados por metales preciosos amonedados se realiza a su valor razonable, considerándose como tal a la cotización

aplicable a la fecha de valuación, excepto aquellos que por su naturaleza no tengan valor razonable, los cuales se reconocen a su costo de adquisición.

Las divisas adquiridas que se pacta liquidar en una fecha posterior a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como efectivo y equivalentes de efectivo restringidos; en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de efectivo y equivalentes de efectivo. Los derechos originados por las ventas de divisas se registran en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y las obligaciones derivadas de las compras de divisas se registran en el rubro de "Acreedores por liquidación de operaciones".

El monto de los sobregiros en cuentas de cheques, el saldo compensado, de divisas a recibir y divisas a entregar, o de algún concepto que integra el efectivo y equivalentes de efectivo, cuando muestran saldos negativos, se presenta en el rubro de "Otras cuentas por pagar".

Los intereses ganados y las utilidades o pérdidas por valuación se incluyen en los resultados del ejercicio conforme se devengan como parte de los ingresos o gastos por intereses. Los resultados por valuación y compraventa de metales preciosos amonedados y divisas se reconocen en el resultado por intermediación.

(f)Cuentas de margen

Las cuentas de margen están asociadas a transacciones con instrumentos financieros derivados celebrados en mercados o bolsas reconocidos, en las cuales se depositan activos financieros altamente líquidos destinados a procurar el cumplimiento de las obligaciones correspondientes a dichos instrumentos, a fin de mitigar el riesgo de incumplimiento. El monto de los depósitos corresponde al margen inicial y a las aportaciones o retiros posteriores que efectúen el Banco y la cámara de compensación durante la vigencia del contrato de los instrumentos financieros derivados.

Las cuentas de margen en efectivo se reconocen a su valor nominal y se presentan dentro del rubro de "Cuentas de margen". Los rendimientos y las comisiones que afectan a las cuentas de margen, distintos a las fluctuaciones en los precios de los derivados, se reconocen en los resultados del ejercicio conforme se devengan dentro de los rubros de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas pagadas", respectivamente.

Las liquidaciones parciales o totales depositadas o retiradas por la cámara de compensación con motivo de las fluctuaciones en los precios de los derivados se reconocen dentro del rubro de "Cuentas de margen", afectando como contrapartida una cuenta específica que puede ser de naturaleza deudora o acreedora, según corresponda y que representa un anticipo recibido, o bien, un financiamiento otorgado por la cámara de compensación y que reflejará los efectos de la valuación de los derivados previos a su liquidación.

(g)Inversiones en instrumentos financieros

i.Reconocimiento y medición inicial

Las inversiones en instrumentos financieros comprenden instrumentos de patrimonio neto, obligaciones, bonos, certificados y demás títulos de crédito y documentos que se emiten en serie o en masa, cotizados y no cotizados, que la entidad mantiene como posición propia. Se miden y reconocen inicialmente a su valor razonable más, en el caso de activos o pasivos financieros no medidos a valor razonable con cambios en éste, llevados a través de resultado integral, los costos de transacción directamente

atribuibles a su adquisición o emisión, cuando en lo subsecuente se midan a su costo amortizado.

ii.Clasificación y medición posterior

En el reconocimiento inicial, las inversiones en instrumentos financieros se clasifican en las siguientes categorías, conforme al modelo de negocio y las características de los flujos contractuales de los mismos, como:

—Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), que tienen por objeto en su tenencia, recuperar los flujos contractuales que conlleva el instrumento. Los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden sólo a pagos de principal e interés (rendimiento), usualmente sobre el monto del principal pendiente de pago. El IFCPI debe tener características de un financiamiento otorgado y administrarse con base en su rendimiento contractual.

—Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV), medidos a valor razonable con cambios en otros resultados integrales (VRCORI), que tienen por objetivo tanto cobrar los flujos contractuales de principal e interés, como obtener una utilidad en su venta cuando ésta resulte conveniente. El Banco de forma irrevocable reconoce los cambios en el valor razonable de los IFCV a través del ORI; e

—Instrumentos financieros negociables (IFN), medidos a valor razonable con cambios en resultados (VRCR) que representan la inversión en instrumentos financieros de deuda o de capital, y que tienen por objetivo obtener una utilidad entre el precio de compra y el de venta.

La clasificación de las inversiones en instrumentos financieros se basa tanto en el modelo de negocios como en las características de los flujos contractuales de los mismos. Atendiendo al modelo de negocios, un instrumento financiero o una clase de instrumentos financieros (un portafolio), puede ser administrado bajo:

—Un modelo que busca recuperar los flujos contractuales (representado por el monto del principal e intereses).

—Un modelo de negocio que busca, tanto la recuperación de los flujos contractuales como en el modelo anterior, como la obtención una utilidad mediante la venta de los instrumentos financieros, lo cual conlleva a desplazar un modelo combinado de gestión de estos instrumentos financieros.

—Un modelo que busca obtener un máximo rendimiento a través de compra y venta de los instrumentos financieros.

Los instrumentos financieros no se reclasifican después de su reconocimiento inicial, excepto si el Banco cambia su modelo de negocio, en cuyo caso todos los instrumentos financieros afectados son reclasificados a la nueva categoría en el momento en que el cambio en el modelo de negocio ha ocurrido.

La reclasificación de inversiones en instrumentos financieros entre categorías se aplica prospectivamente a partir de la fecha de cambio en el modelo de negocio, sin modificar ninguna utilidad o pérdida reconocida con anterioridad, tales como intereses o pérdidas por deterioro.

Cuando se realice alguna reclasificación conforme a lo antes mencionado, el Banco

deberá informar de este hecho por escrito a la Comisión dentro de los 10 días hábiles siguientes a su determinación, exponiendo detalladamente el cambio en el modelo de negocio que las justifique. Dicho cambio deberá estar autorizado por el Comité de Riesgos del Banco.

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2022, el Banco no llevó a cabo transferencias entre categorías.

Un instrumento financiero se mide al costo amortizado si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a su valor razonable con cambios a través de resultados:

—el instrumento financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los instrumentos financieros para obtener la recuperación de los flujos de efectivo contractuales; y

—las condiciones contractuales del instrumento financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe del principal pendiente (Sólo Pago del Principal e Intereses, o SPPI por sus siglas).

Una inversión en un instrumento de deuda se mide a valor razonable con cambios en ORI si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a valor razonable con cambios en resultados como se menciona en la hoja siguiente.

—el activo financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo se logra tanto obteniendo los flujos de efectivo contractuales como vendiendo los activos financieros; y

—las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe de SPPI.

Todos los instrumentos financieros no clasificados como medidos al costo amortizado o a valor razonable con cambios en ORI como se describe anteriormente, son medidos a valor razonable con cambios en resultados. Esto incluye todos los instrumentos financieros derivados (ver inciso (j) de esta nota).

Instrumentos financieros: Evaluación del modelo de negocio –

El Banco realiza una evaluación del objetivo del modelo de negocio en el que se mantiene un instrumento financiero a nivel del portafolio, ya que esto es lo que mejor refleja la manera en que se administra el negocio y se entrega la información a la Administración. La información considerada incluye lo que se muestra a continuación:

—las políticas y los objetivos señalados para el portafolio y la operación de esas políticas en la práctica. Estas incluyen si la estrategia de la Administración se enfoca en cobrar ingresos por intereses contractuales, mantener un perfil de tasa de interés concreto o coordinar la duración de los instrumentos financieros con la de los pasivos que dichos instrumentos están financiando o las salidas de efectivo esperadas, o realizar flujos de efectivo mediante la venta de los instrumentos;

—cómo se evalúa el rendimiento del portafolio y cómo éste se informa a la Administración del Banco;

—los riesgos que afectan al rendimiento del modelo de negocio (y los instrumentos financieros mantenidos en el modelo de negocio) y, en concreto, la forma en que se gestionan dichos riesgos;

—cómo se retribuye a los gestores del negocio (por ejemplo, si la compensación se basa en el valor razonable de los instrumentos gestionados o sobre los flujos de efectivo contractuales obtenidos); y

—la frecuencia, el volumen y la oportunidad de las ventas en periodos anteriores, las razones de esas ventas y las expectativas sobre la actividad de ventas futuras.

Las transferencias de instrumentos financieros a terceros en transacciones que no califican para la baja en cuentas no se consideran ventas para este propósito, de forma consistente con el reconocimiento continuo de los instrumentos por parte del Banco.

Los instrumentos financieros que son mantenidos para negociación y cuyo rendimiento es evaluado sobre una base de valor razonable son medidos a valor razonable con cambios en resultados.

Instrumentos financieros: Evaluación de si los flujos de efectivo contractuales son SPPI –

Para propósitos de esta evaluación, el monto del "principal"' se define como el valor razonable del instrumento financiero en el momento del reconocimiento inicial. El "interés" se define como la contraprestación por el valor del dinero en el tiempo y por el riesgo crediticio asociado con el importe principal pendiente, durante un período de tiempo concreto y por otros riesgos y costos básicos de los préstamos (por ejemplo, el riesgo de liquidez y los costos administrativos), así como un margen de utilidad.

Al evaluar si los flujos de efectivo contractuales son SPPI, el Banco considera los términos contractuales del instrumento. Esto incluye evaluar si un instrumento financiero contiene una condición contractual que pudiera cambiar la oportunidad o importe de los flujos de efectivo contractuales de manera que no cumpliría esta condición.

Al hacer esta evaluación, el Banco toma en cuenta:

—eventos contingentes que cambiarían el importe o la oportunidad de los flujos de efectivo;

—términos que pudieran generar apalancamiento;

—términos que hacen referencia al valor del dinero en el tiempo, como por ejemplo ajustar la tasa del cupón, incluyendo las características de tasa variable;

—términos que generen instrumentos derivados implícitos, o cambios en sus términos y condiciones, por indexación a variables ajenas a la naturaleza del contrato;

—características de pago anticipado y prórroga; y

—términos que limitan el derecho del Banco a los flujos de efectivo procedentes de instrumentos específicos (por ejemplo, características de "sin recurso").

Una característica de pago anticipado es consistente con el criterio de únicamente pago del principal e intereses si el importe del pago anticipado representa sustancialmente los importes no pagados del principal e intereses sobre el importe principal, que puede

incluir compensaciones adicionales razonables para el termino anticipado del contrato. Adicionalmente, en el caso de un instrumento financiero adquirido con un descuento o prima significativo de su importe nominal contractual, una característica que permite o requiere el pago anticipado de un importe que representa sustancialmente el importe nominal contractual más los intereses contractuales devengados (pero no pagados) (que también pueden incluir una compensación adicional razonable por termino anticipado) se trata como consistente con este criterio si el valor razonable de la característica de pago anticipado es insignificante en el reconocimiento inicial.

Instrumentos financieros: Medición posterior y ganancias y pérdidas –

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

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

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio neto a favor se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de "Ingresos por intereses". No obstante, ver inciso (j) de esta nota en el caso de los derivados designados como instrumentos de cobertura.
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI)Estos instrumentos se miden posteriormente al costo amortizado usando el método del interés efectivo. El costo amortizado se reduce por las pérdidas por deterioro. El ingreso por intereses, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en resultados. Cualquier ganancia o pérdida en la baja en cuentas se reconoce en resultados del ejercicio.
Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV)Estos instrumentos se miden posteriormente a valor razonable. El ingreso por intereses calculado bajo el método de interés efectivo, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en los resultados del ejercicio. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otros resultados integrales (VRCORI), el cual se ajusta por el efecto de impuestos diferidos. En el momento de la baja en cuentas, las ganancias y pérdidas acumuladas en otros resultados integrales se reclasifican en resultados.

La valuación de los instrumentos de esta categoría designados como partida cubierta por derivados de cobertura a valor razonable, es reconocida en el rubro de "Resultado por intermediación".
Inversiones en acciones a través de ORIEstos activos se miden posteriormente al valor razonable. Los dividendos se reconocen como ingresos en resultados a menos que el dividendo claramente represente una recuperación de parte del costo de la inversión. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otro resultado integral.

iii.Baja en cuentas

El Banco da de baja en cuentas un instrumento financiero cuando expiran los derechos contractuales sobre los flujos de efectivo del instrumento financiero, o cuando transfiere los derechos a recibir los flujos de efectivo contractuales en una transacción en la que se transfieren sustancialmente todos los riesgos y beneficios de

la propiedad del instrumento financiero, o en la cual el Banco no transfiere ni retiene sustancialmente todos los riesgos y beneficios relacionados con la propiedad y no retiene el control sobre los instrumentos financieros.

El Banco participa en transacciones en las que transfiere los instrumentos reconocidos en su estado de situación financiera, pero retiene todos o sustancialmente todos los riesgos y beneficios de los instrumentos financieros transferidos. En estos casos, los instrumentos financieros transferidos no son dados de baja en cuentas. (ver incisos (h) e (i) de esta nota).

iv.Deterioro

El Banco evalúa desde su reconocimiento inicial las pérdidas crediticias esperadas (PCE) de los IFCV y los IFCPI, las cuales se determinan considerando el nivel de recuperabilidad esperada que corresponda a los distintos IFCV y reconoce el efecto de la pérdida, con base en el costo amortizado de los IFCV y los IFCPI. Dado que el valor razonable del IFCV ya reconoce el deterioro por pérdidas crediticias esperadas, el Banco no procede a crear una estimación que reduzca el valor razonable del IFCV; por lo tanto, el efecto se reconoce en la utilidad o pérdida neta, afectando el valor del IFCV antes de reconocer el efecto en ORI por valuación a valor razonable. Para los IFCPI, se reconoce la PCE determinada afectando el valor razonable del IFCPI. Lo anterior no afecta a los IFN, pues en éstos no surge la cuestión de cobrabilidad al no existir la intención de cobro y porque el valor de mercado de los mismos capta generalmente los efectos de pérdidas crediticias esperadas de los mismos.

Las PCE son el promedio ponderado por la probabilidad de las pérdidas crediticias y se miden como el valor presente de las insuficiencias de efectivo. Al estimar las PCE, el Banco considera la información razonable y sustentable que sea relevante y esté disponible sin costos o esfuerzos indebidos. Esto incluye información cuantitativa y cualitativa y análisis, basados en la experiencia histórica del Banco y en una evaluación de crédito informada e incluyendo información prospectiva.

El Banco vigila que las PCE por el deterioro de los títulos emitidos por una contraparte, guarda consistencia con el deterioro determinado para créditos que se otorguen a la misma contraparte.

En caso de que existan cambios favorables en la calidad crediticia de los IFCV que estén debidamente sustentados con base en eventos posteriores observables, la PCE ya reconocida se revierte en el periodo en que ocurren dichos cambios, contra la utilidad o pérdida neta del periodo, como una reversión de PCE previamente reconocida.

Operaciones fecha valor-

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

(h)Operaciones de reporto

Las operaciones de reporto que no cumplen con los términos establecidos en la NIF C-14 “Transferencia y baja de activos financieros”, se les da el tratamiento de

financiamiento con colateral atendiendo a la sustancia económica de dichas transacciones e independientemente si se trata de operaciones de reporto "orientadas a efectivo" u "orientadas a valores". En las transacciones "orientadas a efectivo" la intención como reportada es obtener un financiamiento en efectivo y la intención de la reportadora es el invertir su exceso de efectivo, y en la transacción "orientada a valores" la reportadora tiene como objetivo acceder a ciertos valores en específico y la intención de la reportada es la de aumentar los rendimientos de sus inversiones en valores.

Actuando como reportada-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco reconoce la entrada de efectivo o equivalentes de efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar medida inicialmente al precio pactado que se presenta en el rubro "Acreedores por reporto", la cual representa la obligación de restituir dicho efectivo a la reportadora. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por pagar se valúa a su costo amortizado mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Gastos por intereses". Los activos financieros transferidos a la reportadora se reclasifican en el estado de situación financiera consolidado, presentándolos como restringidos, y se siguen valuando de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda al activo.

Actuando como reportadora-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, se reconoce la salida de efectivo y equivalentes de efectivo, o bien una cuenta liquidadora acreedora, registrando una cuenta por cobrar al precio pactado que se presenta en el rubro de "Deudores por reporto", la cual representa el derecho a recuperar el efectivo entregado. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por cobrar se valúa a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Ingresos por intereses". Los activos financieros que se recibidos como colateral, se registran en cuentas de orden y se valúan a valor razonable.

En caso de que el Banco venda el colateral o lo otorgue en garantía, se reconoce la entrada de los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral, la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. El diferencial que llegara a resultar entre el precio recibido y el valor de la cuenta por pagar se reconoce en los resultados del ejercicio.

(i) Préstamo de valores

Es aquella operación en la que se conviene la transferencia de valores, del prestamista al prestatario, con la obligación de devolver tales valores u otros substancialmente similares en una fecha determinada o a solicitud, recibiendo como contraprestación un interés. En esta operación se solicita un colateral o garantía por parte del prestamista al prestatario.

Actuando como prestamista-

A la fecha de la contratación del préstamo de valores actuando como prestamista, el Banco registra el valor objeto del préstamo transferido al prestatario como restringido, para lo cual se siguen las normas de valuación, presentación y revelación de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda. Asimismo, se registra en cuentas de orden el colateral recibido que garantiza los valores prestados.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Ingresos por intereses".

Actuando como prestatario-

Actuando como prestatario, a la fecha de la contratación del préstamo de valores, el Banco registra el valor objeto del préstamo recibido en cuentas de orden, siguiendo para su valuación los lineamientos para los títulos reconocidos en el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

El valor objeto de la operación se presenta en cuentas de orden en el rubro de colaterales recibidos por el Banco. Por lo que se refiere a colaterales recibidos provenientes de otras transacciones se deberán presentar en el rubro de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Gastos por intereses".

(j)Instrumentos financieros derivados y operaciones de cobertura (IFD)

El Banco clasifica los instrumentos financieros derivados con base a su intencionalidad en las dos categorías que se muestran a continuación:

—Con fines de negociación - Consiste en la posición que asume el Banco con la intención de obtener ganancias basadas en los cambios en su valor razonable.

—Con fines de cobertura - Consiste en la posición que asume el Banco con el objeto de compensar o transformar el perfil de uno o varios de los riesgos generados por una partida cubierta.

El reconocimiento en los estados financieros consolidados de los activos y/o pasivos provenientes de operaciones con IFD, se realiza en la fecha en que se concreta la operación, independientemente de la fecha de liquidación o entrega del bien.

El Banco reconoce todos los activos o pasivos financieros resultantes de los derechos y obligaciones establecidos en los contratos de IFD, inicialmente a su valor razonable, el cual, presumiblemente, corresponde al precio de transacción, es decir, el precio de contraprestación recibida o entregada. Los costos de transacción que sean directamente atribuibles a la adquisición de IFD se reconocen directamente en resultados dentro del "Resultado por intermediación".

Posteriormente, todos los IFD se valúan a su valor razonable, sin deducir los costos de transacción en los que se pudiera incurrir en la venta u otro tipo de disposición, reconociendo dicho efecto de valuación en los resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Los derivados se presentan en el estado de situación financiera consolidado en un rubro específico del activo o del pasivo, dependiendo de si su valor razonable corresponde a un saldo deudor o un saldo acreedor, respectivamente. Dichos saldos deudores o acreedores se compensan siempre y cuando cumplan con las reglas de compensación de activos y pasivos financieros.

Operaciones con fines de negociación-

—Títulos Opcionales (“Warrants”):

Los títulos opcionales son documentos que se emiten en serie y se colocan entre el gran público inversionista, representan un derecho temporal adquirido por los tenedores a cambio del pago de una prima por la emisión en Acciones o Índices, por lo tanto, dicho derecho expira al término del plazo de vigencia, por lo que la tenencia de estos implica el reconocimiento de que el valor intrínseco y el precio de mercado del título opcional en el mercado secundario puedan variar en función del precio de mercado de los activos de referencia.

—Contratos adelantados (“forwards”) y futuros:

El contrato a futuro opera con términos estandarizados (condiciones generales de contratación), tiene mercado secundario y requiere el establecimiento obligatorio de colaterales en cuentas de aportaciones o de margen de liquidación diaria. El contrato adelantado o "forward" se opera en forma privada (fuera de los mercados organizados de futuros o de opciones). El saldo de dichos IFD representa la diferencia entre el valor razonable del contrato y el precio “forward” estipulado del mismo. Si la diferencia es positiva es plusvalía y se presenta en el activo; si es negativa es minusvalía y se presenta en el pasivo.

—Opciones:

En opciones compradas, su saldo deudor representa el valor razonable de los flujos futuros a recibir, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

En opciones vendidas, su saldo acreedor representa el valor razonable de los flujos futuros a entregar, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

—Swaps:

Su saldo representa la diferencia entre el valor razonable de la parte activa y de la parte pasiva.

Operaciones con fines de cobertura-

El Banco utiliza instrumentos financieros derivados con el objetivo de manejar adecuadamente los riesgos de tasas de interés y de tipos de cambio inherentes a las operaciones de crédito, depósitos, inversiones en valores y reportos, todas ellas propias de la banca comercial. Los instrumentos más utilizados son swaps de tasas de interés y de monedas, mediante los cuales se transforma instrumentos de tasa flotante a tasa fija y de tasa fija a tasa flotante, o en su caso, se trasforma activos denominados en moneda extranjera a nacional o viceversa. Los derivados pueden ser utilizados para cubrir flujos de caja o valor económico de diferentes activos y pasivos del Banco, existiendo políticas de control definidas para la designación y seguimiento continuo de la efectividad de tales coberturas.

Al inicio de las relaciones de cobertura designadas, el Banco documenta el objetivo y estrategia de gestión de riesgos para llevar a cabo la cobertura. El Banco también documenta la relación económica entre la partida cubierta y el instrumento de cobertura, fueron formalmente designados a exposiciones alojadas en el estado de situación financiera, incluyendo si se espera que los cambios en los flujos de efectivo de la partida cubierta y el instrumento de cobertura se compensen entre sí.

Los derivados con fines de cobertura, que cumplen con todas las condiciones, se valúan a valor razonable y el efecto se reconoce dependiendo del tipo de cobertura, de acuerdo con lo que se muestra a continuación:

—Coberturas de valor razonable. Cubren la exposición a los cambios en el valor razonable de un activo o pasivo reconocido o de un compromiso en firme no reconocido, o un componente de alguna de las partidas anteriores, o una exposición agregada. La posición primaria cubierta y el instrumento derivado de cobertura se valúan a su valor razonable, registrándose el efecto neto en los resultados del período dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

—Coberturas de flujos de efectivo. Cubren la exposición a la variabilidad de flujos de efectivo atribuible a un riesgo particular asociado con un activo o pasivo reconocido, un portafolio o un componente de los mismos, o una o varias transacciones pronosticadas altamente probables o porciones de éstas, o una exposición agregada. Se valúa a valor razonable el instrumento derivado de cobertura y la valuación correspondiente a la parte efectiva de la cobertura, se registra dentro de la cuenta "Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo" en los Otros Resultados Integrales. La parte inefectiva se registra en resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Una relación de cobertura debe descontinuarse prospectivamente cuando deja de cumplir con los criterios para reconocer una relación de cobertura, esto incluye cuando el instrumento de cobertura se vende, expira, se rescinde o se ejerce, así como después de que se ha considerado o llevado a cabo cualquier reequilibrio en la relación de cobertura y la relación de cobertura resulta ser no efectiva o no cumple con el objetivo de la administración de riesgo del Banco.

Derivados implícitos-

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

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que por medio de opciones implícitas, se puede ofrecer un rendimiento garantizado y/o se mejora la tasa de rendimiento del cliente (ver nota 16).

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

Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de IFD fuera de mercados o bolsas reconocidos-

La cuenta por cobrar que se genera por el otorgamiento de colaterales en efectivo en operaciones de IFD no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que la cuenta por pagar que se genera por la recepción de colaterales en efectivo se presenta dentro del rubro "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en activos no realizables, como títulos, se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

Ajuste de valoración por riesgo crédito contraparte y riesgo de crédito propio

El Credit Valuation Adjustment (CVA) es un ajuste a la valuación de los instrumentos financieros derivados financieros OTC por el riesgo asociado a la exposición crediticia asumida con cada contraparte.

Actualmente el Banco tiene implementada una metodología de cálculo de CVA bilateral a nivel contraparte que incorpora mitigantes de riesgo de crédito tales como acuerdos de compensación y colaterales.
La determinación de la exposición se basa en insumos de mercado consistentes con los utilizados en los procesos de valuación de instrumentos y los parámetros de pérdida (severidad de la pérdida y probabilidad de incumplimiento) se revisan periódicamente y se someten a validaciones y pruebas de estrés (en su caso, para las contrapartes que tienen asociados CDS a mercado, estos son utilizados para la obtención de la probabilidad de pérdida).

Los modelos de riesgo contraparte correspondientes a las metodologías implementadas para obtener las exposiciones de crédito para el portafolio de derivados.

El Debit Valuation Adjustment (DVA) es un ajuste de valoración similar al CVA, pero, en este caso, surge por el riesgo de crédito propio del Banco asumido por sus contrapartes en derivados financieros OTC.

Todos los valores razonables de los instrumentos financieros se calculan diariamente.

(k)Compensación de cuentas liquidadoras

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reportos, préstamos de valores, activos virtuales y/o de operaciones con instrumentos financieros derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados, se registran en cuentas liquidadoras dentro de los rubros de “Otras cuentas por cobrar, neto” y “Acreedores por liquidación de operaciones”, respectivamente, así como los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día. Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados.

La estimación de pérdidas crediticias esperadas correspondiente a los montos por cobrar antes mencionados, deberá determinarse de conformidad con lo establecido en la NIF C-16 “Deterioro de instrumentos financieros por cobrar”.

Los activos y pasivos financieros se compensan de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado el saldo deudor o acreedor, según corresponda, siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y se tenga la intención de liquidar la cantidad neta, o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

(l)Cartera de crédito

La cartera de crédito se compone de financiamientos otorgados a clientes por el Banco a través de contratos de crédito, operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito financiero, los cuales se reconocen cuando son originados y, en caso de

adquisiciones, en la fecha de concertación de la adquisición.

La cartera de crédito incluye:

Cartera de crédito valuada a costo amortizado. El modelo de negocio de esta cartera de crédito consiste en conservarla para cobrar los flujos de efectivo contractuales y los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden únicamente a pagos de principal e interés sobre el monto del principal pendiente de pago. Se reconoce inicialmente a su valor razonable que corresponde al precio de transacción, es decir al monto neto financiado que resulta de adicionar o restar al monto original de crédito, el seguro que se haya financiado, los costos de transacción, las comisiones, intereses y otras partidas cobradas por anticipado. Para su reconocimiento posterior, la cartera de crédito se valúa a su costo amortizado. El costo amortizado corresponde al valor presente de los flujos de efectivo contractuales por cobrar de la cartera de crédito, más los costos de transacción por amortizar, utilizando el método de interés efectivo y restando la estimación preventiva para riesgos crediticios.

Los costos de transacción a que se hacen referencia incluyen, entre otros, honorarios y comisiones pagados a agentes, asesores e intermediarios, avalúos, gastos de investigación, así como la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades. Por otra parte, los costos de transacción no incluyen premios o descuentos, los cuales forman parte del valor razonable de la cartera de crédito al momento de la transacción.

Tanto las comisiones cobradas como los costos de transacción que origina una línea de crédito se reconocen como un crédito o cargo diferido, respectivamente, presentándose netos y afectando la cartera de crédito, los cuales se amortizan en resultados conforme se devengan, excepto si se trata de los relacionados a tarjeta de crédito o líneas de crédito revolvente, los cuáles se reconocen directamente en resultados al momento del otorgamiento.

Clasificación de la cartera de crédito

La cartera de crédito se presenta en las categorías de comercial, hipotecaria de vivienda y consumo, conforme a lo descrito a continuación.

Créditos comerciales. Incluye los créditos mencionados a continuación:

a) los otorgados a personas morales o personas físicas con actividad empresarial y destinados a su giro comercial o financiero;
b) créditos otorgados a entidades financieras distintos de los préstamos interbancarios con un plazo menor a 3 días hábiles;
c) créditos por operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito;
d) créditos otorgados a fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos y los esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados" en los que exista una afectación patrimonial que permita evaluar individualmente el riesgo asociado al esquema;
e) los créditos concedidos al Gobierno Federal, entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados y los créditos a empresas productivas del estado, y
f) aquellos con garantía expresa de la Federación registrados ante la SHCP y el Banco Central, así como los garantizados expresamente por las entidades federativas,

municipios y sus organismos descentralizados, asentados en el Registro Público Único a que hace referencia la Ley de Disciplina Financiera de las entidades federativas y los municipios.

Créditos a la vivienda. Se clasifican como créditos a la vivienda los créditos directos otorgados a personas físicas y destinados a la adquisición o construcción de la vivienda sin propósito de especulación comercial, que cuentan con garantía hipotecaria sobre la vivienda del acreditado. Asimismo, se consideran créditos a la vivienda, los destinados a la construcción, remodelación o mejoramiento de la vivienda que están respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado, o bien cuentan con una garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo o por un fideicomiso público constituido por el Gobierno Federal para el fomento económico (remodelación o mejoramiento). Adicionalmente, se incluyen los créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades y aquellos créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado.

La cartera de crédito de vivienda incluye créditos originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT), adquiridos por el Banco. Esta cartera de crédito incluye la denominada cartera en prórroga, que se integra por créditos que, en términos de la Ley del INFONAVIT, cuentan con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios. Lo anterior, siempre y cuando la entidad está contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos de los organismos de referencia. Al concluir la prórroga la cartera recibe el tratamiento que le corresponde conforme a si se trata de "Régimen Ordinario de Amortización" (ROA) o el "Régimen Especial de Amortización" (REA).

ROA es una a modalidad de pago que es aplicable a los acreditados que tienen una relación laboral, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

REA es una modalidad de pago que es aplicable a acreditados que ya no cuentan con una relación laboral, a la que le son aplicables las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

Las obligaciones y derechos que el INFONAVIT tienen sobre los créditos adquiridos son las siguientes:

-El Banco fue seleccionado mediante el proceso de subasta para adquirir los derechos de coparticipación en la originación de los créditos del producto "Segundo Crédito" que serán otorgados a los derechohabientes del INFONAVIT.

-El INFONAVIT conserva la administración, cobranza y recuperación correspondiente a los créditos cedidos al Banco y está obligado a realizar las gestiones de cobro necesarias para la recuperación de los créditos exigibles.

Créditos de consumo. Son créditos directos otorgados a personas físicas, derivados de operaciones de tarjeta de crédito, de créditos personales, de nómina de créditos para la adquisición de bienes de consumo duradero (conocidos como ABCD), que contempla entre otros al crédito automotriz y las operaciones de arrendamiento financiero que son celebradas con personas físicas; incluyendo aquellos créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades, así como los de liquidez que no cuenten con garantía de inmuebles.

Líneas de crédito

En el caso de líneas de crédito y cartas de crédito que el Banco ha otorgado, en las cuales no todo el monto autorizado esté ejercido, la parte no utilizada de las mismas se reconoce en cuentas de orden.

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

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

Operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito

El descuento es una operación por la cual el Banco, como "descontante", se obliga a anticipar a un cliente, como "descontatario", el importe de un crédito, contra tercero y de vencimiento futuro, a cambio de la enajenación a favor de del Banco de dicho crédito, disminuido por un interés a favor del descontante.

Las cesiones de derechos de crédito son operaciones de financiamiento mediante las cuales se transmite al Banco la titularidad de derechos de crédito, siendo distintas de las adquisiciones de cartera de crédito.

Para cualquiera de las operaciones mencionadas anteriormente, el Banco reconoce inicialmente como cartera de crédito el valor nominal de la cartera recibida contra la salida de efectivo, el aforo pactado reconocido en "Otras cuentas por pagar" por importe del valor nominal de los derechos de crédito transferidos que no financia el Banco, y el ingreso financiero por devengar.

El ingreso financiero por devengar de estas operaciones corresponde a la diferencia entre el valor de la cartera recibida deducida del aforo y el monto financiado. Su devengamiento en el resultado integral se determina y reconoce conforme a la tasa de interés efectiva de las operaciones.

Pagos en especie

Los pagos en especie se reconocen de conformidad con lo establecido en la política contable de bienes adjudicados en la nota 3r.

Modelo de negocio de la cartera de crédito

La determinación del modelo de negocio para la cartera de crédito se basa en el historial de cómo el Banco la administra. El Banco considera lo siguiente:

a) La forma en cómo se determina e informa el desempeño de la cartera de crédito.
b) Los riesgos que afectan el desempeño del modelo de negocio y de la cartera de crédito y cómo son administrados esos riesgos.
c) Los lineamientos sobre los que se basa la remuneración de la dirección de crédito, si con base en maximizar el valor de la cartera de crédito o en cobrar sus flujos contractuales.

El Banco considera también la frecuencia, el valor y la oportunidad de las ventas de cartera de crédito en períodos anteriores, las razones de dichas ventas, así como las expectativas sobre la actividad de ventas futuras dentro del contexto y condiciones en que se presentaron, y la influencia que tienen en la forma en que se logra el objetivo

de la entidad para administrar o gestionar la cartera de crédito y, específicamente sobre cómo se realizan los flujos de efectivo.

Trimestralmente el Banco evalúa las características de sus modelos de negocio para clasificar la cartera de crédito con base en el objetivo del mismo, conforme a sus políticas establecidas.

Renegociaciones

Se consideran renegociaciones a las reestructuras y renovaciones de las operaciones de cartera de crédito, las cuales se describen a continuación:

Reestructuración. Es una renegociación de la que se deriva cualquier modificación a las condiciones originales del crédito, entre las cuales se encuentran:

-cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;
-cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, VSM, UMA o UDI);
-concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito;
-prórroga del plazo del crédito;
-modificación al esquema de pagos pactado, o
-ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate.

Renovación. Es una renegociación en la que el saldo de un crédito es liquidado parcial o totalmente por el deudor, sus obligados solidarios u otra persona que por sus nexos patrimoniales constituya riesgos comunes con el deudor, a través del incremento al monto original del crédito, o bien con el producto proveniente de otro crédito contratado con la misma entidad o con un tercero que por sus nexos patrimoniales con esta última constituya riesgos comunes.

No obstante lo anterior, el Banco no considera renovado un crédito por las disposiciones que se efectúen durante la vigencia de una línea de crédito preestablecida, siempre y cuando el acreditado haya liquidado la totalidad de los pagos que le sean exigibles conforme a las condiciones originales del crédito.

Por las reestructuras, así como por las renovaciones con las que se liquida parcialmente el crédito original, el Banco reconoce una utilidad o pérdida por la diferencia entre los flujos de efectivo del nuevo crédito descontados a la tasa de interés efectiva original y el valor en libros del crédito original a la fecha de la renegociación, sin considerar su estimación preventiva para riesgos crediticios.

Para efectos de lo anterior, se considera valor en libros al monto efectivamente al acreditado, ajustado por los intereses devengados, otros conceptos financiados, los cobros de principal e intereses, así como por las quitas y condonaciones, bonificaciones y descuentos que se hayan otorgado, y en su caso los ingresos o gastos financieros por devengar.

Para la determinación de la tasa de interés efectiva del nuevo crédito, consecuencia de la reestructura o la renovación parcial, se toma de base el resultado sumar al monto financiado se le adicionan los costos de transacción incurridos y en su caso las comisiones cobradas en por su originación y el resultado se toma de base para aplicar la tasa de interés efectiva original. Los costos de transacción y comisiones cobradas se reconocen como un cargo o crédito diferido, respectivamente, y se amortizan durante la vida remanente del crédito.

En el caso de renovaciones totales, el Banco considera que existe un nuevo crédito, por

lo que da de baja el crédito original.

Nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito

La cartera de crédito es evaluada periódicamente a efecto de determinar el riesgo de crédito, el cual representa la pérdida potencial por la falta de pago de un acreditado o contraparte en las operaciones que efectúa el Banco, incluyendo las garantías reales o personales que les otorguen, así como cualquier otro mecanismo de mitigación utilizado por las entidades. El nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito se clasifica por etapas que son, en orden ascendente en su nivel de riesgo, Etapa 1, Etapa 2 y Etapa 3.

Etapa 1

Se refiere a cartera de crédito cuyo riesgo de crédito no se ha incrementado significativamente desde su reconocimiento inicial hasta la fecha de los estados financieros consolidados, es decir que no se encuentra en los supuestos para considerarse en las Etapas 2 y 3 que se mencionan posteriormente.

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 1:

-Sobre créditos de consumo no revolvente (para adquisición de bienes de consumo duradero o ABCD, Auto, Nómina, Personal y Otros), cuando presentan hasta un mes de atraso.
-Para tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presenta hasta un impago en los períodos consecutivos inmediatos anteriores.
-Para la cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, cuando presentan atrasos de hasta un mes o atrasos de hasta tres meses para cartera que cuenta con prórroga; en el caso de cartera de crédito ROA cuando presenta de tres a seis meses de atraso, siempre que cada uno de los pagos realizados durante dicho período representa al menos el 5% de la amortización pactada.
-En el caso de cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos menores o iguales a 30 días naturales o un mes calendario.

Etapa 2

Incluye créditos que han mostrado un incremento significativo de riesgo desde su reconocimiento inicial y hasta la fecha de los estados financieros consolidados conforme a los modelos de cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios (ver nota 3o).

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 2:

-Para créditos de consumo no revolvente, cuando presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses.
-En el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de uno y hasta tres impagos en períodos consecutivos inmediatos anteriores.
-Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, si presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses, incluyendo los clasificados como REA.
-Cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos mayores a 30 días naturales o un mes calendario y menores a 90 días naturales tres meses calendario.

Los créditos que estando en Etapa 2 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a Etapa 1.

Etapa 3

Corresponde a la cartera de crédito con deterioro crediticio originado por la ocurrencia de uno o más de los eventos, los cuales tienen un impacto significativo sobre los flujos de efectivo futuros de dichos créditos. En específico, se consideran los créditos en esta etapa los que se muestran a continuación:

1.Aquéllos por los que el Banco tiene conocimiento de que el acreditado ha sido declarado en concurso mercantil.

Sin perjuicio de lo previsto previamente, los créditos que continúan recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles (LCM), así como los créditos otorgados al amparo del artículo 75 en relación con las fracciones II y III del artículo 224 de la citada Ley, son traspasados a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 cuando incurren en los supuestos previstos por el numeral 2 siguiente.

2.Tratándose de créditos de consumo no revolventes y créditos a la vivienda, que han sido pagados parcialmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

a.Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b.Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

3.Créditos distintos a los mencionados en el numeral anterior, cuyas amortizaciones no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como se muestra a continuación:

a.Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b.Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

c.Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

4.Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de “Efectivo y equivalentes de efectivo”, al momento en que no han sido cobrados.

5.Créditos adquiridos al INFONAVIT, conforme a la modalidad de pago REA o ROA, y créditos destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda, cuando sus amortizaciones o pagos, respectivamente, no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presentan 90 días naturales o más de vencidos.

El traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 de los créditos a que se

refiere el numeral 5 del párrafo anterior se sujeta al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

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

Las excepciones mencionadas anteriormente no se consideran excluyentes entre sí.

Para créditos de consumo en los que las condiciones de pago establecidas en el contrato establecen pagos con periodicidad menor a un mes calendario, el Banco considera las siguientes equivalencias:

Periodicidad
de pago
contractualEquivalencia
30 días90 días
Quincenal2 quincenasMás de 6 quincenas
Catorcenal2 catorcenasMás de 6 catorcenas
Decenal3 decenasMás de 9 decenas
Semanal4 semanasMás de 13 semanas

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 3:

-Para créditos de consumo no revolvente cuando presenta atrasos mayores a tres meses
-Sobre tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de tres impagos en períodos consecutivos inmediatos anteriores.
-Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda. Cuando presentan atrasos de mayores a tres meses, en el caso de créditos ROA, si presentan tres a seis meses de atraso, si alguno de los pagos realizados durante dicho período no representa al menos el 5% de la amortización pactada, y para créditos ROA cuando presentan atrasos mayores a 6 meses.
-Cartera de crédito comercial, si presenta atrasos mayores o iguales a 90 días naturales o 3 meses calendario.

En el caso de adquisiciones de cartera de crédito, para la determinación de los días naturales de vencimiento, se consideran los incumplimientos que se hayan presentado desde su originación.

Los créditos que estando en Etapa 3 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a Etapa 1.

Efecto de renegociaciones en el nivel de riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito Etapa 2 o Etapa 3 que se reestructuren o se renueven no se reclasifican a una etapa con menor riesgo de crédito por efecto de su reestructura o renovación, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, que se reestructuren durante su

plazo o se renueven en cualquier momento, son traspasados a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, y permanecen en dicha etapa hasta que existe evidencia de pago sostenido.

Las líneas de crédito dispuestas, que se han reestructurado o renovado en cualquier momento, se traspasan a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, excepto cuando se cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del acreditado y se ha cumplido lo siguiente:

a) se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y
b) se ha cubierto la totalidad de los pagos a que esté obligado en términos del contrato a la fecha de la reestructuración o renovación.

Tratándose de disposiciones de crédito hechas al amparo de una línea de crédito, cuando se reestructuran o renuevan en forma independiente de dicha línea, son evaluadas de conformidad con las reglas para reestructuraciones y renovaciones aplicables antes descritas, atendiendo a las características y condiciones de la disposición o disposiciones reestructuradas o renovadas.

Si posterior a la evaluación descrita en el párrafo anterior se concluye que una o más disposiciones otorgadas al amparo de una línea de crédito deben traspasarse a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito por efecto de dicha reestructura o renovación y tales disposiciones, de manera individual o en su conjunto, representan al menos 25% del total del saldo dispuesto de la línea de crédito al a fecha de la reestructura o renovación, el saldo total dispuesto, así como sus disposiciones posteriores, son traspasadas a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, distintos de créditos referentes a i) créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia que los intereses se paguen periódicamente, ii) líneas de crédito dispuestas, y iii) disposiciones de crédito hechas al amparo de líneas de crédito, que se han reestructurado o renovado de los que no ha transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se mantienen en la misma categoría únicamente si cumplen lo siguiente:

a) el acreditado ha cubierto la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración, y

b) el acreditado ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto.

Sobre el mismo tipo de créditos mencionados en el párrafo anterior, con riesgo de crédito en Etapa 1 y
Etapa 2, pero que han sido reestructurados o renovados durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, son traspasados a la categoría inmediata siguiente, con mayor riesgo de crédito, excepto si cumplen siguiente:

a) se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración
b) se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto, y
c) se ha cubierto el 60% del monto original del crédito.

Si no se cumplen todas las condiciones descritas en los dos párrafos anteriores, según

corresponda, el crédito se traspasa a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito desde el momento en que se reestructura o renueve y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Se considera cumplido el requisito de los incisos a) de los dos párrafos anteriores, cuando habiéndose cubierto el interés devengado a la última fecha de corte, el plazo transcurrido entre dicha fecha y la reestructura o renovación no excede el menor entre la mitad del periodo de pago en curso y 90 días.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 o Etapa 2 que se reestructuren o renueven en más de una ocasión, son traspasados a cartera con riesgo de crédito en Etapa 3, excepto cuando el Banco cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del deudor. En el caso de cartera comercial, tales elementos son debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

Cuando se consolidan diversos créditos otorgados por el Banco a un mismo acreditado mediante una reestructura o renovación, se analiza cada uno de los créditos consolidados como si se reestructuraran o renovaran por separado y, si se concluye que uno o más de dichos créditos se habría traspasado a cartera con riesgo de crédito en Etapa 2 o Etapa 3 por la propia reestructura o renovación, el saldo total del crédito consolidado es traspasado a la categoría que correspondería al crédito objeto de consolidación con mayor riesgo de crédito.

Los créditos clasificados en el nivel de riesgo de crédito Etapa 2 por efecto de una reestructura son evaluados periódicamente a fin de determinar si existe un incremento en su riesgo que origine que deben ser traspasados a la Etapa de riesgo de crédito 3, conforme a lo descrito en el primer párrafo de la subsección “Etapa 3” de esta nota.

Los créditos no son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, por efecto de su reestructuración, si a la fecha de o la operación presentan cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las condiciones originales del crédito mencionados a continuación, no se reclasificarán al rubro de “Etapa 3”.

-Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.

-Tasa de interés: cuando se mejora al acreditado la tasa de interés pactada.

-Moneda o unidad de cuenta: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda o unidad de cuenta.

-Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago permite la omisión de pago en período alguno.

-Ampliación de la línea de crédito: sólo en el caso de créditos de consumo otorgados mediante líneas de crédito revolventes.

Pago sostenido del crédito.

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado cubre el monto total exigible de principal e intereses sin retraso, conforme a lo siguiente:

a)Cuando se trata de amortizaciones menores o iguales a 60 días, se cubre un mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito.
b)Para créditos con periodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.
c)En el caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 90 días naturales, se realiza el pago de una amortización.

Cuando los períodos de amortización pactados en la reestructura o renovación no son homogéneos, se considera el número de períodos que representan el plazo más extenso, conforme a lo descrito previamente.

Para reestructuras en las que se modifica la periodicidad del pago a períodos menores, para la determinación de si existe pago sostenido, se considera el número de amortizaciones que correspondería al esquema original del crédito.

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

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan el traspaso a cartera con riesgo Etapa 2 o Etapa 3, para determinar las amortizaciones requeridas para la existencia de pago sostenido, se considera el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalgan al plazo más extenso.

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

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

b)Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo.

Los créditos que se reestructuran o renuevan en más de una ocasión, que se ha pactado con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, acreditarán pago sostenido del crédito cuando:

a)El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura o renovación;
b)Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al nuevo esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo, y

c)La entidad cuenta con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor. En el caso de créditos comerciales, tales elementos están debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados,

distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido. Tal es el caso de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a los periodos requeridos conforme al primer párrafo de esta subsección.

Los créditos que por efecto de una reestructura o renovación son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, en todos los casos permanecen un mínimo de tres meses en dicha hasta acreditar pago sostenido y en consecuencia ser traspasados a la etapa inmediata siguiente con menor riesgo de crédito. Lo anterior con excepción de los créditos con pago de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, en los que se aplica lo descrito previamente para estos casos.

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

a) probabilidad de incumplimiento intrínseca del acreditado,
b) las garantías otorgadas al crédito reestructurado o renovado,
c) la prelación de pago frente a otros acreedores y,
d) la liquidez del acreditado ante la nueva estructura financiera del financiamiento.

Reconocimiento de ingresos, costos y gastos

El interés efectivo determinado mediante la aplicación de la tasa de interés efectiva se reconoce conforme se devenga. El interés efectivo incluye el devengamiento de los intereses de cartera y la amortización de comisiones por el otorgamiento de crédito, ambos presentados en el rubro de “Ingresos por intereses”, así como la amortización de los costos de transacción por el otorgamiento de crédito presentada en el rubro de “Gastos por intereses”.

Para determinar la tasa de interés efectiva, el Banco realiza lo siguiente:

1. Determina el monto de los flujos de efectivo futuros estimados a recibir. Consiste en sumar el principal y los intereses que se recibirán conforme al esquema de pagos del crédito, durante el plazo contractual, o en un plazo menor si es que existe una probabilidad de pago antes de la fecha de vencimiento u otra circunstancia que justifique la utilización de un plazo menor, para lo cual el Banco documenta la evidencia correspondiente.
2. Determinar el interés efectivo. Es el resultado de restar a los flujos de efectivo futuros estimados a recibir, el monto neto financiado determinado como se describe en el numeral 1 del segundo párrafo de esta nota.
3. Determinar la tasa de interés efectiva. Representa la relación entre el interés efectivo y el monto neto financiado.

Cuando conforme a los términos del contrato, la tasa de interés se modifica periódicamente, la tasa de interés efectiva calculada al inicio del período, es la que se utiliza durante toda la vida del crédito, es decir, no se determina nuevamente para cada período.

Existe la presunción de que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito pueden ser confiablemente estimados; sin embargo, en aquellos casos en que no

sea posible estimar confiablemente los flujos de efectivo futuros o la vida estimada del o de los créditos, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales, previa autorización del Comité de Crédito.

El Banco considera que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito son confiablemente estimados en la mayoría de las circunstancias, sin embargo, en aquellos casos en que no es posible estimarlos confiablemente, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales, documentando las circunstancias y hechos que llevaron a dicha conclusión, lo cual es autorizado por el comité de crédito.

Las comisiones y costos de transacción se amortizan contra los resultados del ejercicio por el período correspondiente al plazo de la línea de crédito asociada. Si la línea de crédito se cancela, el saldo pendiente por amortizar se reconoce totalmente en resultados.

Las comisiones reconocidas con posterioridad al otorgamiento de crédito que se generan como parte del mantenimiento de dichos créditos, así como las que se cobran con motivo de créditos no colocados, se reconocen contra los resultados del ejercicio conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito se reconocen inicialmente como un crédito diferido y se amortizan en un período de 12 meses contra los resultados del ejercicio, en el rubro de “Comisiones y tarifas cobradas”.

(m) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

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

(n) Partidas diferidas

Se integra por el monto neto entre costos de transacción y comisiones por otorgamiento de crédito.

(o) Estimación preventiva para riesgos crediticios

La determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios de cada categoría de la cartera de crédito se realiza con base en las metodologías generales establecidas en las Disposiciones, las cuales se basan en el enfoque de Pérdida Esperada, que se determina multiplicando la Probabilidad de Incumplimiento (PI) por el producto de la Severidad de la Pérdida en caso de Incumplimiento (SP) y la Exposición al Incumplimiento (EI).

Tratándose de líneas de crédito comprometidas no dispuestas, el Banco reconoce la estimación correspondiente al saldo no dispuesto conforme a las Disposiciones, lo cual también es aplicable a las cartas de crédito que el Banco ha emitido.

La PI es la probabilidad expresada como porcentaje de que ocurra cualquiera o ambas de las siguientes circunstancias con relación a un deudor específico y determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

a)El deudor se encuentra en situación de mora durante 90 días naturales o más respecto a cualquier obligación crediticia frente a la Institución, o bien dicha obligación crediticia cumple con los supuestos para ser clasificada con riesgo de crédito Etapa 3, descritos anteriormente (ver nota 3l).

b)Se considera probable que el deudor no abone la totalidad de sus obligaciones crediticias frente al Banco.

La SP en caso de Incumplimiento corresponde a la intensidad de la pérdida en caso de incumplimiento expresada como porcentaje de la EI, una vez tomados en cuenta el valor de las garantías y los costos asociados a los procesos de realización (judiciales, administrativos de cobranza y de escrituración, entre otros); es determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

La EI es la posición esperada, bruta de reservas, de la operación de crédito si se produce el incumplimiento del deudor. La EI no puede ser inferior a la cantidad dispuesta de la operación al momento del cálculo del requerimiento de reservas ni de capital; se determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

En su caso, el Banco determina o reconoce las estimaciones adicionales ordenadas por la Comisión, las cuales se constituyen para cubrir riesgos que no se encuentran previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia, y sobre las que previo a su constitución, el Banco informa a la Comisión sobre lo siguiente:

a)origen de las estimaciones;
b)metodología para su determinación;
c)monto de estimaciones por constituir, y

d)tiempo que se estima serán necesarias.

Sobre los créditos con riesgo de crédito en Etapa 3, en los que en su reestructuración se acuerda la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, el Banco reconoce una estimación por el 100% de dichos intereses, la cual cancela cuando existe evidencia de pago sostenido.

Cartera de crédito comercial

El cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito comercial se realiza conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos, así como su clasificación previa en cinco diferentes grupos, según a quienes se han otorgado:

I.Entidades federativas y municipios.

II.Proyectos con fuente de pago propia.

III.Fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, no incluidos en la fracción anterior, así como esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados".

IV.Entidades Financieras.

V.Personas morales no incluidas en las fracciones anteriores y físicas con actividad empresarial que, a su vez, se divide en los siguientes subgrupos:

a)Con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

b)Con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Para el cálculo de la PI de los créditos comerciales se realiza de acuerdo con las Disposiciones, conforme a cada uno de los grupos descritos anteriormente, que consiste en evaluar factores cuantitativos y cualitativos del acreditado y asignarles un puntaje crediticio, el cual es totalizado y utilizado para calcular la PI.

Para el cálculo de la SP, si los créditos carecen de cobertura de garantías reales, personales o derivados de crédito, se determina conforme a los meses transcurridos de atraso, dependiendo del grupo al que pertenecen, y considerando si son o no créditos subordinados o sindicados en los que el Banco es subordinado respecto de otros acreedores; asimismo, se considera la determinación de la SP mediante un cálculo diferenciado para los créditos de acreditados que han sido declaradas en concurso mercantil. En caso de que los créditos cuenten con garantías reales, garantías personales y seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito. Para la cartera de crédito que cuenta con el beneficio de un esquema de cobertura de paso y medida, el cálculo de la SP considera dicha cobertura.

La EI, en el caso de líneas crédito no comprometidas que son cancelables incondicionalmente o que permiten la cancelación automática en cualquier momento y sin previo aviso del Banco, corresponde al saldo insoluto del crédito. Para líneas de crédito distintas a las mencionadas anteriormente, la determinación de la EI se realiza conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Cartera hipotecaria y de vivienda

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito hipotecaria de vivienda se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

El cálculo se realiza utilizando las cifras correspondientes al último día de cada mes constituyendo la calificación de reserva en crédito por crédito.

Asimismo, se consideran principalmente, factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) atraso, vi) información proveniente de las sociedades de información crediticia, vii) ROA, viii) REA, ix) prórroga.

En caso de que los créditos cuenten con seguros de crédito, éstos son considerados en

la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito.

El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la PI por la SP y la EI o las diferentes reglas en las Disposiciones.

Cartera de consumo

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito de consumo se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando principalmente, factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia; así como, viii) antigüedad del acreditado en el Banco y ix) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia. El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento o las diferentes reglas establecidas en las Disposiciones.

La EI, en el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, se determina conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a la cartera crediticia de consumo no revolvente considera principalmente, lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) atraso, (iv) antigüedad del acreditado en el Banco, (v) antigüedad del acreditado con instituciones, (vi) monto a pagar al Banco, (vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, (viii) saldo reportado en las sociedades de información crediticia, (ix) endeudamiento (xi) importe original del crédito, (xii) saldo del crédito y xiii) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia.

Grado de riesgo de la estimación preventiva para riesgos crediticios

Las reservas preventivas constituidas por el Banco son clasificadas conforme a su grado de riesgo, de acuerdo con la tabla que se muestra a continuación:

Rangos de porcentaje de estimación preventiva
GradoConsumo
de riesgoNo RevolventeTarjeta de crédito y otros créditos revolventesHipotecario y de vivienda Comercial
DeADeADeADeA

A-10%2.0%0%3.0%0%0.50%0%0.90%
A-22.01%3.0%3.01%5.0%0.501%0.75%0.911.5%
B-13.01%4.0%5.01%6.5%0.7511.0%1.512.0%
B-24.01%5.0%6.51%8.0%1.0011.5%2.012.5%

B-35.01%6.0%8.01%10.0%1.5012.0%2.515.0%
C-16.01%8.0%10.01%15.0%2.0015.0%5.0110.0%
C-28.01%15.0%15.01%35.0%5.00110.0%10.0115.5%
D15.01%35.0%35.01%75.0%10.00140.0%15.5145.0%
E35.01% 100%75.01%100%40.001100%45.01100%

Castigos y recuperaciones de cartera de crédito

El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo a plazos establecidos de 6 y 60 meses, respectivamente que determinan la imposibilidad práctica de recuperación. El castigo se reconoce cancelando el saldo del crédito que determine la Administración, contra la estimación preventiva para riesgo crediticios. Cuando el crédito a castigar excede el monto de la estimación, antes de efectuar el castigo, el Banco reconoce una estimación hasta por el monto de la diferencia.

En todo caso, el Banco cuenta con evidencia de las gestiones formales de cobro que se han ejercido respecto de estos créditos, así como de los elementos que acreditan la imposibilidad práctica de recuperación del crédito de acuerdo con sus políticas internas establecidas en el manual de crédito.

Cualquier recuperación derivada de créditos previamente es reconocida en los resultados consolidados del ejercicio dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios", salvo que las recuperaciones provengan de pagos en especie, cuyo tratamiento se realiza conforme a las políticas establecidas para Bienes Adjudicados en la nota 3r.

Los costos y gastos incurridos por la recuperación de cartera de crédito deberán reconocerse como un gasto dentro del rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera

Las quitas sobre el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total que el Banco realice a los acreditados se realizarán cancelando el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios asociada al crédito y, si esta es menor al monto perdonado, el Banco previamente constituye estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

La cancelación de la estimación preventiva sobre las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera, es aplicable a los montos perdonados derivado de incrementos en el riesgo crédito, en caso contrario deberán disminuirse de los ingresos que le dieron origen.

(p)Otras cuentas por cobrar, neto

Se integra de las cuentas por cobrar liquidadoras por operaciones de venta de divisas, inversiones en valores, reportos, préstamo de valores, derivados y por emisión de títulos, así como de los deudores de cuentas de margen, deudores por colaterales otorgados en efectivo por operaciones con valores, crédito y derivados realizadas en mercados OTC. Asimismo, incluye los deudores diversos por premios, comisiones y derechos por cobrar sobre operaciones vigentes no crediticias, partidas asociadas a operaciones crediticias, saldos a favor de impuestos acreditables, préstamos y otros

adeudos del personal, amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas y otros deudores.

Estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro-

El Banco constituye una estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro por las cuentas por cobrar conforme a lo que se muestra a continuación:

Origen de la cuenta por cobrar Criterio de reconocimiento de la estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro

Cuentas liquidadoras.Se clasifican como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Otras cuentas por cobrar directamente relacionadas con la cartera de crédito, tales como gastos de juicio.Se aplica el mismo porcentaje de riesgo asignado para el crédito asociado para la constitución de la estimación.

Documentos de cobro inmediato no cobrados con 15 o más días naturales de haber sido registrados como "Otras cuentas por cobrar, neto".Se clasifican como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Sobregiros de cuentas de cheques de clientes que no cuentan con líneas de crédito de sobregiro.Se clasifican, al momento de su reconocimiento, como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Préstamos a funcionarios y empleados, derechos de cobro y otras cuentas por cobrar diversas pactadas desde su origen.El Banco determina un grado de irrecuperabilidad con base en su experiencia de pérdidas crediticias pasadas, cambios actuales en el comportamiento de sus clientes y previsiones económicas futuras, para lo cual clasifica sus cuentas por cobrar por grado de atraso en pago y asigna diferentes montos de PCE a cada uno de los segmentos de sus cuentas por cobrar.

Amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas en 30 días naturales posteriores a su vencimiento.Se constituye una estimación por el importe total.

Otras cuentas por cobrar distintas a las anteriores de deudores no identificados con 60 días o más de haber sido registrados. Se constituye una estimación por el importe total.

No se reconoce estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro sobre los saldos de impuestos a favor ni por el Impuesto al Valor Agregado (IVA) acreditable.

(q)Arrendamientos

Actuando como arrendador

Clasificación de los arrendamientos

El Banco clasifica cada uno de sus arrendamientos como un arrendamiento operativo o financiero. Se consideran como arrendamientos financieros todos los créditos que otorgue la entidad para operaciones de arrendamiento financiero, que son aquéllos en donde el Banco transfiere al arrendatario sustancialmente todos los riesgos y beneficios inherentes a la propiedad del activo subyacente, en caso de contrario se consideran como operativos.

Actuando como arrendatario

Al inicio de un contrato, el Banco evalúa si un contrato es, o contiene, un contrato de arrendamiento. Un contrato es, o contiene, un arrendamiento si el contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado por un período de tiempo a cambio de una contraprestación. El Banco evalúa si un contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado de manera implícita o explícita en un contrato.

Al comienzo o en la modificación de un contrato que contiene un componente de arrendamiento, el Banco asigna la contraprestación en el contrato a cada componente de arrendamiento o servicio sobre la base de sus precios independientes relativos.

El Banco reconoce un activo por derecho de uso y un pasivo por arrendamiento en la fecha de inicio del arrendamiento. El activo por derecho de uso se mide inicialmente al costo, que comprende el monto inicial del pasivo por arrendamiento ajustado por cualquier pago de arrendamiento realizado en o antes de la fecha de inicio, más los costos directos iniciales incurridos y una estimación de los costos para desmantelar o para restaurar el activo subyacente o el sitio en el que se encuentra, menos los incentivos de arrendamiento recibidos.

El activo por derecho de uso se deprecia posteriormente utilizando el método de línea recta desde la fecha de inicio hasta el final del plazo del arrendamiento, a menos que el arrendamiento transfiera la propiedad del activo subyacente al Banco al final del plazo del arrendamiento o el costo del activo por derecho de uso refleja que el Banco ejercerá una opción de compra. En ese caso, el activo por derecho de uso se depreciará a lo largo de la vida útil del activo subyacente, que se determina sobre la misma base que los de propiedades y equipo. Además, el activo por derecho de uso se reduce periódicamente por pérdidas por deterioro, si corresponde, y se ajusta por ciertas nuevas valuaciones del pasivo por arrendamiento como cambios en el monto de la renta por ajuste de inflación.

El pasivo por arrendamiento se mide inicialmente al valor presente de los pagos de arrendamiento que no se pagan en la fecha de inicio, descontados utilizando la tasa de interés implícita en el arrendamiento o, si esa tasa no puede determinarse fácilmente, la tasa incremental de financiamiento del Banco o la tasa libre de riesgo determinada con referencia al plazo del arrendamiento. Generalmente, el Banco usa su tasa de interés incremental como tasa de descuento.

El Banco determina su tasa incremental de financiamiento obteniendo tasas de interés de varias fuentes de financiamiento externo y realiza ciertos ajustes para reflejar los términos del arrendamiento (como plazo del arrendamiento y moneda en que se encuentran denominados los pagos) y el tipo de activo arrendado.

Los pagos de arrendamiento incluidos en la valuación del pasivo por arrendamiento comprenden lo siguiente:

—pagos fijos, incluidos los pagos en sustancia fijos;
—pagos de arrendamiento variables que dependen de un índice o una tasa, inicialmente valuados utilizando el índice o la tasa en la fecha de inicio;
—importes que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; y
—el precio de ejercicio bajo una opción de compra que el Banco está razonablemente seguro de ejercer, los pagos de arrendamiento en un período de renovación opcional si el Banco está razonablemente seguro de ejercer una opción de extensión y las sanciones por la terminación anticipada de un arrendamiento a menos que el Banco esté razonablemente seguro de no terminar antes de tiempo.

El pasivo por arrendamiento se valúa al costo amortizado utilizando el método de interés efectivo. Se vuelve a valuar cuando hay un cambio en los pagos de arrendamiento futuros que surgen de un cambio en un índice o tasa, si hay un cambio en la estimación del Banco, del monto que se espera pagar bajo una garantía de valor residual, si el Banco cambia su evaluación de si ejercerá una opción de compra, extensión o terminación o si hay un pago en sustancia fijo de arrendamiento modificado.

Cuando el pasivo por arrendamiento se vuelve a valuar de esta manera, se realiza un ajuste correspondiente al importe en libros del activo por derecho de uso, o se registra en resultados si el importe en libros del activo por derecho de uso se ha reducido a cero.

El Banco presenta activos de derecho de uso que no cumplen con la definición de propiedad de inversión en el rubro "Activos por derecho de uso de propiedades, mobiliario y equipo", y los pasivos por arrendamiento en el rubro "Pasivo por arrendamiento", ambos en el estado de situación financiera.

Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

El Banco ha decidido no reconocer los activos por derecho de uso y los pasivos por arrendamientos para arrendamientos de activos de bajo valor y arrendamientos a corto plazo, incluidos equipos de TI. El Banco reconoce los pagos de arrendamiento asociados con estos arrendamientos como un gasto en línea recta durante el plazo del arrendamiento.

(r)Bienes adjudicados

Los bienes adjudicados o recibidos mediante dación en pago que no son destinados para uso del Banco, se reconocen en la fecha que causa ejecutoria el auto de aprobación del remate mediante el cual se decreta la adjudicación, o tratándose de bienes recibidos mediante dación en pago, en la fecha que se firma la escritura de dación, o se haya formalizado la transmisión de propiedad del bien.

El reconocimiento de bienes adjudicados se realiza como sigue:

a)al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación, es decir, sin deducir la estimación preventiva para riesgos crediticios que se haya reconocido hasta esa fecha, y el valor neto de realización de los activos recibidos, cuando la intención de la entidad es vender dichos activos para recuperar el monto a cobrar; o
b)al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación o el valor razonable del activo recibido, cuando la intención de la entidad es utilizar el activo adjudicado para sus actividades.

En la fecha de registro del bien adjudicado o recibido mediante dación en pago, el valor del activo que dio origen a la adjudicación, así como su respectiva estimación preventiva que se tuviera constituida, se dan de baja del estado de situación financiera consolidado por el total del activo neto de la estimación, deducido de los pagos parciales en especie en caso de cartera de crédito, o de los cobros o recuperaciones cuando se trata de derechos de cobro.

La diferencia entre el valor del activo que dio origen a la adjudicación, neto de estimaciones, y el valor del bien adjudicado determinado conforme a lo descrito en el segundo párrafo de esta nota, se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio

en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Valuación de bienes adjudicados

Los bienes adjudicados se valúan conforme al tipo de bien que se trate, registrando su valuación contra los resultados del ejercicio como "Otros ingresos (egresos) de la operación".

El Banco reconoce una estimación de deterioro por las pérdidas de valor por el paso del tiempo conforme a las disposiciones, reconociéndolo en resultados como "Otros ingresos (egresos) de la operación". La determinación de las reservas por tenencia de bienes muebles o inmuebles, adjudicados o recibidos en dación en pago por el transcurso del tiempo, se determina, conforme a lo que se muestra a continuación:

Porcentaje de reserva Meses transcurridos a partir de la adjudicación o dación en pago	Bienes inmuebles	Bienes muebles, derechos de cobro e inversiones en valores
Hasta 6 meses	0%	0%
Más de 6 y hasta 12	0%	10%
Más de 12 y hasta 18	10%	20%
Más de 18 y hasta 24	10%	45%
Más de 24 y hasta 30	15%	60%
Más de 30 y hasta 36	25%	100%
Más de 36 y hasta 42	30%	100%
Más de 42 y hasta 48	35%	100%
Más de 48 y hasta 54	40%	100%
Más de 54 y hasta 60	50%	100%
Más de 60	100%	100%

Al momento de la venta de los bienes adjudicados, el diferencial entre el precio de venta y el valor en libros del bien adjudicado, neto de estimaciones, se reconoce directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Traspaso de bienes adjudicados para uso propio del Banco

Cuando el Banco opta por traspasar los bienes adjudicados para uso propio, el traspaso se realiza al rubro del estado de situación financiera consolidado que le corresponda según el activo de que se trate, cumpliendo con el hecho de que los bienes son utilizados para la realización de su objeto y se efectúe de acuerdo con sus estrategias de inversión y fines que se encuentran previamente establecidos en sus manuales, no existiendo la posibilidad de que dichos bienes vuelvan a considerarse como adjudicados.

(s) Propiedades, mobiliario y equipo

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

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

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

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

(t) Inversiones permanentes

Las inversiones permanentes en las que el Banco tiene influencia significativa o control se valúan utilizando el método de participación, a través del cual se reconoce la participación en los resultados y en el capital contable de estas entidades utilizando los estados financieros consolidados a la misma fecha y por el mismo periodo que el Banco. Se considera que una empresa es subsidiaria del Banco, cuando se tiene el poder de dirigir sus actividades relevantes, está expuesta o tiene derecho, a rendimientos variables procedentes de esa participación y tiene la capacidad presente de afectar esos rendimientos a través de su poder sobre ésta.

Las otras inversiones permanentes en donde no se tiene el control, control conjunto, ni influencia significativa son clasificadas como otras inversiones, las cuales se reconocen inicialmente y se mantienen valuadas a su costo de adquisición. En caso de que haya dividendos provenientes de dichas inversiones se reconocen en resultados en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de periodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

Al 31 de diciembre de 2022, no se reconocieron pérdidas por deterioro en las otras inversiones permanentes.

(u) Activos de larga duración disponibles para su venta

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

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

identificado el mercado potencial.
d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que la entidad celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del período de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control de la entidad y existen evidencias suficientes de que la entidad se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.
e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.
f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

(v) Impuestos a la utilidad y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU)

El impuesto a la utilidad y la PTU causados en el año, se determinan conforme a las disposiciones fiscales y legales vigentes.

El impuesto a la utilidad diferidos y la PTU diferida se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad y PTU diferidos (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas, y en el caso de impuestos a la utilidad, por las pérdidas fiscales por amortizar y otros créditos fiscales por recuperar.

Los activos y pasivos por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas fiscales sobre los impuestos a la utilidad y PTU diferidos se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por PTU diferida se reconoce en el rubro de “Otros activos”, en tanto que la PTU causada se reconoce en el rubro de “Beneficios a empleados” en el estado de situación financiera consolidado.

El activo por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se evalúan periódicamente creando, en su caso una reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los ORI. La PTU causada y diferida se incorporará dentro del rubro de “Gastos de administración y promoción” en el estado consolidado de resultado integral.

(w) Otros activos

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se

capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la administración del Banco.

Ante la presencia de algún indicio de deterioro del valor de un activo, se determina la posible pérdida por deterioro, y en caso de que el valor de recuperación sea menor al valor neto en libros se reduce el valor del activo y se reconoce la pérdida por deterioro en los resultados del ejercicio.

(x) Captación tradicional

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del público en general y los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos en moneda nacional, extranjera o UDIS, mismos que se integran como se describe a continuación:

a) Depósitos de exigibilidad inmediata. Incluyen a las cuentas de cheques, cuentas de ahorro, a los depósitos en cuenta corriente, entre otros.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes del Banco, que no cuentan con una línea de crédito para tales efectos, se clasifican como adeudos vencidos en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y el Banco constituye simultáneamente a dicha clasificación una estimación de irrecuperabilidad por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

b) Depósitos a plazo. Incluyen, entre otros, a los certificados de depósito retirables en días preestablecidos, aceptaciones bancarias y pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento captados del público en general y a través de operaciones en el mercado de dinero, estos últimos referidos a depósitos a plazo realizados con otros intermediarios financieros, así como con tesorerías de empresas y de entidades gubernamentales.

c) Títulos de crédito. Se integran de, entre otros, los bonos bancarios y los certificados bursátiles.

d) Cuenta global de captación sin movimientos. Incluye el principal y los intereses de los instrumentos de captación que no tengan fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven en forma automática, así como las transferencias o las inversiones vencidas y no reclamadas.

Si en el transcurso de tres años contados a partir de que los recursos se depositen en la cuenta global de captación sin movimientos, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública, El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto anteriormente descrito.

Los títulos colocados a descuento que no devenguen intereses (cupón cero), se registran al momento de la emisión tomando como base el monto de efectivo recibido.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva con base en lo establecido en la NIF C-19 "Instrumentos Financieros por pagar" y evaluar si la tasa determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso. Sólo en caso de que la tasa de interés de mercado sea sustancialmente distinta a la tasa efectiva, debe utilizarse la tasa de mercado

como la tasa de interés efectiva en la valuación del instrumento, reconociendo en la utilidad o pérdida neta los efectos que se produzcan en el valor del IFP por el cambio de tasa de interés.

Los intereses de captación tradicional se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos de emisión, así como el descuento o premio en la colocación se reconocen como un cargo o crédito diferido, según se trate, el cual es amortizado en resultados conforme se devengue como gastos o ingresos por intereses, según corresponda, tomando en consideración el plazo del título que le dio origen en proporción al vencimiento de los títulos.

(y)Obligaciones subordinadas en circulación

Por las obligaciones subordinadas en circulación reúnen las características establecidas por la NIF
C-12 "Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital", el principal del instrumento es clasificado como pasivo dentro del estado de situación financiera consolidado. Los intereses se reconocen conforme al método de interés efectivo en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos que se incurran para emitir un instrumento financiero que califica como un pasivo deben deducirse del monto del pasivo y deben considerarse para determinar la tasa de interés efectiva.

(z)Préstamos interbancarios y de otros organismos

En este rubro se registran los préstamos directos de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento. Asimismo, incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".
Los préstamos deberán reconocerse inicialmente al precio de la transacción, deben sumarse o restarse los costos de transacción, así como otras partidas pagadas por anticipado, tales como comisiones e intereses, el Banco deberá determinar el valor futuro de los flujos de efectivo estimados que se pagarán por principal e intereses contractuales, durante el plazo remanente del préstamo o en un plazo menor, si es que existe una probabilidad de prepago u otra circunstancia que requiera utilizar un plazo menor.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva, para el cálculo el Banco debe estimar los flujos de efectivo esperados considerando todos los términos contractuales del IFP (tales como prepago, extensión, reembolso anticipado y otras opciones similares), adicionalmente, debe evaluar si la tasa de interés efectiva determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso la entidad.

Si el Banco recibe un préstamo con una tasa de interés contractual que esté sustancialmente fuera de mercado, pero se paga una comisión por adelantado al inicio del crédito al determinar la tasa de interés efectiva con base en los anteriores párrafos, y debe tomarse en cuenta dicha comisión.

(aa)Acreedores diversos y otras cuentas por pagar

Los acreedores diversos y otras cuentas por pagar incluyen el pasivo por beneficios a los empleados de corto y largo plazo, provisiones y otras cuentas por pagar por la prestación de servicios bancarios comisiones por pagar, acreedores por adquisición de activos, dividendos por pagar, IVA trasladado y otros impuestos y derechos por pagar.

Los pasivos del Banco se valúan y reconocen en el estado de situación financiera consolidado, para tal efecto deberán cumplir con la característica de ser una obligación presente, donde la transferencia de activos o presentación de servicios sea virtualmente ineludible, surja como consecuencia de un evento pasado y su cuantía y vencimiento se encuentran claramente establecidos.

El Banco reconoce una provisión cuando su cuantía o vencimientos son inciertos y se cumplen las siguientes condiciones: a) existe una obligación presente resultante de un evento pasado a cargo de la entidad, b) es probable que se presente la salida de recursos económicos como medio para liquidar dicha obligación y c) la obligación puede ser estimada razonablemente.

De no cumplirse las condiciones antes mencionadas, no se reconoce una provisión.

(bb)Beneficios a los empleados

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que devengan los servicios prestados. Se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Banco en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida- ver inciso (v) de esa nota y que se espera que el Banco pague después de los doce meses de la fecha del estado de situación financiera consolidado más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que los empleados han obtenido a cambio de su servicio en el ejercicio actual y en los anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las remediciones se reconocen en resultados en el período en que se devengan.

Beneficios por terminación

Se reconoce un pasivo y un costo o gasto por beneficios por terminación cuando el Banco no tiene alternativa realista diferente que la de afrontar los pagos o no pueda retirar la oferta de esos beneficios, o cuando cumple con las condiciones para reconocer los costos de una reestructuración, lo que ocurra primero. Si no se espera que se liquiden dentro de los 12 meses posteriores al cierre del ejercicio anual, entonces se descuentan.

Beneficios post-empleo

Planes de contribución definida

La obligación neta del Banco correspondiente a los planes de beneficios definidos por

planes de pensiones y prima de antigüedad, se calcula de forma separada para cada plan, estimando el monto de los beneficios futuros que los empleados han ganado en el ejercicio actual y en ejercicios anteriores, descontando dicho monto y deduciendo al mismo, el valor razonable de los activos del plan. El Banco mantiene un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocían directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción". Las contribuciones pagadas por anticipado se reconocen como un activo en la medida en que el pago por anticipado de lugar a una reducción en los pagos a efectuar en el futuro o a un reembolso en efectivo (nota 20).

Planes de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos se realiza anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el período, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del período.

Las remediciones (antes ganancias y pérdidas actuariales), resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable.

(cc)Reconocimiento de ingresos

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan.

Los intereses devengados sobre cartera en Etapa 3 se reconocen en resultados hasta que se cobran.
Los intereses y comisiones cobradas por anticipado se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a resultados conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial de un crédito se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses durante la vida del crédito. Las comisiones por anualidad y renovación de productos de cartera comercial, consumo y vivienda se difieren en un período de 12 a 360 meses, según corresponda, asimismo, los costos o gastos vinculados con el otorgamiento de créditos, se reconocen como un cargo diferido y se difieren durante el mismo plazo en el que se reconozcan los ingresos derivados por las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial del crédito; el seguro que en su caso sea financiado forma parte de la cartera de crédito.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento de crédito se presentan de manera neta de los costos y gastos asociados, presentándose en el rubro de otros activos, o bien de créditos diferidos y cobros anticipados según corresponda su naturaleza deudora o acreedora.

Las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos se adicionan a las comisiones originadas por el otorgamiento del crédito y se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito. Las demás comisiones se reconocen en el momento en que se generan en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Los intereses por inversiones en títulos de renta fija se reconocen en resultados conforme se devengan conforme al método de interés efectivo. Los intereses cobrados por operaciones de reporto se reconocen en resultados de acuerdo con el método de interés efectivo, a lo largo del plazo de la operación.

Las comisiones ganadas por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devengan.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes se reconocen en los resultados conforme se devengan.

(dd)Concentración de negocio y crédito

Los productos del Banco se comercializan con un gran número de clientes, sin que exista concentración importante en algún cliente específico.

(ee)Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que pretende un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regula los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo. De acuerdo con dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400,000 UDIS por persona física o moral. El Banco reconoce en resultados del ejercicio las aportaciones obligatorias al IPAB.

Las aportaciones obligatorias al IPAB se deberán cubrir mensualmente y serán por un monto equivalente a la duodécima parte del cuatro al millar, sobre el promedio mensual

de los saldos diarios de sus operaciones pasivas del mes de que se trate.

(ff) Cuentas de orden

En las cuentas de orden se registran activos o compromisos que no forman parte del estado de situación financiera consolidado del Banco ya que no se adquieren los derechos de estos o dichos compromisos no se reconocen como pasivo de las entidades en tanto dichas eventualidades no se materialicen, respectivamente.

–Compromisos crediticios:

El saldo representa el importe de cartas de crédito otorgadas por el Banco que son consideradas como créditos comerciales irrevocables no dispuestos por los acreditados y líneas de crédito autorizadas no ejercidas.

Las partidas registradas en esta cuenta están sujetas a calificación.

–Bienes en fideicomiso o mandato:

El Banco registra en cuentas de orden las operaciones de Bienes o Fideicomisos acorde a lo siguiente:

•Las que se limita al reconocimiento del patrimonio fideicomitido (activos del contrato), es decir, el valor de los bienes recibidos en fideicomiso netos de los pasivos, llevándose en registros independientes los datos relacionados con la administración de cada fideicomiso.

•Las que por sus activos y pasivos resultan de las operaciones y cuyo reconocimiento y valuación se efectúa conforme a lo dispuesto en los criterios contables específicos aplicables al Banco.

Las pérdidas a cargo del Banco por las responsabilidades en que haya incurrido como fiduciario, se reconocen en resultados en el período en el que éstas se conozcan, independientemente del momento en el que se realice cualquier promoción jurídica al efecto.

La unidad fiduciaria mantiene contabilidades especiales por cada contrato en el sistema fiduciario, y registra en las mismas y en su propia contabilidad el dinero y demás bienes, valores o derechos que se les confíen, así como los incrementos o disminuciones, por los productos o gastos respectivos, invariablemente los saldos de las contabilidades especiales de cada contrato de fideicomiso coinciden con los saldos de las cuentas de orden en que el Banco reconoce el patrimonio fideicomitido.

En ningún caso estos bienes estarán afectos a otras responsabilidades que las derivadas del fideicomiso mismo, o las que contra ellos corresponda a terceros de acuerdo con la Ley.

Cuando por la naturaleza de los fideicomisos establecidos en el Banco existan activos o pasivos a cargo o a favor de este, éstos se reconocen en el estado de situación financiera consolidado, según corresponda.

En el mandato se registra el valor declarado de los bienes objeto de los contratos de mandato celebrados por el Banco.

El reconocimiento de los ingresos por manejo de los fideicomisos se reconoce con base

en lo devengado. Se suspende la acumulación de dichos ingresos, en el momento en que el adeudo por éstos presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, pudiendo volver a acumularse cuando el adeudo pendiente de pago sea liquidado en su totalidad.

En tanto los ingresos devengados por manejo de los fideicomisos se encuentren suspendidos de acumulación y no sean cobrados, el control de estos se lleva en cuentas de orden. En caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

–Bienes en custodia o en administración:

El efectivo y los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración se reflejan en las cuentas de orden respectivas y son valuados con base en el precio proporcionado por el proveedor de precios. Con excepción del efectivo o los activos virtuales recibidos para el pago de servicios por cuenta de terceros, debiéndose presentar en el rubro de efectivo y equivalentes de efectivo o en el de activos virtuales, según corresponda y, el pasivo que se genere, en el rubro de otras cuentas por pagar.

Los valores en custodia y administración están depositados en la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S. A. de C. V.

Los ingresos derivados de los servicios de custodia o administración reconocidos en los resultados del ejercicio se presentarán en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

–Colaterales recibidos por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos en operaciones de reporto y préstamo de valores actuando el Banco como reportadora o prestataria.

–Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía, cuando el Banco actúe como reportadora o prestataria.

–Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito en Etapa 3:

Se registran los intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3, el monto de los intereses devengados no cobrados derivados de los créditos que se mantengan en cartera con riesgo de crédito Etapa 3.

–Otras cuentas de registro:

Al 31 de diciembre de 2022, las otras cuentas de registro presentan un saldo de $1,669,462 que se integran principalmente por guardavalores por el Banco.

(gg)Contingencias

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos, utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

(3) Pronunciamientos normativos emitidos recientemente

Mejoras a las NIF 2023

En diciembre de 2022 el CINIF emitió el documento llamado "Mejoras a las NIF 2023", que contiene modificaciones puntuales a algunas NIF ya existentes. Las principales mejoras no generaron cambios contables para el Banco.

ANEXO 1

Anexo - Desglose de créditosMoneda nacional [miembro]Moneda nacional [miembro]Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Acumulado Actual
(Cifras en pesos)
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Tipo de Crédito / InstituciónAño actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Desglose de créditos [partidas]
Bancarios [sinopsis]

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Con garantía (bancarios)

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Banca comercial
Export Development Canada (EDC)Si08/07/202006/08/20235.16543 + 0.66 SPREAD / VARIABLE USD LIBOR 6M 1,825,920,933.76
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 22/08/202221/08/20234.80364 + 0.71 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 2,719,160,405.93
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 06/10/202203/07/20234.60419 + 0.5 SPREAD / VARIABLE USD TSOFR 3M 2,735,590,546.70
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 21/10/202220/10/20234.65347 + 0.78 SPREAD / VARIABLE USD TSOFR 3M 1,820,504,427.07
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si29/11/202230/06/20235.3437 / FIJA USD FIXED 1,376,182,839.64

TOTAL - - - - - - 10,477,359,153.11 - - - - -
Otros bancarios
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202020/02/20244.1274 + 0.43 SPREAD / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,500,823,430.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202020/03/20244.1274 + 0.43 SPREAD / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,500,823,430.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/11/20244.1274 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN

TIIE 28D EOM 2,500,817,875.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/09/202411.4274 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN
TIIE 28D EOM 2,500,817,875.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/201925/07/202411.4274 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN
TIIE 28D EOM 2,500,817,875.00
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo14/12/201702/12/20278.48 + 0
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,026,853,333.33
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo23/04/201814/04/20258.41 + 0
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,038,779,444.44
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo29/08/201823/08/20238.89 + 0
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,514,075,833.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/201828/12/202311.4986
Tasa Fija 8,010,220.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202105/07/20245.33 Tasa
Fija 4,955,737.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202026/03/20256.76 Tasa
Fija 2,760,907.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/01/202105/01/202411.385
Tasa Fija 1,400,856.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202015/11/202311.4245
Tasa Fija 611,223.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/04/202128/04/202611.4986
Tasa Fija 1,659,328.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa
Fija 160,530.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa
Fija 1,242,675.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202109/09/202611.414
Tasa Fija 141,542,013.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202126/05/202611.4874
Tasa Fija 6,965,094.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/01/202126/01/202411.4986
Tasa Fija 4,175,196.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202130/04/20245.87 Tasa
Fija 123,411,064.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202021/08/20235.69 Tasa
Fija 1,253,832.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202029/09/20235.78 Tasa
Fija 1,952,527.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202029/09/20235.78 Tasa
Fija 7,207,991.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202029/09/20235.59 Tasa
Fija 8,498,124.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202128/02/202511.895
Tasa Fija 2,020,924.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/202611.4874
Tasa Fija 9,245,006.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/201930/09/202311.5274
Tasa Fija 6,008,147.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202107/04/202511.385
Tasa Fija 11,192,110.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/201826/06/202311.4874
Tasa Fija 73,521.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202021/04/202311.3823
Tasa Fija 675,525.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202014/03/202311.3349

Tasa Fija 1,071.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202008/01/202411.396
Tasa Fija 3,239,511.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201817/10/202311.5274
Tasa Fija 10,145,819.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/201926/06/202311.4874
Tasa Fija 107,430.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/201826/06/202311.4874
Tasa Fija 135,242.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/201817/08/202311.494
Tasa Fija 405,491.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202006/09/202411.3823
Tasa Fija 339,791.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202030/05/20235.38 Tasa
Fija 1,714,494.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202030/05/20235.38 Tasa
Fija 2,245,003.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202007/05/202511.385
Tasa Fija 3,275,695.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202114/09/20267.17 Tasa
Fija 5,170,958.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54 Tasa
Fija 13,165,767.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/07/202109/07/20267.04 Tasa
Fija 3,266,034.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202025/09/202411.4874
Tasa Fija 1,295,183.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202125/09/202411.4874
Tasa Fija 2,351,819.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202115/05/202511.4245
Tasa Fija 518,993.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa
Fija 11,618,833.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202114/09/20266.57 Tasa
Fija 9,792,546.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/04/201928/04/202311.5035
Tasa Fija 235,621.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202129/06/202611.5149
Tasa Fija 88,456,550.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201927/09/202411.5274
Tasa Fija 3,601,152.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202115/07/202611.4245
Tasa Fija 258,146,200.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202106/09/202411.3823
Tasa Fija 523,254.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202118/02/202611.45 Tasa
Fija 33,951,702.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201928/06/202411.5274
Tasa Fija 2,464,951.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202026/11/202411.4874
Tasa Fija 1,384,022.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202120/05/202611.45 Tasa
Fija 190,664,736.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202027/03/20255.66 Tasa
Fija 3,247,376.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/202611.5274

Tasa Fija 58,172,467.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/201917/10/202411.4474 Tasa Fija 4,203,286.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/10/202030/10/202511.5149 Tasa Fija 65,518,076.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202130/04/20266.28 Tasa Fija 7,481,066.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/201830/11/202311.5274 Tasa Fija 20,246,480.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202004/11/202511.3823 Tasa Fija 54,584,442.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa Fija 12,349,288.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa Fija 33,185,008.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/07/202115/07/202511.4245 Tasa Fija 2,345,921.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa Fija 1,245,726.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa Fija 1,920,567.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/201823/05/202311.5274 Tasa Fija 19,798,023.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/201824/05/202311.4749 Tasa Fija 474,892.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/201913/10/202311.4245 Tasa Fija 199,843.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.396 Tasa Fija 140,148,942.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202119/11/202512.5149 Tasa Fija 90,729,704.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.396 Tasa Fija 53,571,479.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 40,008,211.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 40,008,211.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201829/09/202311.5274 Tasa Fija 3,847,385.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/05/202031/05/202311.5274 Tasa Fija 27,180.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202029/02/202411.5274 Tasa Fija 233,662.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/11/202129/07/202611.5035 Tasa Fija 12,643,687.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202130/04/20266.28 Tasa Fija 7,045,276.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/12/202311.6974 Tasa Fija 104,761.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.5184 Tasa Fija 434,305.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.5184 Tasa Fija 620,400.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/09/202311.6899 Tasa Fija 727,745.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201928/06/202411.5274

Tasa Fija 25,743,534.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202001/12/202311.374
Tasa Fija 1,009,794.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202031/05/202411.5184
Tasa Fija 529,840.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202030/11/202311.5274
Tasa Fija 3,719,837.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/202311.4195
Tasa Fija 371,710.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202006/09/202411.3823
Tasa Fija 214,844.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/202311.4195
Tasa Fija 1,347,592.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202110/03/202511.408
Tasa Fija 21,970,435.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/11/201931/05/202411.5274
Tasa Fija 6,097,785.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 143,527,590.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 157,562,286.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa
Fija 3,840,838.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 177,484,559.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202006/03/20256.07 Tasa
Fija 5,441,283.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202030/06/202311.6974
Tasa Fija 342,717.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202225/09/202411.4874
Tasa Fija 3,774,081.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202030/11/202311.5274
Tasa Fija 3,719,837.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202020/06/202511.455
Tasa Fija 4,514,318.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202028/11/202511.5274
Tasa Fija 11,030,305.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202025/09/202411.4874
Tasa Fija 3,144,907.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.5274
Tasa Fija 317,954,153.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202129/12/202311.5274
Tasa Fija 60,877,111.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/11/201902/06/202311.3675
Tasa Fija 77,471.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.22029
Tasa Fija 6,394,297.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.5274
Tasa Fija 107,175,557.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.22029
Tasa Fija 1,225,838.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201920/11/202311.45 Tasa
Fija 4,181,244.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.22029
Tasa Fija 596,041.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201931/10/202411.5274

Tasa Fija 1,900,608.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20255.41029
Tasa Fija 580,724.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20255.74029
Tasa Fija 526,416.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202026/06/202511.4874
Tasa Fija 9,014,359.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202023/06/202311.4874
Tasa Fija 5,007,977.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5274
Tasa Fija 2,603,040.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5274
Tasa Fija 12,249,537.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5274
Tasa Fija 1,592,065.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5274
Tasa Fija 932,662.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5274
Tasa Fija 341,263.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5274
Tasa Fija 3,282,671.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5274
Tasa Fija 9,432,364.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/11/201926/11/202411.4874
Tasa Fija 5,007,977.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/06/202029/09/202311.5274
Tasa Fija 20,197,725.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202019/12/202511.45 Tasa
Fija 62,216,913.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/01/201929/09/202311.5274
Tasa Fija 1,923,692.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.4874
Tasa Fija 23,637,653.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.5149
Tasa Fija 24,015,353.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.4874
Tasa Fija 24,038,291.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.4874
Tasa Fija 24,038,291.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/201827/04/202311.4874
Tasa Fija 921,601.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202115/05/202511.4245
Tasa Fija 1,089,177.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54 Tasa
Fija 4,770,407.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/201720/12/20237.62 Tasa
Fija 4,409,125.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/201928/06/202411.5274
Tasa Fija 14,710,591.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202006/09/202411.3823
Tasa Fija 353,994.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/08/202123/04/202611.465
Tasa Fija 1,577,007.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/201928/06/202411.5274
Tasa Fija 14,710,591.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201915/12/202311.4245

Tasa Fija 342,713.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202110/06/202511.408
Tasa Fija 4,101,276.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202129/07/202611.5035
Tasa Fija 12,011,503.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201928/06/202411.5274
Tasa Fija 5,850,541.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201917/10/202411.4474
Tasa Fija 2,903,480.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201928/06/202411.5274
Tasa Fija 4,045,412.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202020/08/20255.77 Tasa
Fija 19,367,418.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202025/08/202511.4874
Tasa Fija 6,319,590.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/08/202026/08/202511.5274
Tasa Fija 16,096,769.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/201929/11/202411.5274
Tasa Fija 5,001,601.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202131/03/202611.5274
Tasa Fija 6,302,017.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202130/01/202611.3675
Tasa Fija 11,777,184.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202006/03/20255.51 Tasa
Fija 3,744,173.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202101/04/202611.3823
Tasa Fija 87,043,040.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/201815/06/202311.4245
Tasa Fija 36,613,798.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201929/01/202411.5035
Tasa Fija 117,113,524.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202117/06/20266.29 Tasa
Fija 14,641,606.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/09/202029/08/202311.5035
Tasa Fija 8,603,477.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 1,771,643.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 2,279,767.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202019/09/202511.45 Tasa
Fija 5,017,493.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202012/01/202411.414
Tasa Fija 10,221,447.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 926,674.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202019/09/202511.45 Tasa
Fija 5,017,493.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/201902/06/202311.3675
Tasa Fija 315,460.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/201902/06/202311.3675
Tasa Fija 69,401.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202024/09/202511.4749
Tasa Fija 17,254,103.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202016/01/202511.4372
Tasa Fija 26,206,613.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202024/09/20255.827 Tasa

Fija 16,298,324.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202006/12/202411.3823
Tasa Fija 9,073,984.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/06/201902/06/202311.3675
Tasa Fija 252,368.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202026/01/202411.4874
Tasa Fija 1,460,660.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa
Fija 1,398,942.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa
Fija 11,460,385.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202118/02/202611.45 Tasa
Fija 30,098,184.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201829/12/202311.5274
Tasa Fija 8,852,833.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/201829/12/202311.5274
Tasa Fija 15,004,803.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202017/10/202411.4474
Tasa Fija 2,627,415.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202115/04/202511.4245
Tasa Fija 1,178,197.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202026/11/202411.4874
Tasa Fija 5,693,279.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202006/09/202411.3823
Tasa Fija 433,297.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201919/02/20245.64771
Tasa Fija 9,928,159.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202010/01/20256.00986
Tasa Fija 6,934,774.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202123/04/202611.465
Tasa Fija 10,896,810.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/201931/05/202411.5274
Tasa Fija 1,691,444.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/08/201831/07/20238.39 Tasa
Fija 640,149.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202028/06/202411.5274
Tasa Fija 8,260,824.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202031/03/202511.5274
Tasa Fija 64,145,231.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202004/04/202511.3823
Tasa Fija 6,301,378.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202014/11/202311.4195
Tasa Fija 5,681,841.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.4372
Tasa Fija 6,737,826.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.4372
Tasa Fija 5,948,375.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202025/10/202411.4874
Tasa Fija 3,549,403.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa
Fija 1,034,648.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa
Fija 3,004,653.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa
Fija 2,429,159.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/201931/05/202411.5274

Tasa Fija 34,602,743.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/07/202103/07/202311.5274
Tasa Fija 18,005,763.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/201829/12/202311.5274
Tasa Fija 45,220,725.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202107/05/202611.385
Tasa Fija 31,917,031.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202115/04/202511.4245
Tasa Fija 2,880,037.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/06/201914/12/202311.4195
Tasa Fija 2,047,922.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/07/201928/06/202411.5274
Tasa Fija 46,300,410.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5274
Tasa Fija 4,129,597.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5274
Tasa Fija 3,475,684.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5274
Tasa Fija 758,576.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5274
Tasa Fija 13,393,105.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201831/08/202311.5274
Tasa Fija 88,928.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201831/08/202311.5274
Tasa Fija 59,318.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/201928/06/202411.5274
Tasa Fija 4,350,879.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/201831/08/20238.54 Tasa
Fija 92,622.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/201928/06/202411.5274
Tasa Fija 4,927,842.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201829/12/202311.5274
Tasa Fija 8,252,641.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/201829/09/202311.5274
Tasa Fija 9,618,463.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/201931/07/202411.5274
Tasa Fija 533,504.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/08/201929/08/202311.5274
Tasa Fija 47,649,312.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/09/201915/09/202311.4245
Tasa Fija 456,951.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.4245
Tasa Fija 301,618.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.4245
Tasa Fija 6,968,426.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.4245
Tasa Fija 7,280,445.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.4245
Tasa Fija 2,080,127.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.4245
Tasa Fija 2,080,127.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.4245
Tasa Fija 2,080,127.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/201931/05/202411.5274
Tasa Fija 17,651,483.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202229/01/20278.07 Tasa

Fija 53,345,288.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 69,399,623.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 30,793,525.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 12,456,107.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 7,330,799.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 62,068,824.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202212/02/202711.4195 Tasa Fija 78,780,597.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202217/02/202711.4474 Tasa Fija 38,624,432.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202220/12/20287.4 Tasa Fija 28,367,460.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/03/202231/08/202512.6484 Tasa Fija 20,280,543.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202217/04/202611.6 Tasa Fija 13,305,326.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202228/04/202311.5274 Tasa Fija 18,756,003.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202228/04/202311.5274 Tasa Fija 7,502,401.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202215/05/202611.4245 Tasa Fija 1,591,875.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202228/04/202311.5274 Tasa Fija 4,168,000.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202228/04/202311.5274 Tasa Fija 4,168,000.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202203/06/202711.5475 Tasa Fija 17,158,136.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202202/06/202311.5274 Tasa Fija 18,756,003.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202231/05/202311.5274 Tasa Fija 8,336,001.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202206/06/202511.5123 Tasa Fija 47,614,848.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/202224/06/202611.6486 Tasa Fija 71,999,476.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202205/07/202711.5523 Tasa Fija 21,847,438.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202224/06/202611.6486 Tasa Fija 17,522,650.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/07/202230/06/202311.5149 Tasa Fija 3,001,919.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/07/202206/07/202311.5274 Tasa Fija 18,756,003.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202224/07/202311.5274 Tasa Fija 50,016,010.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.43557 Tasa Fija 10,277,660.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.43557 Tasa Fija 9,285,956.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/08/202204/08/202311.5274

Tasa Fija 18,756,003.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/08/202225/08/202311.5274
Tasa Fija 18,756,003.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202215/02/202411.4745
Tasa Fija 983,075.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202205/04/202311.3823
Tasa Fija 1,088,878.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/09/202228/08/202611.6649
Tasa Fija 28,205,766.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202208/09/202311.5274
Tasa Fija 15,004,803.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/202215/09/202611.5745
Tasa Fija 5,278,695.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202215/09/202311.5274
Tasa Fija 15,004,803.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202206/09/202311.3823
Tasa Fija 3,024,661.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.625
Tasa Fija 5,510,902.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.625
Tasa Fija 110,218,048.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.625
Tasa Fija 141,446,495.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/09/202218/09/202311.45 Tasa
Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/10/202202/05/202311.3675
Tasa Fija 1,130,609.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202203/04/202311.3775
Tasa Fija 1,766,039.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/10/202204/04/202311.3823
Tasa Fija 1,764,385.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202204/04/202312.1885 Tasa Fija 288,574.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202204/04/202312.1885 Tasa Fija 30,403.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202204/04/202312.1885 Tasa Fija 26,255.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/10/202204/04/202312.1885 Tasa Fija 574,189.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/10/202205/04/202311.3823
Tasa Fija 1,764,385.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/10/202203/04/202311.3775
Tasa Fija 5,045,826.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/10/202205/04/202311.5274
Tasa Fija 2,500,800.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/10/202203/04/202311.5274
Tasa Fija 7,164,293.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202204/04/202311.3823
Tasa Fija 1,764,385.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/202204/04/202311.3823
Tasa Fija 5,041,102.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/10/202204/04/202312.2248 Tasa Fija 73,738.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/10/202205/04/202311.3823
Tasa Fija 1,764,385.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/10/202205/04/202312.2331 Tasa Fija 1,163,251.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/10/202204/04/202312.2356 Tasa Fija 7,801.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/10/202211/04/202311.414
Tasa Fija 5,030,120.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202210/04/202312.2461 Tasa Fija 4,686,940.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202211/04/202312.2461 Tasa Fija 15,552.93

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202211/04/202312.2461 Tasa Fija 4,263.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202211/04/202312.2461 Tasa Fija 134,978.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202205/04/202312.2461 Tasa Fija 558,899.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/10/202211/04/202312.2461 Tasa Fija 87,493.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/10/202212/04/202311.414
Tasa Fija 5,030,120.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202211/04/202312.3277 Tasa Fija 21,620.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202211/04/202312.3277 Tasa Fija 38,618.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202214/04/202311.4195
Tasa Fija 5,028,548.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/10/202214/04/202312.3277 Tasa Fija 701,239.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202215/10/202711.6174
Tasa Fija 136,685,543.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/10/202204/04/202312.4306 Tasa Fija 73,573.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202214/04/202312.4519 Tasa Fija 704,231.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/10/202211/04/202312.4519 Tasa Fija 116,562.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202218/04/202312.4814 Tasa Fija 508,508.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202213/04/202312.4814 Tasa Fija 1,036,019.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202213/04/202312.4814 Tasa Fija 5,875,096.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202218/04/202312.4814 Tasa Fija 18,704.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202213/04/202312.4814 Tasa Fija 381,981.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202218/04/202312.4814 Tasa Fija 120,195.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/10/202214/04/202312.4814 Tasa Fija 191,726.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/10/202214/04/202312.508 Tasa Fija 157,899.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/10/202213/04/202312.508 Tasa Fija 31,033.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/10/202221/04/202311.5274
Tasa Fija 4,001,280.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/10/202218/04/202312.5574 Tasa Fija 9,005.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/10/202221/04/202312.5574 Tasa Fija 1,707,716.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202211/04/202312.5581 Tasa Fija 30,849.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/10/202221/04/202312.5581 Tasa Fija 1,932,812.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/202205/04/202311.5274
Tasa Fija 391,125.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202217/04/202312.5399 Tasa Fija 6,308.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/10/202213/04/202312.5399 Tasa Fija 208,100.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/10/202225/05/202311.4874
Tasa Fija 1,221,946.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/10/202225/04/20235.12702
Tasa Fija 53,165,944.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202225/04/202312.5325 Tasa Fija 618,800.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202220/04/202312.5325 Tasa Fija 3,242,094.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202225/04/202312.5325 Tasa Fija 10,044.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202225/04/202312.5325 Tasa Fija 6,751.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202220/04/202312.5325 Tasa Fija 1,033,321.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202220/04/202312.5325 Tasa Fija 4,324,366.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/10/202225/04/202312.5325 Tasa Fija 85,980.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202225/04/202312.5225 Tasa Fija 176,407.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/10/202213/04/202312.5225 Tasa Fija 137,714.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/10/202228/04/202311.5274
Tasa Fija 2,000,640.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/10/202231/07/202311.0937
Tasa Fija 7,371,044.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/10/202228/04/202311.4986
Tasa Fija 1,752,235.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/11/202230/05/202311.5149
Tasa Fija 190,121.55

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202211/04/202312.5689 Tasa Fija 29,518.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/11/202202/05/202312.5689 Tasa Fija 298,309.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202202/05/202312.5571 Tasa Fija 488,650.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202202/05/202312.5571 Tasa Fija 9,308.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202202/05/202312.5571 Tasa Fija 611,176.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202202/05/202312.5571 Tasa Fija 35,760.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202220/04/202312.5571 Tasa Fija 1,276,925.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/11/202227/04/202312.5571 Tasa Fija 6,494,016.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202218/04/202312.608 Tasa Fija 122,725.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202213/04/202312.608 Tasa Fija 104,595.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/11/202202/05/202312.608 Tasa Fija 102,748.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202204/05/202311.3823 Tasa Fija 2,016,441.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202231/10/202311.5274 Tasa Fija 2,000,640.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202205/05/202311.3823 Tasa Fija 4,032,882.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202205/05/202311.3823 Tasa Fija 4,708,389.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202204/04/202312.5968 Tasa Fija 194,843.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/11/202202/05/202312.5968 Tasa Fija 89,437.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/202205/05/202311.3823 Tasa Fija 2,016,441.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202205/04/202312.612 Tasa Fija 38,955.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202208/05/202311.396 Tasa Fija 1,721,012.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202208/05/202311.5274 Tasa Fija 2,000,640.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/11/202225/04/202312.612 Tasa Fija 46,914.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202205/04/202311.5274 Tasa Fija 7,552,417.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202208/05/202311.396 Tasa Fija 8,060,778.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202205/04/202312.5924 Tasa Fija 139,461.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/11/202208/05/202312.5924 Tasa Fija 155,778.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202209/05/202311.3962 Tasa Fija 8,058,247.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202211/10/202711.564 Tasa Fija 24,473,460.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202209/05/202312.5405 Tasa Fija 91,292.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202209/05/202312.5405 Tasa Fija 38,264.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202227/04/202312.5405 Tasa Fija 344,537.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202204/05/202312.5405 Tasa Fija 264,612.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202204/05/202312.5405 Tasa Fija 4,159,055.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202210/05/202311.408 Tasa Fija 8,055,772.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202227/04/202312.5405 Tasa Fija 239,428.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202204/05/202312.5405 Tasa Fija 2,561,655.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/11/202210/05/202311.408 Tasa Fija 11,076,687.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202216/12/202211.37 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202225/04/202312.4794 Tasa Fija 392,830.93

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202211/05/202311.414 Tasa Fija 15,090,360.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202211/05/202311.414 Tasa Fija 8,048,192.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202212/05/202311.414 Tasa Fija 3,018,072.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/11/202212/06/202311.414 Tasa Fija 402,409.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202212/05/202311.414 Tasa Fija 15,090,360.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202212/05/202311.5274 Tasa Fija 4,001,280.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202212/05/202311.414 Tasa Fija 8,048,192.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202212/05/202311.5274 Tasa Fija 100,032,020.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/11/202205/05/202311.3823 Tasa Fija 35,920,700.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202209/05/202312.6041 Tasa Fija 4,371.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202215/05/202311.4245 Tasa Fija 15,080,923.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202216/12/202211.3957 Tasa Fija
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202218/04/202312.6041 Tasa Fija 318,067.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/11/202215/05/202311.4245 Tasa Fija 8,043,159.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202202/05/202312.6416 Tasa Fija 43,939.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202216/05/202311.4372 Tasa Fija 5,025,416.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/11/202209/05/202312.6416 Tasa Fija 273,765.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/11/202210/05/202311.408 Tasa Fija 35,143,307.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202202/05/202312.6503 Tasa Fija 82,475.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503 Tasa Fija 357,318.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503 Tasa Fija 54,601.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503 Tasa Fija 161,842.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503 Tasa Fija 382,928.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/11/202216/05/202312.6503 Tasa Fija 26,607.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202202/05/202312.7027 Tasa Fija 43,953.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202211/05/202312.7027 Tasa Fija 98,812.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/11/202211/05/202312.7027 Tasa Fija 3,847,249.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/11/202219/05/202311.45 Tasa Fija 15,052,479.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/11/202217/05/20235.21702 Tasa Fija 3,964,944.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/11/202209/05/202312.8045 Tasa Fija 33,494.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202222/05/202311.455 Tasa Fija 15,047,729.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202222/05/202311.455 Tasa Fija 9,028,637.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202222/05/20235.22929 Tasa Fija 9,021,829.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202222/05/202311.5274 Tasa Fija 2,360,755.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202218/05/202311.45 Tasa

Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202218/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202218/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/11/202218/05/202311.45 Tasa Fija 4,013,994.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202202/05/202312.8038 Tasa Fija 159,537.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202219/05/202312.8038 Tasa Fija 90,254.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202223/05/202311.465 Tasa Fija 3,510,031.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/11/202216/05/202312.8038 Tasa Fija 75,015.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202218/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202205/05/202311.3823 Tasa Fija 5,170,154.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202218/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202218/05/202311.45 Tasa Fija 5,012,475.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202218/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202214/04/202312.8165 Tasa Fija 153,582.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 431,525.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202218/05/202312.8165 Tasa Fija 3,506,127.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 50,750.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202203/04/202312.8165 Tasa Fija 1,188,293.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 377,397.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202211/05/202312.8165 Tasa Fija 238,208.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 85,551.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 8,453.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/202212/05/202312.8165 Tasa Fija 2,720,143.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202224/05/202311.5274 Tasa Fija 37,712,540.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202224/05/202311.4749 Tasa Fija 3,508,924.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/20235.20029 Tasa Fija 40,543,872.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202224/05/20235.157 Tasa Fija 9,020,204.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202223/05/20235.13929 Tasa Fija 9,021,626.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/202311.45 Tasa Fija 5,012,475.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202219/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202219/05/202312.8165 Tasa Fija 3,622,700.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202226/05/202312.8165 Tasa Fija 1,328,228.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202223/05/202312.8165 Tasa Fija 20,091.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/11/202226/05/202312.8165 Tasa Fija 11,832.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202225/05/202311.4874 Tasa Fija 5,007,977.36

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202224/05/202311.4749 Tasa Fija 5,007,737.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202224/05/202311.4749 Tasa Fija 5,012,749.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202224/05/202311.4749 Tasa Fija 5,012,749.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/11/202224/05/202311.4749 Tasa Fija 5,012,749.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/11/202226/05/202312.8241 Tasa Fija 324,440.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202223/10/20265.24236 Tasa Fija 80,564,753.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202228/04/202311.5274 Tasa Fija 50,016,010.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202204/05/202312.8367 Tasa Fija 528,254.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202209/05/202312.8367 Tasa Fija 29,229.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202205/04/202311.5274 Tasa Fija 22,917,189.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202228/04/202312.849 Tasa Fija 1,874.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202230/05/202311.5149 Tasa Fija 5,003,198.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/12/202209/05/202312.849 Tasa Fija 29,231.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202222/05/202312.811 Tasa Fija 1,660,963.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811 Tasa Fija 283,872.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811 Tasa Fija 26,296.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/12/202230/06/202311.5149 Tasa Fija 860,550.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811 Tasa Fija 277,910.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811 Tasa Fija 15,361.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/12/202230/05/202312.811 Tasa Fija 398,313.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/12/202225/05/202312.7876 Tasa Fija 2,353,304.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/12/202230/05/202312.7876 Tasa Fija 59,166.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/12/202211/05/202312.7876 Tasa Fija 290,276.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/12/202230/05/202312.7876 Tasa Fija 17,660.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/12/202230/05/202312.7876 Tasa Fija 11,121.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202230/11/202311.5274 Tasa Fija 33,344,006.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202202/06/202311.5274 Tasa Fija 25,008,005.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202225/04/202312.7743 Tasa Fija 19,117.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202202/06/202312.7743 Tasa Fija 1,041,418.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/12/202225/05/202312.7743 Tasa Fija 73,610.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202204/04/202311.9299 Tasa Fija 107,754.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202202/05/202312.8042 Tasa Fija 229,511.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/12/202229/05/202312.8042 Tasa Fija 1,767,445.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202205/06/20235.21143 Tasa Fija 9,045,148.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202205/07/20235.31702 Tasa Fija 27,033,983.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202202/06/202312.8071 Tasa Fija 106,577.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202216/05/202312.8071 Tasa Fija 46,031.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202219/05/202312.8071 Tasa Fija 116,531.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/12/202219/05/202312.8071 Tasa Fija 1,040,199.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202204/04/202311.5274 Tasa Fija 7,403,626.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202205/04/202311.937 Tasa Fija 443,823.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202205/04/202311.937 Tasa Fija 4,690,073.27

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202206/06/202312.8007 Tasa Fija 564,667.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202206/06/202312.8007 Tasa Fija 27,206.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202206/06/202312.8007 Tasa Fija 37,040.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202203/04/202311.937 Tasa Fija 243,212.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202205/04/202311.937 Tasa Fija 515,735.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202216/05/202312.8007 Tasa Fija 43,749.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202203/04/202311.937 Tasa Fija 194,206.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202202/06/202312.8007 Tasa Fija 1,074,818.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202203/04/202311.937 Tasa Fija 3,518,860.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202206/06/202312.8007 Tasa Fija 58,560.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/12/202205/04/202311.937 Tasa Fija 46,131.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202205/04/202311.9484 Tasa Fija 1,039,886.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484 Tasa Fija 655,143.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202205/04/202311.9484 Tasa Fija 367,429.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202205/04/202311.9484 Tasa Fija 35,432.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202209/05/202312.8042 Tasa Fija 131,516.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484 Tasa Fija 132,900.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202205/04/202311.9484 Tasa Fija 191,980.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484 Tasa Fija 3,530.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484 Tasa Fija 217,187.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202203/04/202311.9484 Tasa Fija 212,425.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/12/202230/05/202312.8042 Tasa Fija 611,201.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202209/06/202311.3962 Tasa Fija 40,291,236.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202207/04/20235.16702 Tasa Fija 31,629,814.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202212/04/20235.16702 Tasa Fija 54,068,059.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202203/04/202311.9545 Tasa Fija 160,002.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545 Tasa Fija 2,351,828.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202203/04/202311.9545 Tasa Fija 997,535.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202206/06/202312.7887 Tasa Fija 48,337.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202203/04/202311.9545 Tasa Fija 110,739.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545 Tasa Fija 29,853.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545 Tasa Fija 256,402.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545 Tasa Fija 6,865.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202205/04/202311.9545 Tasa Fija 348,329.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202201/06/202312.7887 Tasa Fija 1,154,920.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202201/06/202312.7887 Tasa Fija 202,194.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202210/04/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/12/202210/04/202311.9545 Tasa Fija 275,345.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202203/04/202311.5274 Tasa Fija 7,763,521.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202203/04/202311.9674 Tasa Fija 5,493.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202212/04/202311.9674 Tasa Fija 50,389.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202209/06/202312.775 Tasa Fija 2,951,878.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/12/202212/05/202312.775 Tasa Fija 115,387.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202211/04/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202214/04/202311.4195 Tasa Fija 1,005,709.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202205/04/202311.975 Tasa Fija 1,579.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879 Tasa Fija 115,053.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202201/06/202312.7879 Tasa Fija 1,809,154.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879 Tasa Fija 8,393.48

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202214/04/202311.4195 Tasa Fija 1,005,709.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202210/04/202311.975 Tasa Fija 619,325.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879 Tasa Fija 431,752.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879 Tasa Fija 28,708.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202211/04/202311.975 Tasa Fija 143,042.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202210/04/202311.975 Tasa Fija 159,462.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202212/04/202311.975 Tasa Fija 85,302.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202211/05/202312.7879 Tasa Fija 132,541.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202208/06/202312.7879 Tasa Fija 307,948.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202214/04/202311.975 Tasa Fija 97,745.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202210/04/202311.975 Tasa Fija 5,673,868.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202213/06/202312.7879 Tasa Fija 25,593.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/12/202202/06/202312.7879 Tasa Fija 443,754.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202212/04/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/04/202312.2125 Tasa Fija 131,612.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202212/04/202312.2125 Tasa Fija 1,112,910.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/04/202312.2125 Tasa Fija 587,636.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/04/202312.2125 Tasa Fija 390,350.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202212/04/202312.2125 Tasa Fija 87,098.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/12/202210/04/202312.2125 Tasa Fija 1,014,183.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202213/04/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202217/07/202311.4474 Tasa Fija 899,268.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija 6,004,802.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija 56,698,761.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija 20,709,868.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202214/04/202312.2125 Tasa Fija 427,618.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202212/04/202312.2125 Tasa Fija 99,823.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202212/06/202312.8538 Tasa Fija 2,533,424.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202206/06/202312.8538 Tasa Fija 94,491.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202210/04/202312.2125 Tasa Fija 230,144.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202214/04/202312.2125 Tasa Fija 259,493.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202218/04/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202205/04/202312.2125 Tasa Fija 772,015.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202225/04/202312.8538 Tasa Fija 11,567.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/12/202213/06/202312.8538 Tasa Fija 37,499.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202219/04/202311.5274 Tasa Fija 1,001,098.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202231/08/20235.17378 Tasa Fija 138,992,723.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202218/12/202611.6 Tasa Fija 11,289,875.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202214/04/202312.216 Tasa Fija 153,096.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202210/04/202312.216 Tasa Fija 787,069.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202216/06/202312.8666 Tasa Fija 314,446.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202212/06/202312.8666 Tasa Fija 1,331,913.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202230/05/202312.8666 Tasa Fija 43,527.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202210/04/202312.216 Tasa Fija 304,976.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202219/04/202311.5274

Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202220/04/202311.45 Tasa Fija 1,003,498.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202210/04/202312.216 Tasa Fija 4,506.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202220/04/202312.216 Tasa Fija 1,550,900.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202203/04/202312.216 Tasa Fija 40,080.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/12/202206/06/202312.8666 Tasa Fija 345,960.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202210/04/202312.2205 Tasa Fija 373,991.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202225/05/202312.87 Tasa Fija 196,766.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202203/04/20236.11297 Tasa Fija 16,450.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202220/04/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202221/04/202311.45 Tasa Fija 1,003,498.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202210/04/202312.2205 Tasa Fija 175,167.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/12/202206/06/202312.87 Tasa Fija 43,401.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202221/04/202311.5274 Tasa Fija 20,006,404.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202214/04/202312.225 Tasa Fija 55,529.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202219/04/202312.225 Tasa Fija 36,574.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202219/04/202312.225 Tasa Fija 613,550.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202216/06/202312.8674 Tasa Fija 319,825.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202212/05/202312.8674 Tasa Fija 3,610.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202220/06/202312.8674 Tasa Fija 689,687.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202220/06/202312.8674 Tasa Fija 28,363.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/202221/04/202311.45 Tasa Fija 1,003,498.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202219/04/202312.225 Tasa Fija 86,065.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202219/04/202312.225 Tasa Fija 102,425.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202220/06/202312.8674 Tasa Fija 88,845.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202217/04/202312.225 Tasa Fija 8,156,242.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202225/05/202312.8674 Tasa Fija 415,310.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202201/06/202312.8674 Tasa Fija 1,862,962.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/12/202217/04/202312.225 Tasa Fija 4,792,233.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202221/04/202312.235 Tasa Fija 193,017.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202217/04/202312.235 Tasa Fija 1,005,920.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202217/04/202312.235 Tasa Fija 1,866,688.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202217/04/202312.235 Tasa Fija 210,388.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202220/06/202312.8735 Tasa Fija 90,155.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202217/04/202312.235 Tasa Fija 61,118.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202213/06/202312.8735 Tasa Fija 43,285.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/12/202220/06/202312.8735 Tasa Fija 24,203.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/12/202223/06/202311.4874 Tasa Fija 12,519,943.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202217/04/202312.2375 Tasa Fija 308,111.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202219/04/202312.2375 Tasa Fija 69,632.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202213/04/202312.2375 Tasa Fija 1,238,344.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202223/06/202312.884 Tasa Fija 975,583.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202203/04/202312.2375 Tasa Fija 65,169.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202205/04/202312.2375 Tasa Fija 96,109.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202217/04/202312.2375 Tasa Fija 152,855.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/12/202214/04/202312.2375 Tasa Fija 456,786.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202226/04/202311.5274 Tasa Fija 10,003,202.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202222/06/202311.455 Tasa Fija 12,539,774.31

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202205/04/202312.2472 Tasa Fija 16,698.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202217/04/202312.2472 Tasa Fija 392,402.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/12/202217/04/202312.2472 Tasa Fija 114,893.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202226/06/202311.4874 Tasa Fija 12,519,943.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202218/07/20235.03771 Tasa Fija 9,027,500.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202224/07/20235.057 Tasa Fija 27,060,525.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202226/04/202312.2235 Tasa Fija 422,582.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202217/04/202312.2235 Tasa Fija 246,771.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202227/06/202311.4874 Tasa Fija 12,519,943.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202214/04/202312.2235 Tasa Fija 79,262.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202223/06/202312.8999 Tasa Fija 3,354,810.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202228/04/202311.4986 Tasa Fija 1,001,277.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202212/04/202312.2235 Tasa Fija 47,786.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202214/04/202312.2235 Tasa Fija 1,020,973.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/12/202213/06/202312.8999 Tasa Fija 43,125.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/12/202228/04/202311.4986 Tasa Fija 1,001,277.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202221/04/202312.2249 Tasa Fija 1,734,150.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202226/04/202312.2249 Tasa Fija 33,334.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202226/04/202312.2249 Tasa Fija 199,585.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202210/04/20236.1914 Tasa Fija 111,699.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/12/202228/06/202311.4986 Tasa Fija 15,019,164.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202224/04/202312.2249 Tasa Fija 315,685.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/12/202224/04/202312.2249 Tasa Fija 40,962.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202324/04/202312.2125 Tasa Fija 6,718,470.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202326/04/202312.2125 Tasa Fija 2,126.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202314/04/202312.2125 Tasa Fija 649,115.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202324/04/202312.2125 Tasa Fija 1,465,640.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/01/202324/04/202312.2125 Tasa Fija 30,485.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202321/04/202312.221 Tasa Fija 595,075.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202324/04/202312.221 Tasa Fija 198,514.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202324/04/202312.221 Tasa Fija 190,366.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/01/202330/06/202311.5149 Tasa Fija 14,008,956.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202324/04/202312.195 Tasa Fija 97,658.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202326/06/202312.9316 Tasa Fija 1,237,356.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202328/04/202312.195 Tasa Fija 18,131.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202324/04/202312.195 Tasa Fija 196.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202320/06/202312.9316 Tasa Fija 43,195.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/01/202304/05/202311.5274 Tasa Fija 1,001,098.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202305/05/202311.3823 Tasa Fija 1,008,220.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202328/04/202312.1905 Tasa Fija 74,313.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202324/04/202312.1905 Tasa Fija 24,828.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202305/04/202311.3823 Tasa Fija 352,877.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202326/04/202312.1905 Tasa Fija 36,489.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202320/06/202312.9192 Tasa Fija 315,926.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202304/07/202311.3823

Tasa Fija 13,106,867.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/01/202320/06/202312.9192 Tasa Fija 43,200.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/05/202312.18 Tasa Fija 183,458.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202303/04/202312.18 Tasa Fija 403,134.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202305/04/202312.18 Tasa Fija 474,238.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202303/07/202312.8975 Tasa Fija 704,071.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 872,004.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 51,539.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 97,860.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202305/05/202311.3823
Tasa Fija 1,008,220.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202303/04/202312.18 Tasa Fija 32,406.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202303/05/202312.18 Tasa Fija 648,703.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202326/05/202312.8975 Tasa Fija 105,051.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 76,933.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202322/06/202312.8975 Tasa Fija 720,661.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202329/06/202312.8975 Tasa Fija 2,430,060.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202305/04/202312.18 Tasa Fija 47,364.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202302/05/202312.18 Tasa Fija 1,014,816.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202303/05/202312.18 Tasa Fija 331,312.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202312/04/202312.18 Tasa Fija 59,660.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 260,890.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202314/04/202312.18 Tasa Fija 193,759.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202321/04/202312.18 Tasa Fija 418,219.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202321/04/202312.18 Tasa Fija 73,332.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202321/04/202312.18 Tasa Fija 16,016.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202304/04/202312.175 Tasa Fija 242,647.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202324/04/202312.175 Tasa Fija 4,982.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202322/06/202312.9318 Tasa Fija 446,452.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202317/04/202312.175 Tasa Fija 28,098.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202304/07/202312.9318 Tasa Fija 90,190.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202330/06/202312.9318 Tasa Fija 1,818,539.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202317/04/202312.1725 Tasa Fija 430,814.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202305/07/202312.9286 Tasa Fija 2,333,117.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202310/04/202311.408
Tasa Fija 50,063.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202303/07/202311.3775
Tasa Fija 5,045,826.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202328/04/202312.1725 Tasa Fija 174,088.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202320/06/202312.9286 Tasa Fija 46,339.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202303/04/202312.1725 Tasa Fija 15,618.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202302/05/202312.1725 Tasa Fija 90,817.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202305/05/202312.165 Tasa Fija 172,971.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202303/05/202312.165 Tasa Fija 14,815.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/01/202304/07/202311.3823
Tasa Fija 5,041,102.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202317/04/202312.165 Tasa Fija 68,495.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202307/07/202312.9195 Tasa Fija 362,449.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202324/04/20236.20203 Tasa Fija 531,337.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202317/04/202312.165 Tasa Fija 94,061.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202303/05/202312.165 Tasa Fija 120,880.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202305/07/202311.3823
Tasa Fija 5,041,102.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202305/07/202311.3823
Tasa Fija 10,082,205.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202305/05/202312.165 Tasa Fija 537,988.04

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202324/04/202312.165 Tasa Fija 34,788.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202324/04/20236.21214 Tasa Fija 748,276.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202302/05/202312.16 Tasa Fija 644,579.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202303/05/202312.16 Tasa Fija 826,466.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202311/07/202312.9406 Tasa Fija 96,152.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202308/05/202312.16 Tasa Fija 1,046,741.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202310/05/202312.16 Tasa Fija 30,167.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202306/06/202312.9406 Tasa Fija 322,924.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202311/05/202312.16 Tasa Fija 134,119.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202308/05/202312.16 Tasa Fija 2,152,921.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202310/04/202312.16 Tasa Fija 571,685.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202310/04/202312.16 Tasa Fija 80,259.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202324/04/202312.16 Tasa Fija 214,985.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202308/06/202312.9406 Tasa Fija 878,010.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202322/06/202312.9406 Tasa Fija 1,083,487.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202312/05/202311.414 Tasa Fija 1,006,024.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202313/04/202311.414 Tasa Fija 352,108.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202306/07/202311.3823 Tasa Fija 5,041,102.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202312/07/202311.414 Tasa Fija 24,144,577.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202312/04/202312.1649 Tasa Fija 314,820.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202310/05/202312.1649 Tasa Fija 55,892.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202308/05/202312.1649 Tasa Fija 725,694.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202310/05/202312.1649 Tasa Fija 212,829.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202307/07/202311.385 Tasa Fija 5,039,531.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202317/04/202312.1649 Tasa Fija 147,976.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202308/05/202312.1649 Tasa Fija 91,666.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202310/07/202312.9284 Tasa Fija 594,618.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202311/07/202312.9284 Tasa Fija 30,266.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202307/07/202311.385 Tasa Fija 5,039,531.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202305/05/202312.18 Tasa Fija 133,795.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202309/05/202312.18 Tasa Fija 185,136.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202310/04/202312.18 Tasa Fija 17,577.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202308/05/202312.18 Tasa Fija 242,448.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202314/04/202312.18 Tasa Fija 41,449.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202308/05/202312.18 Tasa Fija 536,417.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202329/06/202312.9427 Tasa Fija 659,644.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202317/04/202311.4474 Tasa Fija 452,146.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202312/07/202311.414 Tasa Fija 5,030,120.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202317/04/202312.18 Tasa Fija 214,027.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202308/05/202312.18 Tasa Fija 17,865.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202316/06/202312.9427 Tasa Fija 1,437,246.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202315/08/20235.06702 Tasa Fija 45,056,590.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202314/04/202312.185 Tasa Fija 11,916.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202310/05/202312.185 Tasa Fija 489,069.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202309/05/202312.185 Tasa Fija 8,244.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202310/04/202312.185 Tasa Fija 197.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202310/05/202312.185 Tasa Fija 188,729.02

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202302/05/202312.185 Tasa Fija 1,761.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202311/07/202312.9427 Tasa Fija 126,861.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202318/05/202311.45 Tasa Fija 4,013,994.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202318/05/202311.5274 Tasa Fija 1,250,400.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202310/05/202312.185 Tasa Fija 29,674.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202305/05/202312.195 Tasa Fija 114,714.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202312/05/202312.195 Tasa Fija 596,572.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202310/05/202312.195 Tasa Fija 1,059,767.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202311/07/202312.9613 Tasa Fija 9,943.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202318/04/202312.195 Tasa Fija 25,794.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202303/04/202312.195 Tasa Fija 87,936.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202319/05/202311.5274 Tasa Fija 1,250,400.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202318/07/202311.45 Tasa Fija 7,024,490.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202319/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202304/07/202312.9613 Tasa Fija 42,984.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202319/04/202311.45 Tasa Fija 349,419.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/05/202312.1975 Tasa Fija 185,654.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/04/202312.1975 Tasa Fija 75,264.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202317/05/202312.1975 Tasa Fija 2,419,843.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202310/05/202312.1975 Tasa Fija 135,759.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 88,904.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 36,595.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/01/202320/04/202311.45 Tasa Fija 451,574.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/01/202319/05/202311.5274 Tasa Fija 1,500,480.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202305/05/202312.1975 Tasa Fija 1,664,491.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202317/05/202312.1975 Tasa Fija 49,355.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202317/07/202312.9572 Tasa Fija 95,545.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 345,830.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202306/07/202312.9572 Tasa Fija 833,211.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 592,832.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202321/04/202312.1975 Tasa Fija 118,886.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202317/04/202312.1975 Tasa Fija 94,932.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202320/04/202312.1975 Tasa Fija 205,507.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202315/05/202312.1975 Tasa Fija 1,307,619.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202317/05/202312.1975 Tasa Fija 4,204,196.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202321/04/202312.1975 Tasa Fija 418,794.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202315/05/202312.1975 Tasa Fija 60,601.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202319/07/202312.9572 Tasa Fija 1,024,528.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 58,038.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202329/06/202312.9572 Tasa Fija 585,871.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202313/07/202312.9572 Tasa Fija 1,593,117.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202319/05/202312.1912 Tasa Fija 262,693.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202319/04/202312.1912 Tasa Fija 73,782.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202310/05/202312.1912 Tasa Fija 156,256.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202315/05/202312.1912 Tasa Fija 114,291.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202319/07/202312.9427 Tasa Fija 10,412,445.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202319/07/202312.9427 Tasa Fija 401,803.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/01/202323/05/202311.5274

Tasa Fija 2,000,640.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202312/05/202312.1912 Tasa Fija 343,497.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202317/05/202312.1912 Tasa Fija 48,318.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202318/07/202312.9427 Tasa Fija 125,487.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202318/07/202312.9427 Tasa Fija 120,451.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202324/04/202311.4749
Tasa Fija 451,147.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202321/04/202312.2049 Tasa Fija 26,692.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202303/04/202312.2049 Tasa Fija 212,137.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202324/05/202311.5274
Tasa Fija 2,000,640.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202321/07/202312.9638 Tasa Fija 906,811.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202317/04/202312.2049 Tasa Fija 221,741.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202324/04/202311.4749
Tasa Fija 349,089.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202323/01/202511.6274
Tasa Fija 10,003,229.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202328/04/202312.2025 Tasa Fija 465,719.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202323/05/202312.2025 Tasa Fija 284,635.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202315/05/202312.2025 Tasa Fija 32,721.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202324/05/202312.2025 Tasa Fija 6,479,844.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202305/05/202312.2025 Tasa Fija 321,328.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202317/05/202312.2025 Tasa Fija 447,889.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202315/05/202312.2025 Tasa Fija 326,033.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202317/05/202312.2025 Tasa Fija 22,240.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202317/05/202312.2025 Tasa Fija 848,282.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202325/04/202311.4874
Tasa Fija 313,881.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202310/04/202312.2025 Tasa Fija 10,385.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202323/08/20234.88947
Tasa Fija 36,363,265.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202321/07/20234.87947
Tasa Fija 18,641,871.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202315/05/202312.2075 Tasa Fija 74,013.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202315/05/202312.2075 Tasa Fija 255,376.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202324/04/202312.2075 Tasa Fija 101,689.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202325/07/202311.4874
Tasa Fija 6,009,572.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202312/05/202312.2075 Tasa Fija 866,468.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202325/04/202312.2075 Tasa Fija 64,707.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202315/05/202312.2075 Tasa Fija 81,150.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202306/07/202312.9884 Tasa Fija 452,372.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202326/05/202312.2225 Tasa Fija 328,721.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202315/05/202312.2225 Tasa Fija 133,228.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202324/05/202312.2225 Tasa Fija 637,537.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202316/06/202313.0096 Tasa Fija 26,290.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202325/07/202313.0096 Tasa Fija 121,693.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202325/07/202313.0096 Tasa Fija 19,191.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202325/07/202313.0096 Tasa Fija 8,240.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202310/05/202312.2225 Tasa Fija 27,628.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202324/05/202312.2225 Tasa Fija 283,746.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202325/07/202313.0096 Tasa Fija 9,569.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202320/07/202313.0096 Tasa Fija 5,286,821.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202327/04/202311.4874
Tasa Fija 300,478.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202327/04/202311.4874

Tasa Fija 200,319.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202327/04/202312.2225 Tasa Fija 418,377.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202322/05/202312.2225 Tasa Fija 3,204,140.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202324/05/202312.2225 Tasa Fija 512,076.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202324/04/202312.2225 Tasa Fija 22,372.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202322/06/202313.0096 Tasa Fija 166,954.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202320/07/202313.0096 Tasa Fija 1,569,441.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202321/04/202312.2225 Tasa Fija 162,187.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202322/05/202312.2225 Tasa Fija 238,670.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202324/05/202312.2225 Tasa Fija 128,606.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202326/05/202311.4874
Tasa Fija 20,031,909.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202326/07/202311.5274
Tasa Fija 25,008,005.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202326/07/202311.4874
Tasa Fija 5,007,977.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202325/07/202311.4874
Tasa Fija 5,007,977.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202322/05/202312.23 Tasa Fija 145,385.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202324/05/202312.23 Tasa Fija 5,092.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202322/05/202312.23 Tasa Fija 1,436,047.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202315/05/20236.21764 Tasa Fija 69,210.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202328/07/202311.4986
Tasa Fija 5,006,388.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202328/04/202312.23 Tasa Fija 57,132.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202322/05/202312.23 Tasa Fija 14,118.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202326/05/202312.23 Tasa Fija 1,295,282.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202310/05/202312.23 Tasa Fija 14,522.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/01/202312/05/202312.23 Tasa Fija 33,788.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202330/05/202311.5149
Tasa Fija 30,019,191.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202328/07/202311.5274
Tasa Fija 25,008,005.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/202328/04/202311.4986
Tasa Fija 450,574.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202312/05/202312.2437 Tasa Fija 36,447.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202322/05/202312.2437 Tasa Fija 8,363.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202324/07/202313.0085 Tasa Fija 477,818.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/202328/07/202311.4986
Tasa Fija 5,006,388.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202321/04/202312.2437 Tasa Fija 97,794.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202310/04/202312.2437 Tasa Fija 53,968.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202324/05/202312.2437 Tasa Fija 32,624.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202324/04/202312.2437 Tasa Fija 2,125.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/202331/05/202311.5274
Tasa Fija 4,001,280.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202317/04/20235.88165 Tasa Fija 115,262.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202315/05/20236.22664 Tasa Fija 158,661.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202330/05/202312.247 Tasa Fija 336,237.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202322/05/202312.247 Tasa Fija 21,340.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202324/05/202312.247 Tasa Fija 191,862.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202328/07/202313.0264 Tasa Fija 8,490,176.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202310/04/202312.247 Tasa Fija 177,024.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202324/05/202312.247 Tasa Fija 44,058.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202304/07/202313.0264 Tasa Fija 43,019.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/02/202327/07/202311.4874

Tasa Fija 4,006,381.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202322/05/202312.2649 Tasa Fija 240,577.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202301/08/202311.374
Tasa Fija 5,048,971.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202319/04/202312.2649 Tasa Fija 13,686.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202325/07/202313.0056 Tasa Fija 315,768.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202302/06/202311.5274
Tasa Fija 2,002,197.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202310/05/202312.2625 Tasa Fija 55,094.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202301/08/202312.9936 Tasa Fija 383,186.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/02/202302/08/202311.3675
Tasa Fija 5,047,364.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202303/04/202311.9835 Tasa Fija 128,257.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202302/05/202312.2625 Tasa Fija 165,199.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202301/06/202312.2625 Tasa Fija 286,541.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202329/05/202312.2625 Tasa Fija 1,374,461.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202301/08/202312.9936 Tasa Fija 45,609.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202329/05/202312.2625 Tasa Fija 3,267,734.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202324/05/202312.2625 Tasa Fija 165,621.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202302/06/202312.2625 Tasa Fija 1,529,123.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202322/06/202312.9936 Tasa Fija 287,207.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202304/05/202312.2625 Tasa Fija 280,042.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202303/04/202311.9949 Tasa Fija 1,438,408.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202331/05/202312.2799 Tasa Fija 16,933.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202331/05/202312.2799 Tasa Fija 65,366.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202329/05/202312.2799 Tasa Fija 1,819,562.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202327/07/202312.984 Tasa Fija 999,124.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202327/07/202312.984 Tasa Fija 4,462,428.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/02/202303/08/202311.3775
Tasa Fija 5,045,826.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/02/202308/05/202311.396
Tasa Fija 503,798.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/02/202304/08/20235.19029
Tasa Fija 126,158,886.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202319/05/202312.2799 Tasa Fija 417,454.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202326/05/202312.2799 Tasa Fija 1,328,421.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202319/05/202312.2799 Tasa Fija 197,479.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202331/05/202312.2799 Tasa Fija 43,187.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202324/05/202312.2799 Tasa Fija 281,984.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202324/05/202312.2799 Tasa Fija 69,367.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202327/07/202312.984 Tasa Fija 556,627.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202302/06/202312.2887 Tasa Fija 1,162,655.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202305/05/202312.2887 Tasa Fija 17,472.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202329/05/202312.2887 Tasa Fija 84,334.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202331/05/202312.2887 Tasa Fija 305,928.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202303/04/20235.9071 Tasa Fija 69,506.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202331/05/202312.2887 Tasa Fija 1,199,494.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202324/05/202312.2887 Tasa Fija 27,111.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202324/05/202312.2887 Tasa Fija 38,171.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202307/08/202311.385
Tasa Fija 5,039,531.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202324/05/202312.2887 Tasa Fija 30,570.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202307/08/202311.385
Tasa Fija 5,039,531.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202305/05/202312.2983 Tasa Fija 626,958.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202302/06/202312.2983 Tasa Fija 141,610.29

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202309/05/202312.2983 Tasa Fija 203,484.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202329/05/202312.2983 Tasa Fija 32,527.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202307/08/202313.0541 Tasa Fija 71,066.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202307/08/202313.0541 Tasa Fija 1,793,736.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202324/04/202312.2983 Tasa Fija 15,846.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202304/07/202313.0541 Tasa Fija 320,963.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202324/05/202312.2983 Tasa Fija 100,240.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202304/07/202313.0541 Tasa Fija 16,126.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202304/07/202313.0541 Tasa Fija 12,901.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202308/08/202311.396 Tasa Fija 5,037,986.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202311/05/202311.414 Tasa Fija 452,710.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202309/08/202311.3962 Tasa Fija 5,036,404.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202310/04/202312.03 Tasa Fija 67,099.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202308/06/202312.3187 Tasa Fija 126,033.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202330/06/202313.0875 Tasa Fija 134,496.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202324/07/202313.0875 Tasa Fija 223,999.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202327/07/202313.0875 Tasa Fija 582,954.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202309/06/202311.3962 Tasa Fija 1,007,280.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202310/04/202312.03 Tasa Fija 1,132,721.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202305/05/202312.3187 Tasa Fija 120,064.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202310/05/202312.3187 Tasa Fija 82,965.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202305/06/202312.3187 Tasa Fija 1,510,150.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202307/06/202312.3187 Tasa Fija 42,248.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202305/06/202312.3187 Tasa Fija 326,491.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202311/07/202313.0875 Tasa Fija 226,198.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202313/07/202313.0875 Tasa Fija 696,575.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202303/08/202313.0875 Tasa Fija 7,267,169.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202310/04/202312.03 Tasa Fija 119,804.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202328/04/202312.3187 Tasa Fija 106,208.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/02/202310/08/202311.408 Tasa Fija 5,034,857.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202310/04/20235.95312 Tasa Fija 335,628.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202310/04/202311.8775 Tasa Fija 10,037,252.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202310/04/202312.3775 Tasa Fija 387,303.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202331/05/202312.6525 Tasa Fija 448,259.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202308/08/202313.3822 Tasa Fija 242,696.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202303/08/202313.3822 Tasa Fija 174,898.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202305/05/202312.6525 Tasa Fija 649,268.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202302/06/202312.6525 Tasa Fija 1,025,120.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202311/04/202312.3775 Tasa Fija 380,754.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202311/05/202312.6525 Tasa Fija 66,309.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202305/06/202312.6525 Tasa Fija 21,641.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202307/06/202312.6525 Tasa Fija 24,758.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202305/06/20236.35919 Tasa Fija 59,416.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202311/08/202311.414 Tasa Fija 5,030,120.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202310/04/202312.3849 Tasa Fija 76,385.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202308/06/202312.646 Tasa Fija 459,043.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202307/06/202312.646 Tasa Fija 38,583.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202304/08/202313.5356 Tasa Fija 222,054.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202315/05/202311.4245 Tasa Fija 452,427.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202310/04/202312.3849 Tasa Fija 12,885.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202313/02/202511.6274 Tasa Fija 14,004,521.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202314/08/202311.4195 Tasa Fija 5,028,548.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202326/05/202312.6475 Tasa Fija 169,194.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202329/05/202312.6475 Tasa Fija 27.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202307/06/202312.6475 Tasa Fija 460,313.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202307/06/202312.6475 Tasa Fija 18,634.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202307/06/202312.6475 Tasa Fija 563,209.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202301/08/202313.5244 Tasa Fija 204,536.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202316/05/202312.6475 Tasa Fija 271,827.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202307/06/202312.6475 Tasa Fija 6,470.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202304/07/202313.5244 Tasa Fija 335,429.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202304/08/202311.3823 Tasa Fija 17,139,749.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202314/08/202311.4195 Tasa Fija 22,125,614.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202314/04/202312.393 Tasa Fija 28,116.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202305/04/202312.393 Tasa Fija 660,926.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202310/04/202312.393 Tasa Fija 20,953.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202309/06/202312.6485 Tasa Fija 2,136,963.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202308/05/202312.6485 Tasa Fija 86,807.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202314/06/202312.6485 Tasa Fija 474,464.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202324/05/202312.6485 Tasa Fija 42,268.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202314/02/202511.6274 Tasa Fija 10,003,229.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202310/04/202312.393 Tasa Fija 221,819.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202305/05/202312.6485 Tasa Fija 10,001.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202329/06/202313.0319 Tasa Fija 15,171,148.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202315/08/202311.4245 Tasa Fija 5,026,974.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202312/05/20235.97494 Tasa Fija 2,017,032.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/02/202315/08/202311.4245 Tasa Fija 22,118,687.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202311/04/202312.391 Tasa Fija 201,553.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202315/06/202312.644 Tasa Fija 247,877.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202312/06/202312.644 Tasa Fija 408,013.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202314/06/202312.644 Tasa Fija 5,270,614.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202307/07/202313.4808 Tasa Fija 98,220.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/02/202316/06/202311.4372 Tasa Fija 1,005,083.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/02/202318/05/202311.45 Tasa Fija 451,574.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202317/04/202312.391 Tasa Fija 128,941.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202317/04/202312.391 Tasa Fija 256,665.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202305/05/202312.644 Tasa Fija 117,137.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202312/06/202312.644 Tasa Fija 2,343,906.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202314/06/202312.644 Tasa Fija 106,822.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202312/05/202312.644 Tasa Fija 485,175.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202317/04/202312.395 Tasa Fija 967,937.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202311/05/202312.6465 Tasa Fija 12,697.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202318/05/202312.6465 Tasa Fija 146,304.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202314/06/202312.6465 Tasa Fija 95,120.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202308/06/202312.6465 Tasa Fija 139,209.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202312/06/202312.6465 Tasa Fija 228,960.82

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202310/08/202313.5019 Tasa Fija 5,633,543.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202316/08/202311.4372 Tasa Fija 6,030,499.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202318/08/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202317/04/202312.395 Tasa Fija 419,613.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202309/06/202312.6465 Tasa Fija 382,064.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202312/06/202312.6465 Tasa Fija 2,737.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202314/06/202312.6465 Tasa Fija 181,316.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202308/06/202312.6465 Tasa Fija 1,663,239.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202302/05/202312.6465 Tasa Fija 113,691.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202306/07/202313.5019 Tasa Fija 255,480.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202322/05/202311.455 Tasa Fija 451,431.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202314/04/202312.4045 Tasa Fija 60,856.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202314/06/202312.6562 Tasa Fija 213,485.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202314/08/202313.5566 Tasa Fija 1,165,372.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202312/06/202312.6562 Tasa Fija 3,066.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202321/05/202411.5274 Tasa Fija 10,003,202.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202320/04/202311.5274 Tasa Fija 1,066,341.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202310/04/202312.4142 Tasa Fija 83,318.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202320/06/202312.6661 Tasa Fija 298,055.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202319/05/202312.6661 Tasa Fija 232,568.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202312/06/202312.6661 Tasa Fija 38,225.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202314/06/202312.6661 Tasa Fija 170,785.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202317/08/202313.5566 Tasa Fija 116,443.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202315/02/202411.4245 Tasa Fija 4,021,579.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202318/01/202411.45 Tasa Fija 3,010,495.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202317/04/20236.01094 Tasa Fija 331,399.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202310/04/202312.4142 Tasa Fija 243,327.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202303/04/202312.4142 Tasa Fija 32,678.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202321/08/202313.5566 Tasa Fija 269,092.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202321/04/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202308/06/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202323/05/202311.465 Tasa Fija 369,523.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202319/05/20236.02797 Tasa Fija 16,528.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202322/08/202311.455 Tasa Fija 6,019,091.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202310/04/202312.4104 Tasa Fija 1,253,897.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202319/05/202312.66 Tasa Fija 1,637,130.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202321/06/202312.66 Tasa Fija 32,971.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202308/05/202312.66 Tasa Fija 176,105.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202310/08/202313.5449 Tasa Fija 644,589.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202305/05/202312.66 Tasa Fija 360,609.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202321/06/202312.66 Tasa Fija 157,199.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202324/05/202312.66 Tasa Fija 115,013.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202314/06/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202313/06/202311.5274

Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202324/05/202311.4749 Tasa Fija 347,241.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202321/09/202311.45 Tasa Fija 50,174,930.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202317/04/20236.04658 Tasa Fija 16,834.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/02/202325/04/202311.5274 Tasa Fija 1,181,358.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/02/202325/05/202311.4874 Tasa Fija 500,797.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202314/04/202312.42 Tasa Fija 2,225,470.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202310/04/202312.42 Tasa Fija 15,442.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202318/04/202312.42 Tasa Fija 559,094.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202303/04/202312.42 Tasa Fija 3,238.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202319/05/202312.6695 Tasa Fija 133,291.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202322/06/202312.6695 Tasa Fija 243,548.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202312/06/202312.6695 Tasa Fija 39,145.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202314/06/202312.6695 Tasa Fija 1,667.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202314/07/202313.5975 Tasa Fija 59,161.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/02/202312/01/202411.414 Tasa Fija 8,529,453.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202319/06/202312.6695 Tasa Fija 1,821,649.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202308/06/202312.6695 Tasa Fija 34,350.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202312/06/202312.6695 Tasa Fija 8,427.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202320/07/202313.5975 Tasa Fija 118,170.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202318/04/202312.42 Tasa Fija 148,938.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202317/08/202313.5975 Tasa Fija 4,194,545.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/02/202325/05/202311.4874 Tasa Fija 320,275.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/02/202331/07/202311.3655 Tasa Fija 7,734,485.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202312/05/20236.07333 Tasa Fija 123,229.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202324/04/20236.07333 Tasa Fija 53,764.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202324/04/20236.07333 Tasa Fija 314,122.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202310/04/202312.425 Tasa Fija 43,525.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202324/04/202312.425 Tasa Fija 565,616.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202324/04/202312.425 Tasa Fija 956,851.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202326/05/202312.6705 Tasa Fija 449,789.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202323/06/202312.6705 Tasa Fija 76,038.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202326/05/202312.6705 Tasa Fija 466,564.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202322/05/202312.6705 Tasa Fija 1,670,348.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202322/05/202312.6705 Tasa Fija 91,591.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202319/06/202312.6705 Tasa Fija 3,660,479.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202317/08/202313.5763 Tasa Fija 1,482,388.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202326/05/202311.4874 Tasa Fija 255,755.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202326/05/202311.4874 Tasa Fija 3,004,786.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202324/04/202312.425 Tasa Fija 68,649.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202302/06/202312.6705 Tasa Fija 255,511.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202323/05/202312.6705 Tasa Fija 31,859.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202329/05/202312.6705 Tasa Fija 157,674.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202307/06/202312.6705 Tasa Fija 107,577.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202317/08/202313.5763 Tasa Fija 678,614.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202325/08/202311.4874 Tasa Fija 8,012,763.78

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202324/08/202311.4749 Tasa Fija 8,020,399.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202324/04/20236.09047 Tasa Fija 90,017.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202324/04/20236.09047 Tasa Fija 140,851.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202311/04/202312.4155 Tasa Fija 3,455.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202324/04/202312.4155 Tasa Fija 266,313.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202317/04/202312.4155 Tasa Fija 803.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202323/06/202312.6684 Tasa Fija 103,229.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202318/07/202313.625 Tasa Fija 30,823.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202310/04/202312.4155 Tasa Fija 88,195.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202322/05/202312.6684 Tasa Fija 239,640.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202318/05/202312.6684 Tasa Fija 18,807.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/02/202314/04/202311.5274 Tasa Fija 15,004,803.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202312/06/20236.55606 Tasa Fija 144,769.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/03/202328/04/202311.5274 Tasa Fija 1,594,468.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202311/04/202312.424 Tasa Fija 228,260.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202327/06/202312.6725 Tasa Fija 353,808.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202312/06/202312.6725 Tasa Fija 283,185.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202328/04/202312.424 Tasa Fija 2,214,083.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202302/05/202312.6725 Tasa Fija 318,340.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/03/202330/05/202311.5149 Tasa Fija 345,956.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202326/04/202312.424 Tasa Fija 102,244.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202318/05/202312.6725 Tasa Fija 384,294.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202322/05/202312.6725 Tasa Fija 80,100.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202329/05/202312.6725 Tasa Fija 10,603.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202316/06/202312.7213 Tasa Fija 672,654.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202329/08/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202312/04/202312.4175 Tasa Fija 61,006.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202303/05/202312.7213 Tasa Fija 196,006.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202328/06/202312.7213 Tasa Fija 114,530.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202331/05/202311.5274 Tasa Fija 383,411.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202331/05/202311.5274 Tasa Fija 2,000,640.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/03/202324/05/202312.7213 Tasa Fija 279,512.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202301/06/202311.3775 Tasa Fija 504,582.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202325/04/202312.4275 Tasa Fija 142,152.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202311/04/202312.4275 Tasa Fija 30,970.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202312/06/202312.7155 Tasa Fija 84,221.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202302/05/202311.5274 Tasa Fija 1,180,377.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202330/06/202311.5149 Tasa Fija 1,000,639.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202329/06/202312.7155 Tasa Fija 245,161.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202326/06/202312.7155 Tasa Fija 590,171.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202328/06/202312.7155 Tasa Fija 11,935,813.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202328/06/202312.7155 Tasa Fija 683,237.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202321/07/202313.6215 Tasa Fija 51,874.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202329/09/202311.5035 Tasa Fija 700,671.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202301/06/202311.3775

Tasa Fija 394,583.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202328/04/202312.4275 Tasa Fija 71,213.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202317/04/202312.4275 Tasa Fija 68,221.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202302/05/202312.4275 Tasa Fija 154,704.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202302/05/202312.4275 Tasa Fija 7,854.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202305/04/202312.4275 Tasa Fija 2,222,252.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202319/05/202312.7155 Tasa Fija 137,783.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202308/05/202312.7155 Tasa Fija 45,048.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202326/06/202312.7155 Tasa Fija 4,564,564.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202328/06/202312.7155 Tasa Fija 1,672,334.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202329/05/202312.7155 Tasa Fija 120,553.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202321/06/202312.7155 Tasa Fija 1,614.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202324/08/202313.6215 Tasa Fija 7,995,350.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202330/08/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202303/03/202813.33 Tasa Fija 30,322,141.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202330/08/202311.5149 Tasa Fija 3,001,919.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202302/05/20236.12926 Tasa Fija 538,877.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202302/05/202312.4323 Tasa Fija 6,402,560.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202326/06/202312.72 Tasa Fija 50,102.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202328/06/202312.72 Tasa Fija 299,629.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202326/06/202312.72 Tasa Fija 2,150,863.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202310/04/202312.4323 Tasa Fija 55,564.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202330/06/202312.72 Tasa Fija 1,734,867.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202323/06/202312.72 Tasa Fija 825,712.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202301/06/202312.72 Tasa Fija 264,981.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202305/05/202311.5274 Tasa Fija 1,476,697.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202301/09/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202302/05/202312.4323 Tasa Fija 44,750.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202329/05/202312.72 Tasa Fija 237,925.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202328/06/202312.72 Tasa Fija 71,457.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202307/06/202312.72 Tasa Fija 754,374.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202329/08/202313.5967 Tasa Fija 20,819.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202318/07/202313.5967 Tasa Fija 96,070.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202317/08/202313.5967 Tasa Fija 323,978.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202325/07/202313.5967 Tasa Fija 70,614.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202302/06/202311.3823 Tasa Fija 374,610.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202302/06/202311.3823 Tasa Fija 360,351.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202314/08/202311.5274 Tasa Fija 10,003,202.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202319/05/20236.13983 Tasa Fija 12,823.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202326/06/20236.60289 Tasa Fija 42,442.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202325/04/202312.435 Tasa Fija 84,182.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202302/06/202312.7225 Tasa Fija 110,953.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202329/05/202312.7225 Tasa Fija 157,801.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202328/06/202312.7225 Tasa Fija 121,167.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202301/09/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202302/05/202312.435 Tasa Fija 5,000.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202316/06/202312.7225 Tasa Fija 84,836.73

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202328/06/202312.7225 Tasa Fija 1,583,363.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202324/05/202312.7225 Tasa Fija 478,933.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202305/06/202311.385 Tasa Fija 345,579.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202305/06/202311.385 Tasa Fija 371,380.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202315/08/202311.5274 Tasa Fija 10,003,202.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202321/06/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202322/06/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202327/06/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202328/06/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202304/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202314/04/202312.446 Tasa Fija 142,662.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202326/06/202312.726 Tasa Fija 107,910.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202306/07/202311.396 Tasa Fija 604,558.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202326/06/20236.59877 Tasa Fija 444,999.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202304/09/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202328/04/202312.446 Tasa Fija 19,954.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202326/05/202312.726 Tasa Fija 318,643.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202304/07/202312.726 Tasa Fija 751,726.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202306/06/202311.396 Tasa Fija 498,982.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202304/09/202311.396 Tasa Fija 2,518,993.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202328/06/202312.726 Tasa Fija 560,627.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202328/07/202313.6328 Tasa Fija 1,609,981.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202329/08/202313.6328 Tasa Fija 998,997.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202316/08/202311.5274 Tasa Fija 10,003,202.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202305/06/202312.726 Tasa Fija 63,271.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202301/09/202313.6328 Tasa Fija 289,179.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 5,015,909.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 5,015,909.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 5,015,909.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 3,511,136.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202304/07/202311.5274 Tasa Fija 8,002,561.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202330/06/202311.5149 Tasa Fija 5,003,198.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202319/05/20236.15659 Tasa Fija 605,170.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202307/07/202311.3962 Tasa Fija 1,007,280.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202308/05/202311.5274 Tasa Fija 1,476,697.70

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202305/09/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202325/04/202312.4462 Tasa Fija 78,990.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202302/06/202312.725 Tasa Fija 180,108.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202310/05/202312.725 Tasa Fija 56,715.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202317/05/202312.725 Tasa Fija 445,657.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202324/08/202313.6994 Tasa Fija 1,044,842.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202330/06/202311.5149 Tasa Fija 5,003,198.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202305/07/202312.725 Tasa Fija 1,374,074.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202326/06/202312.725 Tasa Fija 37,030.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202307/06/202311.3962 Tasa Fija 444,266.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202329/05/202312.725 Tasa Fija 34,335.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202328/06/202312.725 Tasa Fija 119,052.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202305/06/202312.725 Tasa Fija 12,087.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202307/06/202311.3962 Tasa Fija 3,021,842.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202305/09/202311.3962 Tasa Fija 2,518,202.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202304/05/202312.4462 Tasa Fija 307,737.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 4,012,727.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 4,012,727.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 4,012,727.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 4,012,727.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 2,507,954.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202317/08/202311.5274 Tasa Fija 10,003,202.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202322/05/202411.5274 Tasa Fija 14,004,482.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202330/06/202311.5149 Tasa Fija 5,003,198.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202307/07/202311.408 Tasa Fija 1,006,971.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202306/09/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202310/04/202312.458 Tasa Fija 37,295.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202330/06/202312.727 Tasa Fija 3,483,413.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202307/07/202312.727 Tasa Fija 10,712.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202310/05/202312.727 Tasa Fija 11,471.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202307/06/202312.727 Tasa Fija 202,240.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202326/06/202312.727 Tasa Fija 135,370.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 12,805,979.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/09/202313.7418 Tasa Fija 29,021.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202308/06/202311.408 Tasa Fija 453,137.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202317/04/202312.458 Tasa Fija 74,567.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202306/07/202312.727 Tasa Fija 47,424.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202303/07/202312.727 Tasa Fija 549,597.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 1,027,322.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202321/06/202312.727 Tasa Fija 614,744.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/06/202312.727 Tasa Fija 109,560.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/06/202312.727 Tasa Fija 60,438.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202331/08/202313.7418 Tasa Fija 3,071,595.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202306/09/202311.408 Tasa Fija 2,517,428.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202308/05/202312.458 Tasa Fija 192,275.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202303/07/202312.727 Tasa Fija 2,924,661.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 837,862.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/06/202312.727 Tasa Fija 6,624.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 62,837.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202331/08/202313.7418 Tasa Fija 380,075.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202323/06/202312.727 Tasa Fija 283,463.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 17,545.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202303/07/202312.727 Tasa Fija 149,360.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 47,533.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 2,507,954.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 2,808,909.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 3,511,136.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 4,012,727.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 3,511,136.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202322/06/202311.455 Tasa Fija 2,006,363.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202326/05/20236.30713 Tasa Fija 24,509.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202308/05/20236.30713 Tasa Fija 174,142.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/03/202308/09/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/03/202309/05/202311.5274 Tasa Fija 1,181,058.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/03/202330/06/202311.5149 Tasa Fija 5,003,198.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202302/05/202312.464 Tasa Fija 565,879.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202305/04/202312.464 Tasa Fija 641,291.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202307/07/202312.7365 Tasa Fija 211,558.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202305/06/202312.7365 Tasa Fija 244,738.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202303/07/202312.7365 Tasa Fija 523,483.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202304/04/202312.464 Tasa Fija 122,880.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202305/07/202312.7365 Tasa Fija 35,103.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202305/07/202312.7365 Tasa Fija 3,796.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/03/202307/09/202311.414 Tasa Fija 1,701,186.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202303/07/202312.7365 Tasa Fija 108,291.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202305/06/202312.7365 Tasa Fija 87,848.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/03/202301/06/202311.414 Tasa Fija 389,221.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/03/202331/05/202311.5274 Tasa Fija 503,118.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/03/202330/05/202311.5149 Tasa Fija 270,996.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202302/05/20236.31987 Tasa Fija 1,153,448.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202312/06/202311.4195 Tasa Fija 351,998.41

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202330/06/202311.5149 Tasa Fija 5,003,198.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202308/09/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202310/05/202312.4695 Tasa Fija 5,620.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202324/04/202312.4695 Tasa Fija 103,361.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202308/05/202312.4695 Tasa Fija 1,949,311.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202309/06/202312.738 Tasa Fija 201,958.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202305/06/202312.738 Tasa Fija 36,269.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202305/07/202312.738 Tasa Fija 30,150.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202302/06/202311.4195 Tasa Fija 295,715.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202305/06/202311.4195 Tasa Fija 443,573.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202306/06/202311.4195 Tasa Fija 425,422.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202324/05/202411.5274 Tasa Fija 11,003,522.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202308/09/202311.4195 Tasa Fija 2,458,960.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202323/06/202312.738 Tasa Fija 34,804.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202303/07/202312.738 Tasa Fija 130,470.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202305/06/202312.738 Tasa Fija 12,522.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202316/06/202312.738 Tasa Fija 345,372.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202308/09/202313.6279 Tasa Fija 339,296.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202316/06/202312.738 Tasa Fija 35,504.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202303/04/20236.02709 Tasa Fija 324,637.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202313/07/202311.4245 Tasa Fija 1,005,394.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202311/09/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202311/05/202311.5274 Tasa Fija 1,476,697.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202304/04/202312.4745 Tasa Fija 60,182.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202304/04/202312.4745 Tasa Fija 732,815.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202312/07/202312.746 Tasa Fija 166,659.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202305/07/202312.746 Tasa Fija 11,945.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202321/08/202313.4717 Tasa Fija 353,232.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202330/06/202311.5149 Tasa Fija 5,003,198.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202307/06/202311.4245 Tasa Fija 388,394.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202308/06/202311.4245 Tasa Fija 272,284.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202308/06/202311.4245 Tasa Fija 420,719.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202321/04/202312.4745 Tasa Fija 8,034.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202326/06/202312.746 Tasa Fija 16,590.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202305/07/202312.746 Tasa Fija 97,918.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202301/08/202313.4717 Tasa Fija 98,626.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202331/08/202313.4717 Tasa Fija 3,130,187.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202311/09/202311.4245 Tasa Fija 2,513,487.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202313/06/202312.746 Tasa Fija 182,927.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202305/07/202312.746 Tasa Fija 308,350.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202305/05/202312.4745 Tasa Fija 3,177.23

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202305/05/202312.4745 Tasa Fija 176,579.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202313/07/202312.746 Tasa Fija 4,024,075.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202311/09/202311.5274 Tasa Fija 8,502,721.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202312/09/202311.5274 Tasa Fija 5,001,601.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202310/05/202312.4872 Tasa Fija 23,554.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202310/04/202312.4872 Tasa Fija 39,047.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202328/07/202312.9665 Tasa Fija 4,385,181.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202315/05/202311.5274 Tasa Fija 1,181,358.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202314/07/202311.4372 Tasa Fija 1,005,083.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202330/06/202311.5149 Tasa Fija 5,003,198.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202312/06/202311.4372 Tasa Fija 349,971.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202313/06/202311.4372 Tasa Fija 388,857.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202314/06/202311.4372 Tasa Fija 258,589.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202303/04/202312.4872 Tasa Fija 200,469.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202314/06/202312.763 Tasa Fija 36,006.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202303/07/202312.763 Tasa Fija 280,657.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202305/07/202312.763 Tasa Fija 94,478.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202305/07/202312.763 Tasa Fija 135,520.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202311/09/202313.4665 Tasa Fija 273,014.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202312/09/202311.4372 Tasa Fija 2,512,708.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202310/04/202312.4872 Tasa Fija 79,332.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202307/07/202312.763 Tasa Fija 650,057.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202310/04/202312.4872 Tasa Fija 197,731.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202310/04/202312.4872 Tasa Fija 123,397.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202330/06/202312.763 Tasa Fija 318,930.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202314/04/202312.4872 Tasa Fija 19,224.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202304/05/202312.4872 Tasa Fija 413,597.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202307/07/202312.763 Tasa Fija 668,982.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202314/06/202312.763 Tasa Fija 42,376.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202305/07/202312.763 Tasa Fija 226,699.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202307/09/202313.4665 Tasa Fija 3,017,961.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202312/09/202311.5274 Tasa Fija 15,004,803.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202305/07/202312.763 Tasa Fija 17,049.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202306/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202309/06/20236.0773 Tasa Fija 78,441.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202314/07/202311.4474 Tasa Fija 1,004,769.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202321/04/202312.4974 Tasa Fija 465,449.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202316/05/202312.4974 Tasa Fija 798,511.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202305/04/202312.4974 Tasa Fija 6,453.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202330/06/202312.7699 Tasa Fija 614,508.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202323/05/202312.7699 Tasa Fija 605,780.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202310/07/202312.7699 Tasa Fija 701,230.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202305/07/202312.7699 Tasa Fija 873,227.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202312/09/202313.4665 Tasa Fija 35,170.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202315/05/202312.4974 Tasa Fija 69,057.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202308/05/202312.4974 Tasa Fija 12,765.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202307/07/202312.7699 Tasa Fija 1,292,986.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202310/07/202312.7699 Tasa Fija 3,159,657.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202312/07/202312.7699 Tasa Fija 143,711.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202305/07/202312.7699 Tasa Fija 155,304.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202312/09/202313.4665 Tasa Fija 93,180.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202313/09/202311.5274 Tasa Fija 11,503,682.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202311/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202325/04/202312.4974 Tasa Fija 68,589.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202304/08/202313.3933 Tasa Fija 16,263.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202331/08/202313.3933 Tasa Fija 180,960.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202307/09/202313.3933 Tasa Fija 2,936,122.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202314/07/202311.5274 Tasa Fija 4,501,440.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202315/05/202312.5 Tasa Fija 1,619,238.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202310/07/202312.7749 Tasa Fija 358,968.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202312/07/202312.7749 Tasa Fija 387,366.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202310/07/202312.7749 Tasa Fija 244,393.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202305/07/202312.7749 Tasa Fija 45,496.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202307/09/202313.4587 Tasa Fija 267,741.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202318/05/202311.5274 Tasa Fija 1,081,326.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202318/05/202311.5274 Tasa Fija 1,081,326.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/06/202311.45 Tasa Fija 2,006,997.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202305/07/202312.7749 Tasa Fija 631,880.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202315/05/202312.5 Tasa Fija 78,980.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202312/06/202312.7749 Tasa Fija 364,681.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202316/06/202312.7749 Tasa Fija 478,873.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202305/07/202312.7749 Tasa Fija 637,447.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202307/09/202313.4587 Tasa Fija 8,779.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/06/202311.45 Tasa Fija 451,574.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202312/05/202312.5 Tasa Fija 5,875.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202302/06/202312.7749 Tasa Fija 202,060.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202306/07/202312.7749 Tasa Fija 56,543.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202319/06/202312.7749 Tasa Fija 258,440.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202310/07/202312.7749 Tasa Fija 46,604.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202307/09/202313.4587 Tasa Fija 348,396.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202314/09/202311.45 Tasa Fija 316,102,062.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202315/09/202311.45 Tasa Fija 60,209,916.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202315/09/202311.45 Tasa Fija 30,104,958.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202315/09/202311.45 Tasa Fija 26,090,963.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa

Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 1,003,498.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 1,003,498.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 4,013,994.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 5,519,242.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 7,024,490.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 6,020,991.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202319/05/202311.45 Tasa Fija 5,017,493.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202317/04/20235.95106 Tasa Fija 170,540.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202315/05/20236.0169 Tasa Fija 3,066,752.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202319/05/202311.5274 Tasa Fija 1,086,082.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202310/04/20235.95106 Tasa Fija 70,123.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202320/07/202311.455 Tasa Fija 1,003,181.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202315/05/202312.505 Tasa Fija 24,999.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202317/04/202312.505 Tasa Fija 365,078.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202307/07/202312.7774 Tasa Fija 36,820.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202312/06/202312.7774 Tasa Fija 32,168.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202319/07/202312.7774 Tasa Fija 1,810,834.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202305/07/202312.7774 Tasa Fija 8,377.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202302/06/202312.7774 Tasa Fija 25,632.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202310/07/202312.7774 Tasa Fija 16,523.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202319/07/202312.7774 Tasa Fija 102,742.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202305/07/202312.7774 Tasa Fija 102,608.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202305/07/202312.7774 Tasa Fija 85,469.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202317/05/202411.5274 Tasa Fija 10,003,202.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202318/09/202311.455 Tasa Fija 27,085,912.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202325/04/202312.505 Tasa Fija 35,428.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202317/04/202312.505 Tasa Fija 14,014.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202305/06/202312.7774 Tasa Fija 229,508.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202305/06/202312.7774 Tasa Fija 216,307.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202305/06/202312.7774 Tasa Fija 2,497.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202318/09/202311.455 Tasa Fija 2,457,795.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202313/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202310/05/202312.505 Tasa Fija 163,213.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202319/05/202311.455 Tasa Fija 5,015,909.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/03/202321/07/202311.465 Tasa Fija 1,002,866.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202302/06/20236.02369 Tasa Fija 1,268,887.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202315/05/20236.02369 Tasa Fija 2,042.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/03/202322/05/202311.5274

Tasa Fija 1,063,222.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202325/04/202312.515 Tasa Fija 152,687.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202305/05/202312.515 Tasa Fija 9,261.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202304/05/202312.515 Tasa Fija 202,875.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202317/04/202312.515 Tasa Fija 316.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202304/05/202312.515 Tasa Fija 798,017.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202304/05/202312.515 Tasa Fija 59,756.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202312/06/202312.785 Tasa Fija 176,033.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202305/06/202312.785 Tasa Fija 28,133.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202305/07/202312.785 Tasa Fija 17,282.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202305/07/202312.785 Tasa Fija 11,949.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202305/07/202312.785 Tasa Fija 90,304.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/03/202319/09/202311.465
Tasa Fija 2,386,821.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202314/07/202312.785 Tasa Fija 67,265.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202321/06/202312.785 Tasa Fija 210,125.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202322/05/202312.515 Tasa Fija 145,496.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202326/04/202312.515 Tasa Fija 40,103.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202328/06/202312.785 Tasa Fija 70,922.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202308/09/202313.4671 Tasa Fija 186,965.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/03/202318/07/202311.5274
Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202310/04/20235.97555 Tasa Fija 39,911.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202317/04/20235.97555 Tasa Fija 368,211.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202321/04/202312.5249 Tasa Fija 186,117.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202310/05/202312.5249 Tasa Fija 20,486.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/07/202312.8024 Tasa Fija 410,080.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202321/06/202312.8024 Tasa Fija 258,011.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/07/202312.8024 Tasa Fija 4,614,213.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202313/07/202312.8024 Tasa Fija 464,959.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202314/09/202313.4325 Tasa Fija 4,694,122.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202321/07/202311.4749
Tasa Fija 1,002,549.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202321/04/202312.5249 Tasa Fija 330,496.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202302/05/202312.5249 Tasa Fija 220,202.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202317/07/202312.8024 Tasa Fija 674,708.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/07/202312.8024 Tasa Fija 2,589,809.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202305/07/202312.8024 Tasa Fija 628,236.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202314/09/202313.4325 Tasa Fija 183,546.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202321/04/202312.5249 Tasa Fija 226,491.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202320/09/202311.4749
Tasa Fija 2,506,374.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202321/04/202312.5249 Tasa Fija 247,513.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202307/07/202312.8024 Tasa Fija 42,682.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202321/04/202312.5249 Tasa Fija 289,993.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202314/09/202313.4325 Tasa Fija 1,381,373.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202315/09/20235.28979
Tasa Fija 7,634,890.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202322/05/202312.5249 Tasa Fija 682,564.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202322/05/202312.5249 Tasa Fija 59,785.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202323/06/202312.8024 Tasa Fija 65,879.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202317/07/202312.8024 Tasa Fija 2,757,452.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/07/202312.8024 Tasa Fija 269,817.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202323/06/202312.8024 Tasa Fija 421,679.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/06/202312.8024 Tasa Fija 59,004.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202305/07/202312.8024 Tasa Fija 11,949.42

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/09/202313.4325 Tasa Fija 191,681.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202314/09/202313.4325 Tasa Fija 2,030,767.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202312/09/202313.4325 Tasa Fija 50,315.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202319/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202322/05/20236.09779 Tasa Fija 257,254.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202324/04/20235.99236 Tasa Fija 868,124.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202302/05/20236.09779 Tasa Fija 1,754,797.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202326/05/202312.5374 Tasa Fija 702,951.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202325/04/202312.5374 Tasa Fija 53,251.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202322/05/202312.5374 Tasa Fija 948,522.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202314/07/202312.8049 Tasa Fija 951,421.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202321/07/202312.8049 Tasa Fija 253,534.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202322/06/202312.8049 Tasa Fija 98,350.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/06/202312.8049 Tasa Fija 115,740.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/07/202312.8049 Tasa Fija 1,896,537.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/06/202312.8049 Tasa Fija 99,315.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202317/07/202312.8049 Tasa Fija 733,266.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202322/05/202312.5374 Tasa Fija 44,878.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202314/07/202312.8049 Tasa Fija 17,889.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/06/202312.8049 Tasa Fija 75,099.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202305/07/202312.8049 Tasa Fija 335.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202305/07/202312.8049 Tasa Fija 187,038.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202324/08/202313.464 Tasa Fija 9,784.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202325/07/202311.5274 Tasa Fija 2,500,800.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202314/07/202312.8049 Tasa Fija 213,715.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/06/202312.8049 Tasa Fija 156,594.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/07/202312.8049 Tasa Fija 161,444.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202321/09/202311.4874 Tasa Fija 1,502,393.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/07/202312.8049 Tasa Fija 3,990.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202305/07/202312.8049 Tasa Fija 47,804.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202314/09/202313.464 Tasa Fija 819,844.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202304/08/202313.464 Tasa Fija 1,348,831.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202325/07/202311.5274 Tasa Fija 15,004,803.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202316/06/20236.07636 Tasa Fija 193,970.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202322/05/20236.07636 Tasa Fija 29,013.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202310/07/20236.1946 Tasa Fija 98,073.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202315/05/202312.5486 Tasa Fija 26,898.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202320/07/202312.8224 Tasa Fija 128,777.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202317/07/202312.8224 Tasa Fija 55,204.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224 Tasa Fija 217,628.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/03/202326/06/202311.4986 Tasa Fija 400,511.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/03/202315/05/202411.5274 Tasa Fija 10,003,202.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/03/202322/09/202311.4986 Tasa Fija 1,577,012.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202323/05/202312.5486 Tasa Fija 62,598.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202304/05/202312.5486 Tasa Fija 292,964.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202304/05/202312.5486 Tasa Fija 1,513.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202304/05/202312.5486 Tasa Fija 162,817.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202307/06/202312.8224 Tasa Fija 110,940.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202323/06/202312.8224 Tasa Fija 64,665.26

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202319/06/202312.8224 Tasa Fija 78,256.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224 Tasa Fija 89,799.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224 Tasa Fija 297,049.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224 Tasa Fija 341,970.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224 Tasa Fija 464,893.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224 Tasa Fija 1,086,177.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/06/202312.8224 Tasa Fija 8,371.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202312/06/202312.8224 Tasa Fija 16,166.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202308/09/202313.4743 Tasa Fija 817,368.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/03/202326/06/202311.5274 Tasa Fija 25,008,005.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/03/202320/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202317/07/20236.05984 Tasa Fija 35,880.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202325/05/202312.5535 Tasa Fija 138,192.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202305/05/202312.5535 Tasa Fija 3,837.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202324/04/202312.5535 Tasa Fija 463,301.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202325/07/202312.8235 Tasa Fija 422,887.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/03/202327/07/202311.5035 Tasa Fija 1,000,958.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/03/202325/09/202311.5035 Tasa Fija 1,751,677.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202305/07/202312.8235 Tasa Fija 61,890.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202305/07/202312.8235 Tasa Fija 328,712.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202322/09/202313.5121 Tasa Fija 309,347.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/03/202325/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202310/04/202312.5535 Tasa Fija 169,777.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202322/05/202312.5535 Tasa Fija 16,314.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202324/04/202312.5535 Tasa Fija 18,972.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202317/07/202312.8235 Tasa Fija 58,183.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202322/09/202313.5121 Tasa Fija 3,100,698.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202315/08/202313.5121 Tasa Fija 10,249.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/03/202327/06/202311.5274 Tasa Fija 25,008,005.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202304/05/202312.5535 Tasa Fija 247,912.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202324/04/20236.00883 Tasa Fija 17,083.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202315/05/20236.09116 Tasa Fija 7,645.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202328/07/202311.5149 Tasa Fija 400,255.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202324/05/202312.5649 Tasa Fija 9,725.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202315/05/202312.5649 Tasa Fija 217,428.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202321/07/202312.8399 Tasa Fija 1,066,137.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202327/06/202312.8399 Tasa Fija 200,242.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202319/06/202312.8399 Tasa Fija 302,368.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202305/06/202312.8399 Tasa Fija 1,068,795.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202305/07/202312.8399 Tasa Fija 67,159.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202326/09/202311.5149 Tasa Fija 1,751,119.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202326/09/202311.5149 Tasa Fija 1,500,959.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202304/05/202312.5649 Tasa Fija 241,680.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202326/07/202312.8399 Tasa Fija 59,718.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202319/07/202312.8399 Tasa Fija 77,548.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202320/06/202312.8399 Tasa Fija 12,029.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202305/05/202312.5649 Tasa Fija 208,723.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202326/05/202312.5649 Tasa Fija 8,289,544.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202321/07/202312.8399 Tasa Fija 1,181,928.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202319/07/202312.8399 Tasa Fija 199,587.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202305/07/202312.8399 Tasa Fija 23,903.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202323/05/202312.5649 Tasa Fija 184,245.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202319/07/202312.8399 Tasa Fija 225,285.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202326/09/202311.5149 Tasa Fija 20,012,794.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202326/09/202311.5149 Tasa Fija 13,008,316.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202326/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202316/06/20236.09833 Tasa Fija 18,270.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202310/07/20236.26464 Tasa Fija 200,957.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202328/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202312/05/202312.5774 Tasa Fija 23,385.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202326/07/202312.8474 Tasa Fija 435,597.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202328/07/202312.8474 Tasa Fija 2,000,713.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474 Tasa Fija 383,170.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202327/09/202311.5274 Tasa Fija 1,750,560.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202327/09/202311.5274 Tasa Fija 1,750,560.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202326/05/202312.5774 Tasa Fija 128,514.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202331/05/202312.8474 Tasa Fija 342,446.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202317/07/202312.8474 Tasa Fija 84,484.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474 Tasa Fija 103,094.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474 Tasa Fija 135,919.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202315/08/202313.5104 Tasa Fija 51,397.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202304/08/202313.5104 Tasa Fija 315,643.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202329/05/202312.5774 Tasa Fija 42,875.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202318/07/202312.8474 Tasa Fija 206,627.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202326/06/202312.8474 Tasa Fija 33,007.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202324/07/202312.8474 Tasa Fija 4,148,433.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202326/07/202312.8474 Tasa Fija 64,359.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202327/07/202311.5274 Tasa Fija 1,000,320.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202329/06/202311.5274 Tasa Fija 400,128.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202314/07/202312.8474 Tasa Fija 76,473.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474 Tasa Fija 83,794.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202324/07/202312.8474 Tasa Fija 44,447.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474 Tasa Fija 17,884.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202321/09/202313.5104 Tasa Fija 5,355,253.41
FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo31/05/202201/06/2023 7.36000000000001 Tasa Fija 2,052,168.70
FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo31/05/202231/03/2024 7.90285714285714 Tasa Fija 489,983.11
TOTAL 5,091,164,204.13 13,135,816,659.87 2,231,641,468.89 1,764,277,204.18 1,920,405,989.92 297,944,321.17 672,782,710.70 9,928,159.14 32,556,418.58 80,564,753.77 19,563,616.89 -
Total bancarios 5,091,164,204.13 13,135,816,659.87 2,231,641,468.89 1,764,277,204.18 1,920,405,989.92 297,944,321.17 11,150,141,863.81 9,928,159.14 32,556,418.58 80,564,753.77 19,563,616.89 -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de

interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]
Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año
[miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años
o más [miembro]
Bursátiles y colocaciones privadas [sinopsis]
Bursátiles listadas en bolsa (quirografarios)
Scotiabank / VARIOSNo28/06/201316/06/20237.3 1,150,000,000.00
TOTAL 1,150,000,000.00 - - - - - - - - - - -
Bursátiles listadas en bolsa (con garantía)

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Colocaciones privadas (quirografarios)
Scotiabank / FONDOS HSBCNo19/10/202204/10/202311.296 1,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo22/11/202221/11/202311.3545 1,500,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo23/11/202208/11/202311.3445 2,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo30/11/202204/10/202311.39 1,500,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo30/11/202214/06/202311.375 1,500,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo02/12/202217/11/202311.3949 1,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo08/12/202223/11/202311.4449 2,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo08/12/202225/05/202311.4149 2,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo13/12/202213/12/202311.315 1,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo14/12/202231/05/202311.316 2,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo19/12/202208/05/202311.324 2,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo21/12/202212/04/202311.3445 3,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo21/12/202212/04/202311.3445 2,000,000,000.00
Scotiabank / PRLV IMSSNo22/12/202213/04/202311.04 2,068,693,341.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo23/12/202203/07/202311.334 300,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo26/12/202217/04/202311.37 3,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo30/01/202311/09/202311.4074 1,250,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo30/01/202306/11/202311.4174 1,250,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo31/01/202318/07/202311.4086 60,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo31/01/202302/01/202411.4286 900,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo31/01/202315/08/202311.4186 2,500,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo28/02/202330/01/202411.4386 2,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo28/02/202313/02/202411.3495 350,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo30/03/202329/02/202411.44 2,500,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo31/03/202301/03/202411.44 1,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo31/03/202301/03/202411.49 1,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo31/03/202315/09/202311.54 1,000,000,000.00
Scotiabank / MONEX CBNo11/10/202210/10/20235.28557 20,000,000.00
Scotiabank / MONEX CBNo11/10/202210/10/20235.28557 20,000,000.00
Scotiabank / SCOTIABANK CAYMANNo18/12/201405/12/20247.4 2,093,000,000.00
Scotiabank / SCOTIABANK CAYMANNo28/06/201809/06/203312.3 3,360,000,000.00
Scotiabank / SCOTIABANK CAYMANNo11/09/201805/09/202311.32 3,455,000,000.00
Scotiabank / PRLV IMSSNo31/01/202315/01/202411.6 1,112,261,666.00
TOTAL 37,383,693,341.00 10,955,261,666.00 - - - 3,360,000,000.00
40,000,000.00 - - - - -
Colocaciones privadas (con garantía)

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total bursátiles listados en bolsa y colocaciones privadas 38,533,693,341.00

10,955,261,666.00 - - - 3,360,000,000.00 40,000,000.00 - - - - -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo [sinopsis]
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total otros pasivos circulantes y no circulantes con costo - - - - - - - - - - - -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Proveedores [sinopsis]
Proveedores

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total proveedores - - - - - - - - - - - - -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo [sinopsis]
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo - - - - - - - - - - - -
Total de créditos43,624,857,545.1324,091,078,325.872,231,641,468.891,764,277,204.181,920,405,989.923,657,944,321.1711,190,141,863.819,928,159.1432,556,418.5880,564,753.7719,563,616.890.00

Comentarios:
El tipo de cambio tomado al cierre de MARZO fue de 18.0201

VER ARCHIVO COMPLETO

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 Administracion 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.

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

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

Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de MercadoDerivado
1.Flujos de EfectivoPagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija PasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
2.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente.Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
3.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotanteActivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
4.Valor RazonableCartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o ExtranjeraActivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
5.Flujos de EfectivoCertificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
6.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
7.Flujos de EfectivoReportosPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
8.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjeraActiva Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXNCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional
9.Flujo de EfectivoBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesosCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

Subyacente*FuturosOpcionesSwaps
MRMEMRMEMRME
Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.
Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.
Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas
Operaciones de Opción sobre futuros de índice.
Moneda nacional, Divisas y UDIS;
Oro y Plata
Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.
Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (CurrencySwaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (ForwardStarting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o

negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.
(MR) Mercados reconocidos
(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

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

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.

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

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

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

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de marzo 2023 y en promedio para el primer trimestre de 2023 es de:

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)17,54632,749
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)89,51289,364

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

Inventario de modelos de derivados

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

Instrumentos a Valor Razonable

Clase de
activoDerivadoTipoBreve descripción
Tasas de interésOpcionesEuropeaCaps, 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=∑_(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=∑_(i=1)^n▒Floorlet_i
BinariaLa 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 nocional 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 nocional 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).
CCIRSIntercambio de intereses en moneda nacional por intereses
en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.
Tipo de cambioOpcionesEuropeaEn este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.
AmericanaEl enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)
BinariaSe 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.
BarreraUna 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.
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.

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
activoDerivadoTipoBreve descripción
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 repreciación ocurre justamente al pago de cupón.

Bonos Cupón Cero

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

Riesgo de Crédito

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

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

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

Para efectos de determinar la sensibilidad a cambios en la curva de rendimiento de

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

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

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.
Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2023 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se

concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el primer trimestre de 2023 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por inefectividad.

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

c. Información de Riesgos por el uso de Derivados

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

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

los límites establecidos.

Al cierre de marzo de 2023 y promedio del primer trimestre 2023 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)89,51289,364

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:
ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

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

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

Scotiabank
(millones de pesos)NormalEscenario PosibleEscenario ProbableEscenario de Estrés
Gap 30d Gap Acum17,54614,77914,76514,751
Cambios en el Gap respecto al escenario normal(2,767)(2,781)(2,796)

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

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

Gamma1 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un

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

Vega

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.
Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

Rho

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

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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, 2023:

Scotiabank
0-3 Meses3 - 12 Meses1 - 3 Años3 - 5 Años5 - 10 Años10 - 30 AñosTotal
Swaps(17,639.15)(5,530.19)(246,330.40)130,512.4538,481.49(60,128.23)(160,634.03)
CCS24,720.66(2,255.17)(1,493.87)344.74258.56(28.73)21,546.19
Caps&Floors158.01(57.45)158.0157.45--316.02
Binary Caps&Floors-------
TIIE Futures-------
Mbonds Futures-------
Total DERIVADOS7,239.52(7,842.81)(247,666.26)130,914.6438,740.05(60,156.96)
(138,771.82)
Cifras expresadas en pesos

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

Bajo el escenario probable una pérdida de (161.09) Millones de pesos.
Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (322.18) Millones de pesos.
Y finalmente con el escenario muy poco probable (798.5) 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 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(0.14)65.9750.00(6.94)100.00(13.88)200.00
(27.75)
Volatilidad al 1%Caps & Floors-(0.01)0.10-0.40-1.00-
a FX %Forwards85.541,541.490.10(154.15)0.20(308.30)0.50(770.75)
a FX %Opciones Divisa--0.10-0.20-0.50-
Total(161.09)(322.18)(798.50)

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 31 de marzo de 2023 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

OpcionesDeltaVegaGamma
Options BNPUI5.INDX61,647.002,152.0027,961.00
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options EZU.P---
Options FXI.P---
Options GLD.P---
Options ICLN.OQ---
Options IDBTV1.INDX93,577.001,953.0035,650.00
Options MCHI.OQ---
Options MSFDV1.INDX---
Options NVDA.OQ---
Options QQQ.OQ---
Options SOXX.OQ---
Options SPXSR5.INDX---
Options SOXX.OQ---
Options SPXSR5.INDX---
TOTAL155,224.004,105.0063,611.00
Cifras expresadas en pesos

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 BNPUI5.INDX(6,164.70)(18,494.10)(30,823.50)
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options EZU.P---
Options FXI.P---
Options GLD.P---
Options ICLN.OQ---
Options IDBTV1.INDX(9,357.70)(28,073.10)(46,788.50)
Options MEXIBX.INDX---
Options MXSXAE.INDX---
Options HSCE.INDX---
Options MEXXLK.USM---
Options IBM.USM---
Options SBUX.USM---
Options IBM.USM---
Options SBUX.USM---
TOTAL(15,522.40)(46,567.20)(77,612.00)
Cifras expresadas en pesos

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco

probable 20% son los siguientes:

Escenarios al alza(0.1)(0.3)(0.5)
Options BNPUI5.INDX3,082.359,247.0512,329.40
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options EZU.P---
Options FXI.P---
Options GLD.P---
Options ICLN.OQ---
Options IDBTV1.INDX4,678.8514,036.5518,715.40
Options MEXIBX.INDX---
Options MXSXAE.INDX---
Options HSCE.INDX---
Options MEXXLK.USM---
Options IBM.USM---
Options SBUX.USM---
Options IBM.USM---
Options SBUX.USM---
TOTAL7,761.2023,283.6031,044.80
Cifras expresadas en pesos

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:

ScotiabankMonto
Probable(15,522.40)
Poco Probable(46,567.20)
Muy poco Probable(77,612.00)
Cifras expresadas en pesos

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 2023 se tienen los siguientes saldos:

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado
CLIENTE 1MXN48,800,000(207,800,000)
CLIENTE 2MXN430,000,000(492,000,000)
CLIENTE 3MXN561,900,000(264,600,000)
CLIENTE 4MXN50,800,000(84,100,000)
CLIENTE 5MXN823,400,053(1,422,100,000)
CLIENTE 6USD70,470,000(107,690,000)
CLIENTE 7USD45,800,000(25,720,000)
CLIENTE 8USD252,900,000(345,200,000)
CLIENTE 9USD2,210,000(890,000)
CLIENTE 10USD7,400,000(9,330,000)
CLIENTE 11USD150,000(100,000)
CLIENTE 12USD10,430,000(6,900,000)

CLIENTE 13USD260,000-
CLIENTE 14USD3,660,000(3,200,000)
CLIENTE 15MXN140,500,000(352,300,000)
CLIENTE 16MXN179,300,000(229,500,000)
CLIENTE 17MXN7,400,000-
CLIENTE 18MXN1,622,800,000(576,900,000)
CLIENTE 19MXN351,675,414(1,128,878,132)
CLIENTE 20MXN8,400,000(1,700,000)
CLIENTE 21USD14,090,000(5,630,000)
CLIENTE 22USD2,710,000(42,550,000)
CLIENTE 23USD19,380,000(20,020,000)
TOTAL 4,654,435,467(5,327,108,132)
Cifras expresadas en pesos

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

Liquidados anticipadamente

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados
Cifras expresadas en pesos

ver archivo completo en pdf